

# 中信建投睿信灵活配置混合型证券投资基金

## 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:交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通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	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§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	47
7.1 期末基金资产组合情况	47
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	48
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	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	57
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	69
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	69
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	69
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	69
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	69
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	69
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	69
7.12 投资组合报告附注	69
§8 基金份额持有人信息	70
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	70
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	71

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 .....	71
§9 开放式基金份额变动 .....	71
§10 重大事件揭示 .....	72
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	72
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 .....	72
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	72
10.4 基金投资策略的改变 .....	72
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	72
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 .....	72
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	73
10.8 其他重大事件 .....	74
§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....	75
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 .....	75
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	75
§12 备查文件目录 .....	75
12.1 备查文件目录 .....	75
12.2 存放地点 .....	76
12.3 查阅方式 .....	76

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中信建投睿信灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	中信建投睿信	
基金主代码	000926	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年02月03日	
基金管理人	中信建投基金管理有限公司	
基金托管人	交通银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	115,826,272.69份	
基金合同存续期	不定期	
下属各类别基金的基金简称	中信建投睿信A	中信建投睿信C
下属各类别基金的交易代码	000926	004676
报告期末下属各类别基金的份额总额	18,025,956.03份	97,800,316.66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，通过灵活的资产配置与严谨的风险管理，力争实现基金资产的长期稳健增值。
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	年化收益率7%
风险收益特征	本基金属于混合型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金，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	交通银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	朱伟	陆志俊
	联系电话	010-59100208	95559
	电子邮箱	zhuweibj@csc.com.cn	luzj@bankcomm.com
客户服务电话		4009-108-108	95559
传真		010-59100298	021-62701216
注册地址		北京市怀柔区桥梓镇八龙桥 雅苑3号楼1室	中国(上海)自由贸易试验区 银城中路188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	中国(上海)长宁区仙霞路18 号
邮政编码		100010	200336
法定代表人		黄凌	任德奇

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
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)	
	中信建投睿信A	中信建投睿信C

本期已实现收益	-186,598.39	-601,043.30
本期利润	-235,448.70	30,577.94
加权平均基金份额本期利润	-0.0149	0.0021
本期加权平均净值利润率	-2.05%	0.28%
本期基金份额净值增长率	-1.29%	-1.34%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	报告期末 (2023年06月30日)	
期末可供分配利润	-5,355,142.12	-26,472,584.44
期末可供分配基金份额利润	-0.2971	-0.2707
期末基金资产净值	12,670,813.91	71,327,732.22
期末基金份额净值	0.7029	0.7293
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	报告期末 (2023年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	-29.71%	-27.07%

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

中信建投睿信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	0.54%	0.65%	0.36%	0.01%	0.18%	0.64%
过去三个月	-4.74%	0.62%	1.11%	0.01%	-5.85%	0.61%

过去六个月	-1.29%	0.61%	2.23%	0.02%	-3.52%	0.59%
过去一年	-10.80%	1.50%	4.61%	0.01%	-15.41%	1.49%
过去三年	-13.62%	1.49%	15.23%	0.01%	-28.85%	1.48%
自基金合同生效起至今	-29.71%	1.39%	58.88%	0.02%	-88.59%	1.37%

中信建投睿信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	0.54%	0.65%	0.40%	0.01%	0.14%	0.64%
过去三个月	-4.77%	0.62%	1.24%	0.01%	-6.01%	0.61%
过去六个月	-1.34%	0.61%	2.49%	0.02%	-3.83%	0.59%
过去一年	-10.89%	1.50%	5.15%	0.02%	-16.04%	1.48%
过去三年	-13.87%	1.49%	17.23%	0.02%	-31.10%	1.47%
自基金合同生效起至今	-27.07%	1.32%	42.88%	0.02%	-69.95%	1.30%

**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**



中信建投睿信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  
(2015年02月03日-2023年06月30日)



中信建投睿信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17日-2023年06月30日)



注：1、以上第1张图为中信建投睿信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2015年2月3日（基金合同生效日）至2023年6月30日；

2、以上第2张图为中信建投睿信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17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		
孙文	本基金的 基金经理	2021-11-02	-	6年	中国籍，1990年10月生，对外经济贸易大学金融学硕士。2016年7月加入中信建投基金管理有限公司，曾任交易部股票交易员、研究部研究员、权益投资部基金经理助理，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、中信建投睿溢混合型证券投资基金、中信建投北交所精选

					两年定期开放混合型证券投资基金基金经理。
杨志武	本基金的基金经理	2022-12-04	-	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，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。

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遵规守信情况的说明

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非公平交易的情况。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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信A基金份额净值为0.7029元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-1.29%，同期业绩比较基准收益率为2.23%；截至报告期末中信建投睿信C基金份额净值为0.7293元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-1.34%，同期业绩比较基准收益率为2.49%。

### 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1月28日起至2023年6月26日连续581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。截至本报告期末上述情形已消除。

## §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

本期间，基金托管人在中信建投睿信灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

### 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

本期间，中信建投基金管理有限公司在中信建投睿信灵活配置混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配，符合基金合同的规定。

### 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

本期间，由中信建投基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关中信建投睿信灵活配置混合型证券投资基金的中期报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、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：中信建投睿信灵活配置混合型证券投资基金

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	21,996,658.84	1,993,264.80
结算备付金		-	178,001.54
存出保证金		-	-

交易性金融资产	6.4.7.2	60,835,375.96	10,379,713.75
其中：股票投资		60,835,375.96	10,379,713.75
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	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-3,321.09	-
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		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		1,256,886.48	32,359.07
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		84,085,600.19	12,583,339.16
<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		-	-
应付赎回款		29,174.41	32,144.98

应付管理人报酬		20,008.88	8,961.24
应付托管费		5,002.25	2,240.31
应付销售服务费		1,552.02	227.42
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	6.4.7.5	31,316.50	72,234.54
负债合计		87,054.06	115,808.49
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.6	115,826,272.69	17,378,838.51
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.7	-31,827,726.56	-4,911,307.84
净资产合计		83,998,546.13	12,467,530.67
负债和净资产总计		84,085,600.19	12,583,339.16

注：报告截止日2023年6月30日，基金份额总额115,826,272.69份。其中A类基金份额净值0.7029元，基金份额18,025,956.03份；C类基金份额净值0.7293元，基金份额97,800,316.66份。

## 6.2 利润表

会计主体：中信建投睿信灵活配置混合型证券投资基金

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
一、营业总收入		-59,649.45	-2,292,463.51
1.利息收入		11,496.38	15,836.03
其中：存款利息收入	6.4.7.8	9,835.83	15,836.03
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		1,660.55	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-724,482.26	-2,240,108.59
其中：股票投资收益	6.4.7.9	-930,678.48	-2,257,534.39
基金投资收益		-	-
债券投资收益		-	5,077.53
资产支持证券投资		-	-
收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.10	-	-
股利收益	6.4.7.11	206,196.22	12,348.27
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	6.4.7.12	582,770.93	-72,827.21
以“-”号填列）			
4.汇兑收益（损失以“-”		-	-
号填列）			
5.其他收入（损失以“-”	6.4.7.13	70,565.50	4,636.26
号填列）			
<b>减：二、营业总支出</b>		145,221.31	94,968.55
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	87,151.49	51,087.56
2. 托管费	6.4.10.2.2	21,787.88	12,771.84
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	5,209.00	953.36
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	6.4.7.14	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.15	31,072.94	30,155.79
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-204,870.76	-2,387,432.06
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-204,870.76	-2,387,432.06
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-204,870.76	-2,387,432.06

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：中信建投睿信灵活配置混合型证券投资基金

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）	17,378,838.51	-	-4,911,307.84	12,467,530.67
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）	17,378,838.51	-	-4,911,307.84	12,467,530.67
三、本期增减变动额（减少以	98,447,434.18	-	-26,916,418.72	71,531,015.46

“-”号填列)				
(一)、综合收益总额	-	-	-204,870.76	-204,870.76
(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)	98,447,434.18	-	-26,711,547.96	71,735,886.22
其中: 1.基金申购款	126,038,749.56	-	-33,655,186.92	92,383,562.64
2.基金赎回款	-27,591,315.38	-	6,943,638.96	-20,647,676.42
(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)	115,826,272.69	-	-31,827,726.56	83,998,546.13
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)	15,976,977.34	-	-851,725.24	15,125,252.10
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）	15,976,977.34	-	-851,725.24	15,125,252.10
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-663,083.23	-	-2,331,340.88	-2,994,424.11
（一）、综合收益总额	-	-	-2,387,432.06	-2,387,432.06
（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）	-663,083.23	-	56,091.18	-606,992.05
其中：1.基金申购款	1,985,534.16	-	-312,362.92	1,673,171.24
2.基金赎回款	-2,648,617.39	-	368,454.10	-2,280,163.29
（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）	15,313,894.11	-	-3,183,066.12	12,130,827.99

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

中信建投睿信灵活配置混合型证券投资基金(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〔2014〕1238号《关于准予中信建投睿信灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》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《中信建投睿信灵活配置混合型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,业经安永华明会计师事务所(特殊普通合伙)验证出具安永华明(2015)验字第60952150\_A06号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《中信建投睿信灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2015年2月3日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为739,433,057.45份基金份额,其中认购资金利息折合172,426.30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,基金托管人为交通银行股份有限公司。

根据《关于中信建投睿信灵活配置混合型证券投资基金增加C类基金份额、调整赎回费率并修改基金合同和托管协议中相关条款的公告》,自2017年5月15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《中信建投睿信灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准上市的股票)、权证、股指期货等权益类金融工具,债券等固定收益类金融工具(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、中小企业私募债、地方政府债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款等)及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的

相关规定)。本基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的0-95%；中小企业私募债占基金资产净值的比例不超过20%；权证投资占基金资产净值的比例不超过3%；每个交易日日终在扣除股指期货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：年化收益率7%。

#### 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》、《中信建投睿信灵活配置混合型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相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业务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	11,259,301.26	
等于：本金	11,258,648.95	
加：应计利息	652.31	
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	10,737,357.58	
等于：本金	10,737,078.72	
加：应计利息	278.86	
减：坏账准备	-	
合计	21,996,658.84	

##### 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	60,361,724.83	-	60,835,375.96	473,651.13
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	60,361,724.83	-	60,835,375.96	473,651.13

#### 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	-3,321.09	-
银行间市场	-	-
合计	-3,321.09	-

##### 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	0.71
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	19,835.79
其他应付	11,480.00
合计	31,316.50

### 6.4.7.6 实收基金

#### 6.4.7.6.1 中信建投睿信A

金额单位：人民币元

项目 (中信建投睿信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	13,973,067.26	13,973,067.26
本期申购	9,115,220.53	9,115,220.53
本期赎回（以“-”号填列）	-5,062,331.76	-5,062,331.76
本期末	18,025,956.03	18,025,956.03

#### 6.4.7.6.2 中信建投睿信C

金额单位：人民币元

项目 (中信建投睿信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	3,405,771.25	3,405,771.25
本期申购	116,923,529.03	116,923,529.03
本期赎回（以“-”号填列）	-22,528,983.62	-22,528,983.62
本期末	97,800,316.66	97,800,316.66

### 6.4.7.7 未分配利润

#### 6.4.7.7.1 中信建投睿信A

单位：人民币元

项目 (中信建投睿信A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	1,530,181.27	-5,553,258.36	-4,023,077.09
本期利润	-186,598.39	-48,850.31	-235,448.70
本期基金份额交易产生的变动数	561,127.92	-1,657,744.25	-1,096,616.33
其中：基金申购款	1,182,979.70	-3,691,855.39	-2,508,875.69
基金赎回款	-621,851.78	2,034,111.14	1,412,259.36
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,904,710.80	-7,259,852.92	-5,355,142.12

#### 6.4.7.7.2 中信建投睿信C

单位：人民币元

项目 (中信建投睿信C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-571,441.57	-316,789.18	-888,230.75
本期利润	-601,043.30	631,621.24	30,577.94
本期基金份额交易产生的变动数	-15,663,771.51	-9,951,160.12	-25,614,931.63
其中：基金申购款	-18,993,756.95	-12,152,554.28	-31,146,311.23
基金赎回款	3,329,985.44	2,201,394.16	5,531,379.60
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-16,836,256.38	-9,636,328.06	-26,472,584.44

### 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	5,721.59



定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	3,142.23
结算备付金利息收入	72.01
其他	900.00
合计	9,835.83

#### 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	125,683,525.36
减：卖出股票成本总额	126,291,127.57
减：交易费用	323,076.27
买卖股票差价收入	-930,678.48

#### 6.4.7.10 衍生工具收益

无。

#### 6.4.7.11 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	206,196.22
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	206,196.22

#### 6.4.7.12 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	582,770.93

——股票投资	582,770.93
——债券投资	-
——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	582,770.93

#### 6.4.7.13 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	70,565.50
合计	70,565.50

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%。

#### 6.4.7.14 信用减值损失

无。

#### 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
审计费用	19,835.79
信息披露费	-
证券出借违约金	-

汇划手续费	1,237.15
账户维护费	9,600.00
其他费用	400.00
合计	31,072.94

#### 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
元达信资本管理（北京）有限公司	基金管理人的子公司
交通银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
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	成交金额	占当期

		股票成交总额的比例		股票成交总额的比例
中信建投证券股份有限公司	193,335,950.87	64.05%	-	-

#### 6.4.10.1.2 权证交易

无。

#### 6.4.10.1.3 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	9,500,000.00	100.00%	-	-

#### 6.4.10.1.4 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	101,808.57	58.64%	-	-

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	87,151.49	51,087.56
其中：支付销售机构的客户维护费	40,085.66	23,470.71

注：支付基金管理人中信建投基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.80% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.80% / 当年天数。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

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托管费	21,787.88	12,771.84

注：支付基金托管人交通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。

##### 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		
	中信建投睿信A	中信建投睿信C	合计

中信建投 基金管理 有限公司	0.00	165.85	165.85
中信建投 证券股份 有限公司	0.00	3,633.76	3,633.76
合计	0.00	3,799.61	3,799.61
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		
	中信建投睿信A	中信建投睿信C	合计
中信建投 证券股份 有限公司	0.00	1.81	1.81
合计	0.00	1.81	1.81

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0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给中信建投基金管理有限公司，再由中信建投基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：  
日销售服务费=前一日C类的基金资产净值×0.10%/当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

##### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名	本期	上年度可比期间
------	----	---------

称	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	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
交通银行股份有限公司	11,259,301.26	5,721.59	3,758,931.09	14,061.67
中信建投证券股份有限公司	10,737,357.58	1,838.00	0.00	0.00

注：本基金的银行存款由基金托管人交通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	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601298	青岛港	2023-06-28	-	6.97	2023-07-03	7.40	17,800	126,444.00	124,066.00	-

### 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。

于2023年6月30日，本基金无债券投资（2022年12月31日：同）。

### 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、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	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
---------------	-------	-------	-------	-----	----

06 月 30 日					
资产					
银行存款	21,996,658.84	-	-	-	21,996,658.84
交易性金融资产	-	-	-	60,835,375.96	60,835,375.96
买入返售金融资产	-3,321.09	-	-	-	-3,321.09
应收申购款	-	-	-	1,256,886.48	1,256,886.48
资产总计	21,993,337.75	-	-	62,092,262.44	84,085,600.19
负债					
应付赎回款	-	-	-	29,174.41	29,174.41
应付管理人报酬	-	-	-	20,008.88	20,008.88
应付托管费	-	-	-	5,002.25	5,002.25
应付销售服务费	-	-	-	1,552.02	1,552.02
其他负债	-	-	-	31,316.50	31,316.50
负债总计	-	-	-	87,054.06	87,054.06
利率敏感度缺口	21,993,337.75	-	-	62,005,208.38	83,998,546.13
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,993,264.80	-	-	-	1,993,264.80
结算备付金	178,001.54	-	-	-	178,001.54
交易性金融资	-	-	-	10,379,713.75	10,379,713.75

产					
应收申购款	-	-	-	32,359.07	32,359.07
资产总计	2,171,266.34	-	-	10,412,072.82	12,583,339.16
负债					
应付赎回款	-	-	-	32,144.98	32,144.98
应付管理人报酬	-	-	-	8,961.24	8,961.24
应付托管费	-	-	-	2,240.31	2,240.31
应付销售服务费	-	-	-	227.42	227.42
其他负债	-	-	-	72,234.54	72,234.54
负债总计	-	-	-	115,808.49	115,808.49
利率敏感度缺口	2,171,266.34	-	-	10,296,264.33	12,467,530.67

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，本基金未持有交易性债券投资（2022年12月31日：同），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	60,835,375.96	72.42	10,379,713.75	83.25
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
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	60,835,375.96	72.42	10,379,713.75	83.25

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除沪深300指数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
沪深300指数上升5%	2,288,027.23	397,462.95
沪深300指数下降5%	-2,288,027.23	-397,462.95

#### 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 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	60,711,309.96	10,379,713.75
第二层次	124,066.00	-
第三层次	-	-
合计	60,835,375.96	10,379,713.75

###### 6.4.14.2.2 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	60,835,375.96	72.35
	其中：股票	60,835,375.96	72.35
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	-3,321.09	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	21,996,658.84	26.16
8	其他各项资产	1,256,886.48	1.49
9	合计	84,085,600.19	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	500,140.00	0.60
B	采矿业	1,011,702.00	1.20
C	制造业	43,022,521.79	51.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,177,810.00	1.40
E	建筑业	972,232.00	1.16
F	批发和零售业	820,053.00	0.98
G	交通运输、仓储和邮政业	1,561,763.80	1.86
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	4,676,486.37	5.57
J	金融业	3,016,499.00	3.59
K	房地产业	1,030,646.00	1.23
L	租赁和商务服务业	1,174,406.00	1.40
M	科学研究和技术服务业	979,838.00	1.17
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	253,260.00	0.30
Q	卫生和社会工作	155,252.00	0.18
R	文化、体育和娱乐业	482,766.00	0.57
S	综合	-	-
	合计	60,835,375.96	72.42

### 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	002271	东方雨虹	20,200	550,652.00	0.66
2	300856	科思股份	6,500	512,005.00	0.61
3	002223	鱼跃医疗	14,000	503,860.00	0.60
4	002475	立讯精密	13,300	431,585.00	0.51
5	600512	腾达建设	152,500	408,700.00	0.49
6	688002	睿创微纳	8,904	398,899.20	0.47
7	300750	宁德时代	1,720	393,518.80	0.47
8	601012	隆基绿能	13,500	387,045.00	0.46
9	603808	歌力思	29,200	383,396.00	0.46
10	002371	北方华创	1,200	381,180.00	0.45
11	601888	中国中免	3,400	375,802.00	0.45
12	688037	芯源微	2,192	374,722.40	0.45
13	000425	徐工机械	55,300	374,381.00	0.45
14	600941	中国移动	3,800	354,540.00	0.42
15	600309	万华化学	4,000	351,360.00	0.42
16	688012	中微公司	2,223	347,788.35	0.41
17	000333	美的集团	5,900	347,628.00	0.41
18	002236	大华股份	17,600	347,600.00	0.41
19	688599	天合光能	8,048	342,925.28	0.41
20	000063	中兴通讯	7,500	341,550.00	0.41
21	600570	恒生电子	7,700	341,033.00	0.41
22	688072	拓荆科技	800	340,776.00	0.41
23	600519	贵州茅台	200	338,200.00	0.40
24	002772	众兴菌业	29,800	336,740.00	0.40
25	601985	中国核电	46,900	330,645.00	0.39
26	601318	中国平安	7,100	329,440.00	0.39
27	002688	金河生物	68,700	324,264.00	0.39
28	600887	伊利股份	11,300	320,016.00	0.38
29	002215	诺普信	42,500	319,175.00	0.38

30	603878	武进不锈	37,740	318,903.00	0.38
31	000589	贵州轮胎	56,700	317,520.00	0.38
32	002746	仙坛股份	40,200	316,776.00	0.38
33	688311	盟升电子	4,400	307,736.00	0.37
34	002311	海大集团	6,500	304,460.00	0.36
35	301117	佳缘科技	4,700	303,714.00	0.36
36	688777	中控技术	4,830	303,227.40	0.36
37	688248	南网科技	7,800	299,442.00	0.36
38	002179	中航光电	6,500	294,775.00	0.35
39	000913	钱江摩托	16,100	293,503.00	0.35
40	300316	晶盛机电	4,100	290,690.00	0.35
41	300450	先导智能	7,900	285,743.00	0.34
42	688111	金山办公	600	283,332.00	0.34
43	603027	千禾味业	13,400	283,008.00	0.34
44	600031	三一重工	16,800	279,384.00	0.33
45	002027	分众传媒	41,000	279,210.00	0.33
46	688518	联赢激光	10,000	278,600.00	0.33
47	300627	华测导航	8,500	275,995.00	0.33
48	300045	华力创通	23,700	274,920.00	0.33
49	603209	兴通股份	12,960	274,881.60	0.33
50	000725	京东方A	67,200	274,848.00	0.33
51	605060	联德股份	10,000	274,600.00	0.33
52	300833	浩洋股份	2,500	273,575.00	0.33
53	002422	科伦药业	9,200	273,056.00	0.33
54	688188	柏楚电子	1,444	272,280.64	0.32
55	603456	九洲药业	9,900	271,062.00	0.32
56	688148	芳源股份	22,200	270,840.00	0.32
57	000001	平安银行	24,100	270,643.00	0.32
58	688223	晶科能源	19,200	269,952.00	0.32
59	601600	中国铝业	49,000	269,010.00	0.32
60	600989	宝丰能源	21,200	267,332.00	0.32

61	600363	联创光电	7,200	267,120.00	0.32
62	003000	劲仔食品	21,200	266,908.00	0.32
63	300413	芒果超媒	7,800	266,838.00	0.32
64	688239	航宇科技	3,800	265,810.00	0.32
65	601702	华峰铝业	19,400	265,392.00	0.32
66	300142	沃森生物	10,000	264,500.00	0.31
67	000338	潍柴动力	21,200	264,152.00	0.31
68	300759	康龙化成	6,900	264,132.00	0.31
69	600533	栖霞建设	85,500	263,340.00	0.31
70	601878	浙商证券	26,600	262,808.00	0.31
71	600109	国金证券	30,200	261,834.00	0.31
72	002990	盛视科技	7,100	261,280.00	0.31
73	688029	南微医学	3,200	260,992.00	0.31
74	300839	博汇股份	19,600	260,484.00	0.31
75	300454	深信服	2,300	260,475.00	0.31
76	002149	西部材料	15,500	260,245.00	0.31
77	300382	斯莱克	19,700	259,843.00	0.31
78	300532	今天国际	12,600	259,056.00	0.31
79	603129	春风动力	1,600	259,040.00	0.31
80	002515	金字火腿	54,200	258,534.00	0.31
81	603290	斯达半导	1,200	258,240.00	0.31
82	002121	科陆电子	35,200	258,016.00	0.31
83	600497	驰宏锌锗	51,300	257,526.00	0.31
84	002367	康力电梯	28,200	257,466.00	0.31
85	600708	光明地产	119,900	256,586.00	0.31
86	600531	豫光金铅	40,700	256,410.00	0.31
87	002434	万里扬	28,600	255,970.00	0.30
88	601003	柳钢股份	63,300	255,732.00	0.30
89	600743	华远地产	163,800	255,528.00	0.30
90	002782	可立克	16,700	255,343.00	0.30
91	000852	石化机械	35,500	255,245.00	0.30

92	600185	格力地产	37,200	255,192.00	0.30
93	600869	远东股份	46,200	255,024.00	0.30
94	603979	金诚信	8,200	255,020.00	0.30
95	603197	保隆科技	4,700	254,975.00	0.30
96	002749	国光股份	22,500	254,925.00	0.30
97	002158	汉钟精机	10,200	254,592.00	0.30
98	300945	曼卡龙	16,400	254,528.00	0.30
99	002239	奥特佳	95,300	254,451.00	0.30
100	603033	三维股份	12,500	254,375.00	0.30
101	600562	国睿科技	15,700	254,340.00	0.30
102	600855	航天长峰	19,300	254,181.00	0.30
103	000751	锌业股份	76,900	253,770.00	0.30
104	601988	中国银行	64,900	253,759.00	0.30
105	601288	农业银行	71,800	253,454.00	0.30
106	300185	通裕重工	90,800	253,332.00	0.30
107	603330	天洋新材	22,800	253,308.00	0.30
108	603377	东方时尚	31,500	253,260.00	0.30
109	600961	株冶集团	31,300	253,217.00	0.30
110	002345	潮宏基	32,200	253,092.00	0.30
111	600458	时代新材	21,100	252,989.00	0.30
112	600006	东风汽车	42,800	252,948.00	0.30
113	600390	五矿资本	47,000	252,860.00	0.30
114	688600	皖仪科技	10,200	252,858.00	0.30
115	600959	江苏有线	74,800	252,824.00	0.30
116	002262	恩华药业	8,200	252,806.00	0.30
117	000061	农产品	42,200	252,778.00	0.30
118	001696	宗申动力	35,700	252,756.00	0.30
119	300802	矩子科技	10,500	252,735.00	0.30
120	603017	中衡设计	23,200	252,648.00	0.30
121	603328	依顿电子	30,500	252,540.00	0.30
122	600897	厦门空港	12,200	252,418.00	0.30

123	603556	海兴电力	10,000	252,400.00	0.30
124	002252	上海莱士	33,600	252,336.00	0.30
125	600033	福建高速	80,600	252,278.00	0.30
126	300145	中金环境	85,800	252,252.00	0.30
126	002334	英威腾	19,800	252,252.00	0.30
128	600879	航天电子	29,700	252,153.00	0.30
129	603551	奥普家居	19,500	252,135.00	0.30
130	600061	国投资本	35,400	252,048.00	0.30
131	688711	宏微科技	4,320	252,028.80	0.30
132	600864	哈投股份	49,300	251,923.00	0.30
133	600271	航天信息	18,400	251,896.00	0.30
134	688261	东微半导	1,800	251,766.00	0.30
135	600169	太原重工	101,500	251,720.00	0.30
136	600312	平高电气	20,300	251,517.00	0.30
137	000869	张裕A	8,200	251,412.00	0.30
138	600635	大众公用	75,700	251,324.00	0.30
139	300951	博硕科技	4,600	251,298.00	0.30
140	600547	山东黄金	10,700	251,236.00	0.30
141	300128	锦富技术	60,200	251,034.00	0.30
142	002429	兆驰股份	45,600	250,800.00	0.30
143	300098	高新兴	68,700	250,755.00	0.30
144	600498	烽火通信	12,300	250,551.00	0.30
145	601608	中信重工	59,500	250,495.00	0.30
146	603766	隆鑫通用	47,400	250,272.00	0.30
147	600101	明星电力	26,300	250,113.00	0.30
148	002649	博彦科技	17,700	250,101.00	0.30
149	002046	国机精工	19,600	250,096.00	0.30
150	601038	一拖股份	21,300	250,062.00	0.30
151	000969	安泰科技	26,400	250,008.00	0.30
152	600197	伊力特	9,200	249,964.00	0.30
153	600970	中材国际	19,600	249,900.00	0.30

154	002270	华明装备	22,800	249,660.00	0.30
155	000997	新大陆	13,200	249,480.00	0.30
156	300978	东箭科技	18,300	249,429.00	0.30
157	002976	瑞玛精密	8,900	248,933.00	0.30
158	600960	渤海汽车	66,000	248,820.00	0.30
159	603076	乐惠国际	5,200	248,612.00	0.30
160	300420	五洋停车	75,700	248,296.00	0.30
161	600320	振华重工	66,500	248,045.00	0.30
162	600489	中金黄金	24,000	247,920.00	0.30
163	600756	浪潮软件	14,900	247,638.00	0.29
164	300314	戴维医疗	11,700	247,338.00	0.29
165	600517	国网英大	43,300	246,810.00	0.29
166	000885	城发环境	18,500	246,235.00	0.29
167	000066	中国长城	17,800	246,174.00	0.29
168	002461	珠江啤酒	27,900	245,799.00	0.29
169	600835	上海机电	14,200	243,956.00	0.29
170	688618	三旺通信	3,600	243,792.00	0.29
171	600587	新华医疗	6,900	243,777.00	0.29
172	300396	迪瑞医疗	7,500	243,675.00	0.29
173	002448	中原内配	34,800	243,600.00	0.29
174	603799	华友钴业	5,200	238,732.00	0.28
175	002880	卫光生物	6,300	237,510.00	0.28
176	600958	东方证券	23,200	225,040.00	0.27
177	300896	爱美客	500	222,475.00	0.26
178	688212	澳华内镜	2,800	190,120.00	0.23
179	301039	中集车辆	12,600	166,698.00	0.20
180	300763	锦浪科技	1,600	166,560.00	0.20
181	603859	能科科技	3,200	163,616.00	0.19
182	000858	五粮液	1,000	163,570.00	0.19
183	300511	雪榕生物	21,500	163,400.00	0.19
184	300884	狄耐克	12,300	162,852.00	0.19

185	603871	嘉友国际	10,320	162,127.20	0.19
186	688281	华秦科技	800	162,000.00	0.19
187	002276	万马股份	13,300	161,063.00	0.19
188	603697	有友食品	17,500	160,475.00	0.19
189	300121	阳谷华泰	16,800	160,440.00	0.19
190	002820	桂发祥	14,100	159,894.00	0.19
191	603856	东宏股份	12,100	159,599.00	0.19
192	688556	高测股份	3,000	159,420.00	0.19
193	600481	双良节能	11,400	159,372.00	0.19
194	300832	新产业	2,700	159,300.00	0.19
195	002603	以岭药业	6,200	159,278.00	0.19
196	600011	华能国际	17,200	159,272.00	0.19
197	002728	特一药业	10,440	159,210.00	0.19
198	300109	新开源	6,400	159,168.00	0.19
199	000921	海信家电	5,900	159,005.00	0.19
200	002171	楚江新材	22,300	158,776.00	0.19
201	002131	利欧股份	69,000	158,700.00	0.19
202	002478	常宝股份	21,300	158,685.00	0.19
203	600866	星湖科技	28,800	158,400.00	0.19
204	002233	塔牌集团	20,500	158,260.00	0.19
205	603589	口子窖	3,200	157,920.00	0.19
206	605567	春雪食品	12,300	157,809.00	0.19
207	301087	可孚医疗	3,200	157,760.00	0.19
208	600785	新华百货	11,600	157,644.00	0.19
209	300246	宝莱特	12,650	157,492.50	0.19
210	601618	中国中冶	39,600	157,212.00	0.19
211	688121	卓然股份	4,200	157,080.00	0.19
212	603508	思维列控	9,200	156,860.00	0.19
213	600229	城市传媒	18,400	156,768.00	0.19
214	600642	申能股份	22,400	156,576.00	0.19
215	605287	德才股份	6,600	156,420.00	0.19

216	002745	木林森	17,000	156,400.00	0.19
217	000906	浙商中拓	17,500	156,100.00	0.19
218	603215	比依股份	8,700	156,078.00	0.19
219	002381	双箭股份	20,200	155,944.00	0.19
220	601601	中国太保	6,000	155,880.00	0.19
221	300674	宇信科技	8,800	155,584.00	0.19
222	301103	何氏眼科	3,700	155,252.00	0.18
223	603758	秦安股份	14,500	154,280.00	0.18
224	603773	沃格光电	4,800	151,488.00	0.18
225	000568	泸州老窖	700	146,699.00	0.17
226	600138	中青旅	11,200	140,112.00	0.17
227	688234	天岳先进	1,800	133,092.00	0.16
228	688533	上声电子	2,800	130,844.00	0.16
229	300687	赛意信息	4,700	130,566.00	0.16
230	300973	立高食品	1,900	129,998.00	0.15
231	688021	奥福环保	5,000	129,600.00	0.15
232	002335	科华数据	3,600	129,420.00	0.15
233	688007	光峰科技	6,200	129,270.00	0.15
234	301188	力诺特玻	7,500	128,100.00	0.15
235	300622	博士眼镜	5,400	127,440.00	0.15
236	002568	百润股份	3,500	127,225.00	0.15
237	300510	金冠股份	18,200	127,036.00	0.15
238	688389	普门科技	5,400	126,846.00	0.15
239	002707	众信旅游	16,800	126,504.00	0.15
240	601021	春秋航空	2,200	126,434.00	0.15
241	300212	易华录	3,800	126,274.00	0.15
242	300115	长盈精密	10,600	126,246.00	0.15
243	688033	天宜上佳	6,600	126,192.00	0.15
244	002929	润建股份	2,900	125,889.00	0.15
245	600150	中国船舶	3,800	125,058.00	0.15
246	600827	百联股份	9,300	124,341.00	0.15



247	601298	青岛港	17,800	124,066.00	0.15
248	300724	捷佳伟创	1,100	123,585.00	0.15
249	600004	白云机场	8,600	123,324.00	0.15
250	002747	埃斯顿	4,400	123,200.00	0.15
251	603985	恒润股份	5,600	117,432.00	0.14
252	300871	回盛生物	5,900	97,232.00	0.12
253	300274	阳光电源	800	93,304.00	0.11
254	300308	中际旭创	500	73,725.00	0.09
255	600845	宝信软件	1,380	70,117.80	0.08
256	688357	建龙微纳	1,076	69,606.44	0.08
257	601098	中南传媒	5,100	59,160.00	0.07
258	600863	内蒙华电	7,200	29,880.00	0.04
259	688301	奕瑞科技	80	22,594.40	0.03
260	688536	思瑞浦	73	15,914.00	0.02
261	603605	珀莱雅	40	4,496.00	0.01
262	603195	公牛集团	40	3,842.40	0.00
263	688338	赛科希德	68	3,770.60	0.00
264	300751	迈为股份	20	3,387.60	0.00
265	688670	金迪克	60	2,824.80	0.00
266	688118	普元信息	71	2,451.63	0.00
267	300996	普联软件	40	1,228.00	0.00
268	301193	家联科技	40	701.20	0.00
269	002943	宇晶股份	20	638.00	0.00
270	688560	明冠新材	18	500.22	0.00
271	300765	新诺威	20	257.80	0.00
272	688109	品茗科技	1	25.90	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	300750	宁德时代	1,003,579.00	8.05
2	688111	金山办公	889,692.54	7.14
3	002475	立讯精密	809,935.00	6.50
4	688777	中控技术	695,203.67	5.58
5	688037	芯源微	662,449.00	5.31
6	601012	隆基绿能	641,802.00	5.15
7	000001	平安银行	625,406.00	5.02
8	300454	深信服	600,641.00	4.82
9	600570	恒生电子	598,168.00	4.80
10	600512	腾达建设	594,633.00	4.77
11	300274	阳光电源	593,881.00	4.76
12	000063	中兴通讯	580,883.00	4.66
13	002271	东方雨虹	579,849.00	4.65
14	000858	五粮液	563,920.00	4.52
15	688599	天合光能	554,753.58	4.45
16	600309	万华化学	545,435.00	4.37
17	688188	柏楚电子	544,209.97	4.37
18	688223	晶科能源	528,917.26	4.24
19	300856	科思股份	525,734.00	4.22
20	600519	贵州茅台	518,525.00	4.16
21	603290	斯达半导	516,740.00	4.14
22	600039	四川路桥	516,359.00	4.14
23	000725	京东方A	511,407.00	4.10
24	002371	北方华创	508,611.00	4.08
25	688012	中微公司	506,091.36	4.06
26	688311	盟升电子	504,741.70	4.05
27	000568	泸州老窖	500,705.00	4.02
28	002223	鱼跃医疗	499,568.00	4.01
29	002459	晶澳科技	494,745.20	3.97
30	605499	东鹏饮料	487,026.00	3.91

31	600941	中国移动	483,666.00	3.88
32	002311	海大集团	478,601.00	3.84
33	688556	高测股份	476,010.26	3.82
34	000589	贵州轮胎	475,447.00	3.81
35	300627	华测导航	474,176.00	3.80
36	600489	中金黄金	473,702.00	3.80
37	002179	中航光电	472,910.00	3.79
38	603688	石英股份	472,380.00	3.79
39	002594	比亚迪	466,996.00	3.75
40	600958	东方证券	463,572.00	3.72
41	600109	国金证券	461,035.00	3.70
42	300896	爱美客	457,920.00	3.67
43	002772	众兴菌业	457,596.00	3.67
44	600989	宝丰能源	452,828.00	3.63
45	600803	新奥股份	448,761.00	3.60
46	600547	山东黄金	448,582.00	3.60
47	002782	可立克	445,577.00	3.57
48	601888	中国中免	443,382.00	3.56
49	603605	珀莱雅	442,742.00	3.55
50	688002	睿创微纳	442,207.84	3.55
51	300316	晶盛机电	440,714.00	3.53
52	002236	大华股份	439,847.00	3.53
53	600531	豫光金铅	430,190.00	3.45
54	603027	千禾味业	425,616.00	3.41
55	688072	拓荆科技	418,110.00	3.35
56	603808	歌力思	418,013.00	3.35
57	000921	海信家电	410,654.00	3.29
58	603456	九洲药业	408,810.00	3.28
59	300128	锦富技术	408,273.00	3.27
60	300724	捷佳伟创	407,606.00	3.27
61	600754	锦江酒店	405,659.00	3.25

62	688390	固德威	403,368.30	3.24
63	603613	国联股份	401,200.00	3.22
64	300760	迈瑞医疗	401,037.00	3.22
65	600483	福能股份	398,745.00	3.20
66	002056	横店东磁	393,359.00	3.16
67	603871	嘉友国际	392,250.00	3.15
68	600887	伊利股份	391,495.00	3.14
69	601668	中国建筑	391,248.00	3.14
70	600150	中国船舶	385,085.00	3.09
71	605060	联德股份	382,743.00	3.07
72	600845	宝信软件	382,594.02	3.07
73	002688	金河生物	379,510.00	3.04
74	300450	先导智能	377,646.00	3.03
75	603377	东方时尚	376,975.00	3.02
76	600031	三一重工	375,826.00	3.01
77	000425	徐工机械	373,905.00	3.00
78	601288	农业银行	370,526.00	2.97
79	600497	驰宏锌锗	369,257.00	2.96
80	002466	天齐锂业	366,005.00	2.94
81	600702	舍得酒业	365,684.00	2.93
82	603345	安井食品	364,610.00	2.92
83	603878	武进不锈	364,130.00	2.92
84	600562	国睿科技	363,178.00	2.91
85	688123	聚辰股份	362,311.59	2.91
86	605117	德业股份	361,778.00	2.90
87	601985	中国核电	360,395.00	2.89
88	300777	中简科技	359,664.00	2.88
89	300532	今天国际	358,632.00	2.88
90	002415	海康威视	357,975.00	2.87
91	603328	依顿电子	356,747.00	2.86
92	002461	珠江啤酒	356,447.00	2.86

93	002746	仙坛股份	355,759.00	2.85
94	600169	太原重工	355,486.00	2.85
95	000333	美的集团	354,106.00	2.84
96	600864	哈投股份	353,314.00	2.83
97	002215	诺普信	352,893.00	2.83
98	002422	科伦药业	352,558.00	2.83
99	002484	江海股份	351,762.00	2.82
100	002434	万里扬	350,443.00	2.81
101	600061	国投资本	350,076.00	2.81
102	601003	柳钢股份	349,242.00	2.80
103	603033	三维股份	349,186.00	2.80
104	601318	中国平安	342,548.00	2.75
105	603758	秦安股份	340,813.00	2.73
106	002429	兆驰股份	337,369.00	2.71
107	002880	卫光生物	336,913.00	2.70
108	300144	宋城演艺	336,078.00	2.70
109	601601	中国太保	334,420.00	2.68
110	688248	南网科技	333,788.10	2.68
111	300382	斯莱克	332,736.00	2.67
112	603859	能科科技	331,818.00	2.66
113	600363	联创光电	330,997.00	2.65
114	002831	裕同科技	330,443.00	2.65
115	600498	烽火通信	329,788.00	2.65
116	688063	派能科技	325,561.00	2.61
117	002959	小熊电器	325,377.00	2.61
118	003816	中国广核	322,679.00	2.59
119	601988	中国银行	320,089.00	2.57
120	600522	中天科技	319,760.00	2.56
121	300003	乐普医疗	319,235.00	2.56
122	688187	时代电气	317,394.42	2.55
123	002749	国光股份	316,684.00	2.54

124	000913	钱江摩托	314,786.00	2.52
125	600271	航天信息	314,728.00	2.52
126	000852	石化机械	314,466.00	2.52
127	300101	振芯科技	314,452.00	2.52
128	002239	奥特佳	314,389.00	2.52
129	600312	平高电气	314,088.00	2.52
130	600233	圆通速递	313,487.00	2.51
131	603129	春风动力	313,174.00	2.51
132	002121	科陆电子	313,028.00	2.51
133	300498	温氏股份	312,850.00	2.51
134	600665	天地源	312,208.00	2.50
135	002318	久立特材	311,240.00	2.50
136	002714	牧原股份	310,710.00	2.49
137	002304	洋河股份	310,619.00	2.49
138	300866	安克创新	309,923.00	2.49
139	600131	国网信通	309,757.00	2.48
140	605177	东亚药业	309,668.00	2.48
141	300791	仙乐健康	306,361.00	2.46
142	000538	云南白药	305,551.00	2.45
143	601958	金钼股份	304,407.00	2.44
144	603508	思维列控	303,151.00	2.43
145	601177	杭齿前进	299,787.00	2.40
146	600970	中材国际	299,420.00	2.40
147	300759	康龙化成	298,987.00	2.40
148	601298	青岛港	297,357.00	2.39
149	603195	公牛集团	297,143.00	2.38
150	002139	拓邦股份	296,453.00	2.38
151	600835	上海机电	296,396.00	2.38
152	600197	伊力特	296,053.00	2.37
153	301117	佳缘科技	294,452.00	2.36
154	002027	分众传媒	293,718.00	2.36

155	300413	芒果超媒	292,333.00	2.34
156	600028	中国石化	292,128.00	2.34
157	301039	中集车辆	291,472.00	2.34
158	002572	索菲亚	291,380.00	2.34
159	002649	博彦科技	289,375.00	2.32
160	601878	浙商证券	288,920.00	2.32
161	600828	茂业商业	288,674.00	2.32
162	002283	天润工业	287,783.00	2.31
163	600879	航天电子	286,529.00	2.30
164	688029	南微医学	284,889.42	2.29
165	000997	新大陆	284,148.00	2.28
166	605218	伟时电子	282,851.00	2.27
167	000751	锌业股份	282,627.00	2.27
168	603556	海兴电力	282,166.00	2.26
169	603444	吉比特	281,504.00	2.26
170	601600	中国铝业	280,044.00	2.25
171	003000	劲仔食品	279,010.00	2.24
172	688518	联赢激光	277,122.27	2.22
173	002252	上海莱士	276,924.00	2.22
174	600960	渤海汽车	276,868.00	2.22
175	600897	厦门空港	276,631.00	2.22
176	002448	中原内配	276,232.00	2.22
177	300145	中金环境	275,488.00	2.21
178	001696	宗申动力	275,487.00	2.21
179	600390	五矿资本	275,434.00	2.21
180	001979	招商蛇口	275,272.00	2.21
181	603209	兴通股份	273,980.00	2.20
182	300420	五洋停车	273,705.00	2.20
183	300142	沃森生物	272,736.00	2.19
184	600533	栖霞建设	271,670.00	2.18
185	002244	滨江集团	271,667.00	2.18

186	600129	太极集团	271,642.00	2.18
187	002262	恩华药业	271,447.00	2.18
188	000061	农产品	270,808.00	2.17
189	601702	华峰铝业	270,058.23	2.17
190	600959	江苏有线	268,973.00	2.16
191	300763	锦浪科技	268,778.00	2.16
192	600517	国网英大	267,685.00	2.15
193	002557	洽洽食品	267,617.00	2.15
194	603197	保隆科技	267,477.00	2.15
195	002990	盛视科技	266,017.00	2.13
196	000338	潍柴动力	264,506.00	2.12
197	300207	欣旺达	264,113.00	2.12
198	300121	阳谷华泰	263,896.00	2.12
199	300833	浩洋股份	263,770.00	2.12
200	300839	博汇股份	263,443.00	2.11
201	600038	中直股份	263,410.00	2.11
202	603551	奥普家居	262,920.00	2.11
203	600537	亿晶光电	262,427.00	2.10
204	600743	华远地产	262,391.00	2.10
205	688618	三旺通信	262,242.48	2.10
206	300098	高新兴	261,798.00	2.10
207	000100	TCL科技	261,594.00	2.10
208	300806	斯迪克	261,500.00	2.10
209	300802	矩子科技	261,095.00	2.09
210	300884	狄耐克	260,567.00	2.09
211	002515	金字火腿	259,929.00	2.08
212	002270	华明装备	259,754.00	2.08
213	600708	光明地产	259,423.00	2.08
214	600101	明星电力	259,349.00	2.08
215	601929	吉视传媒	258,973.00	2.08
216	688678	福立旺	258,877.92	2.08



217	002335	科华数据	258,456.00	2.07
218	002367	康力电梯	258,370.00	2.07
219	002078	太阳纸业	258,268.00	2.07
220	000776	广发证券	258,180.00	2.07
221	688711	宏微科技	257,245.40	2.06
222	002299	圣农发展	257,179.00	2.06
223	603773	沃格光电	256,749.10	2.06
224	002334	英威腾	256,210.00	2.06
225	000869	张裕A	255,522.00	2.05
226	600635	大众公用	254,685.00	2.04
227	600185	格力地产	254,347.00	2.04
228	300045	华力创通	253,309.00	2.03
229	002976	瑞玛精密	253,273.00	2.03
230	600869	远东股份	253,177.00	2.03
231	600756	浪潮软件	253,014.00	2.03
232	600033	福建高速	252,749.00	2.03
233	002603	以岭药业	252,633.00	2.03
234	300396	迪瑞医疗	252,460.00	2.02
235	688600	皖仪科技	251,759.83	2.02
236	002149	西部材料	251,614.00	2.02
237	601838	成都银行	251,569.00	2.02
238	600458	时代新材	251,094.00	2.01
239	300185	通裕重工	250,552.00	2.01
240	300945	曼卡龙	250,424.00	2.01
241	603979	金诚信	250,249.00	2.01
242	002046	国机精工	250,132.00	2.01
243	000885	城发环境	250,059.00	2.01
244	002352	顺丰控股	250,027.00	2.01
245	002841	视源股份	249,941.00	2.00
246	603017	中衡设计	249,603.00	2.00
247	600006	东风汽车	249,359.00	2.00

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	300750	宁德时代	678,811.00	5.44
2	688111	金山办公	678,451.03	5.44
3	600039	四川路桥	602,951.00	4.84
4	603605	珀莱雅	494,786.00	3.97
5	300274	阳光电源	478,001.00	3.83
6	603688	石英股份	474,352.00	3.80
7	002459	晶澳科技	469,488.60	3.77
8	002594	比亚迪	459,439.90	3.69
9	605499	东鹏饮料	458,909.00	3.68
10	600803	新奥股份	429,946.00	3.45
11	601668	中国建筑	417,139.00	3.35
12	000858	五粮液	400,359.00	3.21
13	300760	迈瑞医疗	397,441.00	3.19
14	688777	中控技术	388,564.97	3.12
15	600483	福能股份	385,542.00	3.09
16	000063	中兴通讯	384,822.00	3.09
17	603345	安井食品	382,912.00	3.07
18	600845	宝信软件	374,127.00	3.00
19	002056	横店东磁	373,801.00	3.00
20	600129	太极集团	371,298.00	2.98
21	002959	小熊电器	366,907.00	2.94
22	601958	金钼股份	364,946.00	2.93
23	002475	立讯精密	360,837.00	2.89
24	688390	固德威	357,696.96	2.87
25	603613	国联股份	353,113.64	2.83
26	300777	中简科技	351,020.00	2.82
27	000568	泸州老窖	350,795.00	2.81

28	000538	云南白药	350,780.00	2.81
29	605117	德业股份	348,857.60	2.80
30	600754	锦江酒店	348,738.00	2.80
31	002415	海康威视	346,707.00	2.78
32	300866	安克创新	344,227.00	2.76
33	688123	聚辰股份	340,080.22	2.73
34	002466	天齐锂业	339,422.00	2.72
35	000001	平安银行	338,289.00	2.71
36	600702	舍得酒业	337,057.00	2.70
37	002714	牧原股份	336,454.00	2.70
38	600131	国网信通	329,514.00	2.64
39	003816	中国广核	326,654.00	2.62
40	600828	茂业商业	325,938.00	2.61
41	002484	江海股份	324,323.00	2.60
42	002304	洋河股份	321,569.00	2.58
43	300003	乐普医疗	315,339.00	2.53
44	002831	裕同科技	313,632.00	2.52
45	688187	时代电气	312,205.77	2.50
46	605177	东亚药业	311,294.00	2.50
47	600522	中天科技	309,455.00	2.48
48	688556	高测股份	309,390.02	2.48
49	300144	宋城演艺	308,941.00	2.48
50	300101	振芯科技	307,974.00	2.47
51	300791	仙乐健康	307,332.00	2.47
52	600233	圆通速递	304,865.00	2.45
53	300498	温氏股份	304,418.00	2.44
54	601177	杭齿前进	303,611.00	2.44
55	688063	派能科技	302,649.48	2.43
56	002283	天润工业	301,132.00	2.42
57	002318	久立特材	297,877.00	2.39
58	688037	芯源微	296,577.00	2.38

59	001979	招商蛇口	292,947.00	2.35
60	605218	伟时电子	292,705.00	2.35
61	600570	恒生电子	291,222.00	2.34
62	605088	冠盛股份	288,365.00	2.31
63	600028	中国石化	288,117.00	2.31
64	600665	天地源	286,896.00	2.30
65	300454	深信服	286,078.00	2.29
66	688678	福立旺	285,221.24	2.29
67	000725	京东方A	283,232.00	2.27
68	600150	中国船舶	282,178.00	2.26
69	603444	吉比特	279,506.00	2.24
70	603259	药明康德	279,501.00	2.24
71	600537	亿晶光电	277,469.00	2.23
72	002572	索菲亚	274,791.00	2.20
73	603195	公牛集团	274,421.00	2.20
74	002139	拓邦股份	274,186.00	2.20
75	600732	爱旭股份	270,568.00	2.17
76	002244	滨江集团	268,035.00	2.15
77	000776	广发证券	266,749.00	2.14
78	000921	海信家电	263,918.00	2.12
79	002557	洽洽食品	262,375.00	2.10
80	300724	捷佳伟创	261,323.00	2.10
81	600038	中直股份	259,641.00	2.08
82	688188	柏楚电子	259,368.69	2.08
83	000002	万科A	259,169.00	2.08
84	601838	成都银行	257,898.00	2.07
85	600761	安徽合力	255,517.00	2.05
86	000100	TCL科技	255,033.00	2.05
87	601601	中国太保	253,372.00	2.03
88	603786	科博达	253,208.00	2.03
89	002078	太阳纸业	250,011.00	2.01

90	600958	东方证券	249,716.00	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	176,164,018.85
卖出股票收入（成交）总额	125,683,525.36

**7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合**

无余额。

**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**

无余额。

**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	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,256,886.48
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,256,886.48

### 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)	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 睿信	999	18,044.00	49,516.95	0.2747%	17,976,439.08	99.7253%

A						
中信建投睿信C	1,384	70,664.97	31,408,675.72	32.1151%	66,391,640.94	67.8849%
合计	2,307	50,206.45	31,458,192.67	27.1598%	84,368,080.02	72.8402%

### 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	中信建投睿信A	2,885.60	0.0160%
	中信建投睿信C	2,785.91	0.0028%
	合计	5,671.51	0.0049%

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

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

	中信建投睿信A	中信建投睿信C
基金合同生效日(2015年02月03日)基金份额总额	739,433,057.45	15,052,145.92
本报告期期初基金份额总额	13,973,067.26	3,405,771.25

本报告期基金总申购份额	9,115,220.53	116,923,529.03
减：本报告期基金总赎回份额	5,062,331.76	22,528,983.62
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	18,025,956.03	97,800,316.66

## §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事项。

### 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

本报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。



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	
东北证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
华创证券（券商柜台）	2	108,511,593.34	35.95%	71,816.66	41.36%	-
中信建投证券	6	193,335,950.87	64.05%	101,808.57	58.64%	-

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
东北证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券(券商柜台)	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	9,500,000.00	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	中信建投睿信灵活配置混合型证券投资基金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
5	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
6	中信建投睿信灵活配置混合型证券投资基金2022年年度报告	规定网站	2023-03-31
7	中信建投基金管理有限公司	规定网站、规定报刊	2023-04-01

	高级管理人员变更公告		
8	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
9	中信建投睿信灵活配置混合型证券投资基金2023年第1季度报告	规定网站	2023-04-21
10	中信建投睿信灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）	规定网站	2023-05-19
11	中信建投睿信灵活配置混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	规定网站	2023-05-19

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20230627-20230630	-	27,905,678.81	-	27,905,678.81	24.0927%

#### 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、《中信建投睿信灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《中信建投睿信灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照。

## 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