

中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金

2024 年年度报告

2024 年 12 月 31 日

基金管理人:中信建投基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

报告送出日期:2025 年 03 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2025年03月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

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

本报告期自2024年01月01日起至2024年12月31日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§ 2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	4
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
§ 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	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§ 5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	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 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	15
§ 7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	18
7.3 净资产变动表	19
7.4 报表附注	20
§ 8 投资组合报告	44
8.1 期末基金资产组合情况	44
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	45
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	61
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	67
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	67
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	67

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	67
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	67
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	67
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	68
8.12 投资组合报告附注	68
§ 9 基金份额持有人信息	69
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	69
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	69
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	69
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况	69
§ 10 开放式基金份额变动	70
§ 11 重大事件揭示	70
11.1 基金份额持有人大会决议	70
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	70
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	70
11.4 基金投资策略的改变	70
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	70
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	71
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	71
11.8 其他重大事件	72
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	75
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	75
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	75
§ 13 备查文件目录	75
13.1 备查文件目录	76
13.2 存放地点	76
13.3 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	25,430,455.78 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中信建投睿利 A	中信建投睿利 C
下属分级基金的交易代码	003308	004635
报告期末下属分级基金的份额总额	16,578,645.40 份	8,851,810.38 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于股票等权益类金融工具和债券等固定收益类金融工具，在有效控制风险的前提下，通过积极灵活的资产配置和组合精选，充分把握市场机会，力求实现基金资产的持续稳健增值。
投资策略	本基金采用自上而下的策略，通过对宏观经济基本面（包括经济运行周期、财政及货币政策、产业政策等）的分析判断，和对流动性水平（包括资金面供需情况、证券市场估值水平等）的深入研究，分析股票市场、债券市场、货币市场三大类资产的预期风险和收益，并据此对本基金资产在股票、债券、现金之间的投资比例进行动态调整。
业绩比较基准	中证 500 指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40%
风险收益特征	本基金属于混合型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金，属于证券投资基金中中高预期风险、中高预期收益的品种。

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

名称	中信建投基金管理有限公司		中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	朱伟	郭明
	联系电话	010-59100208	010-66105799
	电子邮箱	zhuweibj@csc.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4009-108-108	95588
传真		010-59100298	010-66105798
注册地址		北京市怀柔区桥梓镇八龙桥雅苑 3 号楼 1 室	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址		北京市东城区朝阳门内大街 188 号鸿安国际大厦 6、8 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码		100010	100140
法定代表人		黄凌	廖林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.cfund108.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
注册登记机构	中信建投基金管理有限公司	北京市东城区朝阳门内大街 188 号鸿安国际大厦 6、8 层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2024 年		2023 年		2022 年	
	中信建投睿利 A	中信建投睿利 C	中信建投睿利 A	中信建投睿利 C	中信建投睿利 A	中信建投睿利 C
本期已实现收益	3,127,066.49	2,157,574.11	-411,503.47	-160,317.27	-482,158.06	-218,759.72

本期利润	1,762,962.48	3,066,846.20	-140,250.66	240,403.55	-1,651,492.65	-750,304.41
加权平均基金份额本期利润	0.1095	0.1601	-0.0164	0.0109	-0.2565	-0.2607
本期加权平均净值利润率	11.40%	17.60%	-1.57%	1.08%	-23.82%	-24.83%
本期基金份额净值增长率	7.94%	7.51%	-0.75%	-1.15%	-20.58%	-20.89%
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末		2023 年末		2022 年末	
期末可供分配利润	1,556,246.38	501,504.05	109,405.33	-333,376.86	153,819.82	-19,316.02
期末可供分配基金份额利润	0.0939	0.0567	0.0134	-0.0171	0.0211	-0.0057
期末基金资产净值	18,134,891.78	9,353,314.43	8,277,066.44	19,177,880.65	7,435,981.47	3,349,423.79
期末基金份额净值	1.0939	1.0567	1.0134	0.9829	1.0211	0.9943
3.1.	2024 年末		2023 年末		2022 年末	

3 累 计期 末指 标						
基金 份额 累计 净值 增长 率	29.16%	24.93%	19.66%	16.20%	20.57%	17.55%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

3、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中信建投睿利 A 净值表现

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	5.83%	2.07%	1.01%	1.21%	4.82%	0.86%
过去六个月	21.58%	1.97%	10.98%	1.19%	10.60%	0.78%
过去一年	7.94%	1.81%	11.50%	0.94%	-3.56%	0.87%
过去三年	-14.92%	1.43%	-8.85%	0.76%	-6.07%	0.67%
过去五年	11.89%	1.25%	3.89%	0.77%	8.00%	0.48%
自基金合同生效起至今	29.16%	1.11%	17.24%	0.73%	11.92%	0.38%

中信建投睿利 C 净值表现

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	5.72%	2.07%	1.01%	1.21%	4.71%	0.86%
过去六个月	21.35%	1.97%	10.98%	1.19%	10.37%	0.78%
过去一年	7.51%	1.81%	11.50%	0.94%	-3.99%	0.87%
过去三年	-15.93%	1.43%	-8.85%	0.76%	-7.08%	0.67%
过去五年	9.70%	1.25%	3.89%	0.77%	5.81%	0.48%
自基金合同生效起至今	24.93%	1.15%	18.38%	0.75%	6.55%	0.40%

效起至今						
------	--	--	--	--	--	--

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

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



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 2024 年 12 月 31 日；

- 2、以上第 2 张图为中信建投睿利 C 基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图，绘图日期为 2017 年 5 月 26 日（首笔份额登记日）至 2024 年 12 月 31 日；
- 3、根据基金管理人于 2024 年 6 月 7 日披露的《关于中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金变更业绩比较基准并修订基金合同和托管协议的公告》《中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》，自 2024 年 6 月 7 日起，本基金的业绩比较基准由“60%×沪深 300 指数收益率+40%×中债综合指数收益率”变更为“中证 500 指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40%”。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：根据基金管理人于 2024 年 6 月 7 日披露的《关于中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金变更业绩比较基准并修订基金合同和托管协议的公告》《中信建投睿利灵活配置混合型发起式证

券投资基金基金合同》，自 2024 年 6 月 7 日起，本基金的业绩比较基准由“60%×沪深 300 指数收益率+40%×中债综合指数收益率”变更为“中证 500 指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40%”。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中信建投基金管理有限公司（以下简称“中信建投基金”）于 2013 年 9 月 9 日在北京成立，注册资本 4.5 亿元，中信建投证券股份有限公司全资控股。中信建投基金主要经营公开募集证券投资基金募集、销售、管理，特定客户资产管理以及中国证监会许可的其他业务。

截至报告期末，中信建投基金在管公募证券投资基金共 59 个。

中信建投基金以公募基金为业务本源，以专户业务为服务抓手，加强投研体系建设，注重核心投资人才的积累、培养，不断提升主动投资管理能力。同时，中信建投基金加强客户体系建设，积极拓展渠道，加大与国有大行、股份制银行、证券公司以及保险机构的合作力度。中信建投基金各项业务有序开展，为进一步发展奠定了良好的基础。

中信建投基金作为基金管理公司，秉承“忠于信，健于投”，追求以稳健的投资，回馈于客户的信任；致力于经过长期努力，打造具有影响力的品牌。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经 理（助理）期限		证 券 从 业 年 限	说明
		任职日期	离任 日期		
杨志武	本基金的基金经理、多元资产配置部行政负责人	2023-03-17	-	12 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，现任本公司多元资产配置部行政负责人、基金经理，担任中信建投稳利混合型证券投资基金、中信建投睿信灵活配置混合型证券投资基金、中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金、中信建投双鑫债券型证券投资基金、中信建投致远混合型证券投资基金基金经理。
艾翀	本基金的基金经理	2024-02-06	-	8 年	中国籍，1981 年 8 月生，美国宾夕法尼亚州立大学数学博士。曾任北京首创期货金融创新部量化策略和期权分析师，北京派朗科技金融工程部金融工程师，国金基金指数投资部、量化投资三部基金经理助理、基金经理，北京创金启富基金投资研究部量化投资主管，恒安标准人寿投资部高级投资经理。2023 年 9 月加入中信建投基金管理有限公司，现任本公司多元资产配置部基金经理，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合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、基金合同和其他有关法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行。公司通过对不同时间窗口下的不同组合间股票和债券的同向交易进行价差分析，交易时机、交易价差和交易数量均可合理解释，未发现不同投资组合之间存在非公平交易的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

在 2024 年，中国和世界各国的外交活动更加频繁，更多的彰显大国影响力。欧洲和世界多个国家也完成了政府换届。俄乌战争、巴以冲突延续，不过在 2025 年可能缓解和停歇，将对世界经济和全球多类资产价格产生影响。美国经济全年表现比较强劲，GDP 增长 2.8%，消费支出做出了主要贡献；通胀显著下降更加接近 2% 的目标；失业率虽然有波动，年末也控制到了 4% 以下。美联储 9 月开始降息，全年累计降息 100bp。纳斯达克指数上涨 28.64%，年末创出历史新高。特朗普在美国大选中获胜，开始全面影响世界政治格局。全年世界各国的摩擦增加，欧盟和美国都对中国在部分商品品类上提高了关税税率。

国内经济 1 季度稳步复苏，2 季度有所下滑，3 季度低位运行，4 季度在消费政策支持下企稳回升。尽管持续有外部环境的压力，出口增长相比于前一年更加强劲，其中高端制造是主要增量；全年消费增速有所下滑，美联储降息后，显著加强了在消费上的政策强度，提振了消费；投资增速变化不大，其中地产方面为主要政策支持方向，地产投资降幅显著收窄。企业整体盈利水平前 3 季度增速放缓，9 月以后开始回升。部分行业如消费电子，已经从周期底部反弹。消费是主要边际变量。

跟美联储降息、国内消费政策支持、企业盈利节奏比较一致，A 股在 1 季度经过大幅调整和反弹之后，5 月 20 日之前呈震荡上行走势，其后开始调整并于 6 月加速下行，一直到 9 月 24 日多部委联合新闻发布会，市场开始快速反弹后持续震荡上行。机器人和 AI 软硬件等板块概念的科技行情成为市场主要上升力量。跟股市表现不同，十年国债活跃券的利率水平全年持续下行，从年初的 2.57% 一路下降到了 1.61%，11 月下旬以后，更是加速下行，市场对政策预期非常积极。

报告期内依然坚持价值投资的理念，在复杂的经济环境与宏观事件冲击背景下，利用量化方法对各种风格与行业进行了均衡的配置，充分利用行业和个股的分散度，降低资产组合的波动，力争

在行业与风格均衡配置的基础上，追求组合长期相对稳健的回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中信建投睿利 A 基金份额净值为 1.0939 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 7.94%，同期业绩比较基准收益率为 11.50%；截至报告期末中信建投睿利 C 基金份额净值为 1.0567 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 7.51%，同期业绩比较基准收益率为 11.50%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2025 年，特朗普重新执政后，在经济和外交等政策上开始发生显著转变，马斯克主导的政府效率部给美国内部带来了不小的动荡。美联储在 12 月议息会议上对 2025 年的降息次数和确定性都有所下降，主要还是根据美国的经济数据来调整降息路径。2025 年 2 月底美国对中国提高关税，后续也可能会有其他政策冲击，但是冲击过后，可能能够更加乐观。美联储控制的国际市场的流动性以及影响的全球风险偏好，仍将对中国经济政策形成制约，国内政策能否真正提振内需，有待新的经济数据来逐步验证。2024 年末到 2025 年初，中国发布疑似 6 代战机，开源的 deepseek 用更低的成本达到了跟最新 GPT 模型类似的效果等等一系列重大事件，证明了中国在科技竞争中的力量，提振了市场信心。随着中国产业升级取得有目共睹的成就，全球产业链重构也对中国的冲击越来越小。包括机器人在内的各行各业的 AI+也成为了 2025 年投资的主旋律。制造业升级的“最困难的一个卡脖子领域”芯片制造领域也在逐步破冰。预期更多行业将 2025 年出现盈利拐点。

总体来看，2025 年对权益的风险偏好可能要优于 2024 年上半年，全年各个板块可能都会有表现机会。科技成长是主旋律；内需的复苏有待验证，可能是重要的边际变量；红利类资产会有持续的机构资金支持；其他板块盈利改善的公司也有机会。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据中国证监会相关规定和基金合同约定，本基金管理人严格按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任。

本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术；

建立了估值委员会，由公司分管运营领导任估值委员会主任，委员包括权益投资相关部门、固定收益部、多元资产配置部、研究部、特定资产管理部、稽控合规部、风险管理部、运营管理部的部门负责人。本基金管理人使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策和执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所交易的债券品种的估值数据。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期未发生连续二十个工作日基金份额持有人数量不满 200 人的情形。

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本基金的管理人中信建投基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，本基金托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本基金托管人依法对中信建投基金管理有限公司编制和披露的本基金 2024 年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、

准确和完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2025）审字第 70069507_A11 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金的财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
审计报告日期	2025-03-28

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	7.4.7.1	1,532,263.64	1,490,634.27
结算备付金		1,317,905.24	510,167.31
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	24,717,885.00	25,558,652.86
其中：股票投资		24,717,885.00	25,549,248.60
基金投资		-	-
债券投资		-	9,404.26
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		31,359.58	2,033.63
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		27,599,413.46	27,561,488.07
负 债 和 净 资 产			
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		62,938.03	36,655.05
应付管理人报酬		29,711.50	28,306.93
应付托管费		4,951.90	4,717.83

应付销售服务费		3,495.94	6,631.17
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	10,109.88	30,230.00
负债合计		111,207.25	106,540.98
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	25,430,455.78	27,678,918.62
未分配利润	7.4.7.8	2,057,750.43	-223,971.53
净资产合计		27,488,206.21	27,454,947.09
负债和净资产总计		27,599,413.46	27,561,488.07

注：报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额总额 25,430,455.78 份，其中中信建投睿利 A 类基金份额净值 1.0939 元，基金份额 16,578,645.40 份；中信建投睿利 C 类基金份额净值 1.0567 元，基金份额 8,851,810.38 份。

7.2 利润表

会计主体：中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
一、营业总收入		5,416,254.23	760,337.07
1. 利息收入		26,596.67	20,341.44
其中：存款利息收入	7.4.7.9	26,596.67	13,529.09
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		-	6,812.35
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		5,841,373.21	-187,528.69
其中：股票投资收益	7.4.7.10	4,909,195.56	-363,908.04
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	-479.47	4,866.70
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.12	477,250.26	-90,573.14
股利收益	7.4.7.13	455,406.86	262,085.79
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.14	-454,831.92	671,973.63

4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	3,116.27	255,550.69
减：二、营业总支出		586,445.55	660,184.18
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	400,880.09	429,697.59
2. 托管费	7.4.10.2.2	66,813.36	71,616.32
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	72,080.39	88,543.05
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.16	-	-
7. 税金及附加		1,540.69	38.23
8. 其他费用	7.4.7.17	45,131.02	70,288.99
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,829,808.68	100,152.89
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,829,808.68	100,152.89
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		4,829,808.68	100,152.89

7.3 净资产变动表

会计主体：中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金
本报告期：2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	27,678,918.62	-223,971.53	27,454,947.09
二、本期期初净资产	27,678,918.62	-223,971.53	27,454,947.09
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-2,248,462.84	2,281,721.96	33,259.12
（一）、综合收益总额	-	4,829,808.68	4,829,808.68
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-2,248,462.84	-2,548,086.72	-4,796,549.56
其中：1. 基金申购款	48,398,826.64	-5,480,484.49	42,918,342.15
2. 基金赎回款	-50,647,289.48	2,932,397.77	-47,714,891.71
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	25,430,455.78	2,057,750.43	27,488,206.21
项 目	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	10,650,901.46	134,503.80	10,785,405.26

二、本期期初净资产	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)	17,028,017.16	-358,475.33	16,669,541.83
(一)、综合收益总额	-	100,152.89	100,152.89
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	17,028,017.16	-458,628.22	16,569,388.94
其中：1.基金申购款	118,441,727.74	2,804,360.63	121,246,088.37
2.基金赎回款	-101,413,710.58	-3,262,988.85	-104,676,699.43
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	27,678,918.62	-223,971.53	27,454,947.09

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

黄凌	张欣宇	谭保民
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可〔2016〕第 1962 号《关于准予中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金注册的批复》的核准，由中信建投基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)验证出具普华永道中天验字(2016)第 1356 号验资报告。经向中国证监会备案，《中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》于 2016 年 12 月 7 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 47,686,882.68 份基金份额，其中认购资金利息折合 19,936.07 份基金份额。本基金的基金管理人为中信建投基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《关于中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金增加 C 类基金份额并调整基金合同和托管协议中相关条款的公告》，自 2017 年 5 月 10 日起，本基金增加 C 类基金份额类别，本基金的原有基金份额全部自动划归为本基金 A 类基金份额。增加基金份额类别后，本基金分设 A 类、C 类两类基金份额，两类基金份额单独设置基金代码，分别计算和公告两类基金份额净值和两类基金份额累计净值。本基金根据申购费、销售服务费等收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。其中：在投资者申购时收取申购费用而不从本类别基金资产中计提销售服务费，在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额，称为 A 类基金份额。从本类别基金资产中计提销售服务费而在投资者申购时不收取申购费用、在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额，称为 C 类基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基

金基金合同》的有关规定，本基金的投资对象是具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板、存托凭证及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、短期融资券等)、资产支持证券、债券回购、银行存款、权证、股指期货及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：股票资产占基金资产的 0-95%；权证投资占基金资产净值的比例不超过 3%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金以后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。

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

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号<年度报告的内容与格式>》、《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号<会计报表附注的编制及披露>》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

（1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

（2）金融负债分类

除由于金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债以外，本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发

生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

（1）存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 不存在活跃市场的金融工具，应采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，应优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或预期收益率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动扣除在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致本基金资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时予以确认。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- (2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- (3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

(1) 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税率，由原先的 3‰调整为 1‰，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(2) 增值税

根据财政部、国家税务总局财税〔2016〕36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税〔2016〕46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税〔2016〕70 号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税〔2016〕140 号《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税〔2017〕56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

根据财政部、国家税务总局财税〔2017〕90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策

的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

（3）企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税〔2004〕78 号《关于证券投资基金税收政策的通知》的规定，自 2004 年 1 月 1 日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税〔2008〕1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

（4）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税〔2008〕132 号《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税〔2012〕85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税〔2015〕101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	364,329.98	12,080.07
等于：本金	364,304.91	12,071.15
加：应计利息	25.07	8.92
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-

等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	1,167,933.66	1,478,554.20
等于：本金	1,167,846.28	1,478,389.88
加：应计利息	87.38	164.32
减：坏账准备	-	-
合计	1,532,263.64	1,490,634.27

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2024 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		25,327,337.44	-	24,717,885.00	-609,452.44
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		25,327,337.44	-	24,717,885.00	-609,452.44
项目		上年度末 2023 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		25,704,655.68	-	25,549,248.60	-155,407.08
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	8,600.00	17.70	9,404.26	786.56
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	8,600.00	17.70	9,404.26	786.56
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		25,713,255.68	17.70	25,558,652.86	-154,620.52

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

7.4.7.5 其他资产

无余额。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	0
应付赎回费	-	0
应付证券出借违约金	-	0
应付交易费用	-	0
其中：交易所市场	-	0
银行间市场	-	0
应付利息	-	0
预提费用	10,109.88	30,000.00
其他应付	-	230.00
合计	10,109.88	30,230.00

7.4.7.7 实收基金

中信建投睿利 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	8,167,661.11	8,167,661.11
本期申购	12,137,844.62	12,137,844.62
本期赎回（以“-”号填列）	-3,726,860.33	-3,726,860.33
本期末	16,578,645.40	16,578,645.40

中信建投睿利 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	19,511,257.51	19,511,257.51
本期申购	36,260,982.02	36,260,982.02

本期赎回（以“-”号填列）	-46,920,429.15	-46,920,429.15
本期末	8,851,810.38	8,851,810.38

7.4.7.8 未分配利润

中信建投睿利 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,049,330.20	-939,924.87	109,405.33
本期期初	1,049,330.20	-939,924.87	109,405.33
本期利润	3,127,066.49	-1,364,104.01	1,762,962.48
本期基金份额交易产生的变动数	870,537.86	-1,186,659.29	-316,121.43
其中：基金申购款	1,433,052.18	-1,795,788.15	-362,735.97
基金赎回款	-562,514.32	609,128.86	46,614.54
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,046,934.55	-3,490,688.17	1,556,246.38

中信建投睿利 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,917,351.45	-2,250,728.31	-333,376.86
本期期初	1,917,351.45	-2,250,728.31	-333,376.86
本期利润	2,157,574.11	909,272.09	3,066,846.20
本期基金份额交易产生的变动数	-1,734,179.65	-497,785.64	-2,231,965.29
其中：基金申购款	1,646,863.17	-6,764,611.69	-5,117,748.52
基金赎回款	-3,381,042.82	6,266,826.05	2,885,783.23
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,340,745.91	-1,839,241.86	501,504.05

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024	上年度可比期间 2023 年 01 月
----	---------------------------	---------------------

	年 12 月 31 日	01 日至 2023 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	1,802.58	5,947.32
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	9,550.42	4,507.03
结算备付金利息收入	15,080.95	2,941.67
其他	162.72	133.07
合计	26,596.67	13,529.09

7.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	620,264,623.11	441,890,393.57
减：卖出股票成本总额	614,364,157.08	441,372,633.71
减：交易费用	991,270.47	881,667.90
买卖股票差价收入	4,909,195.56	-363,908.04

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
债券投资收益——利息收入	17.28	18,854.46
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-496.75	-13,987.76
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	-479.47	4,866.70

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	8,112.90	4,417,360.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	8,600.00	4,333,987.76
减：应计利息总额	9.33	97,360.00
减：交易费用	0.32	-

买卖债券差价收入	-496.75	-13,987.76
----------	---------	------------

7.4.7.12 衍生工具收益

7.4.7.12.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.12.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
期货投资	477,250.26	-90,573.14

7.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	455,406.86	262,085.79
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	455,406.86	262,085.79

7.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-454,831.92	671,973.63
——股票投资	-454,045.36	663,416.56
——债券投资	-786.56	8,557.07
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——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	-454,831.92	671,973.63

7.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	3,116.27	255,550.69
合计	3,116.27	255,550.69

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额中归入基金资产的比例按持有期间递减且不低于 25%。

7.4.7.16 信用减值损失

无。

7.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
审计费用	10,109.88	30,000.00
信息披露费	11,202.02	0
证券出借违约金	-	0
汇划手续费	2,119.12	3,088.99
其他费用	700.00	900.00
账户维护费	21,000.00	36,300.00
合计	45,131.02	70,288.99

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无重大资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中信建投基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
中信建投利信资本管理（北京）有限公司	基金管理人的子公司
中信建投证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构
中信建投期货有限公司	与基金管理人同一控股股东、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中信建投证券股份有限公司	1,234,251,461.95	100.00%	703,121,118.15	78.08%

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
中信建投证券股份有限公司	8,112.90	100.00%	3,025,967.25	100.00%

7.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 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%

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中信建投证券股份有限公司	601,948.38	100.00%	0.00	0.00%
关联方名称	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日			

	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中信建投证券股份有限公司	370,365.90	77.94%	-	-

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代收的证管费和经手费的净额列示。

2、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。根据证监会公告（2024）3 号《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，针对被动股票型基金，不再通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用。针对其他类型基金，不再通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	400,880.09	429,697.59
其中：应支付销售机构的客户维护费	130,855.25	166,250.97
应支付基金管理人的净管理费	270,024.84	263,446.62

注：1、自 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 8 月 27 日，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。

2、根据《中信建投基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》，自 2023 年 8 月 28 日（含该日）起，支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.20%/当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	66,813.36	71,616.32

注：1、自 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 8 月 27 日，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。

2、根据《中信建投基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告》，自 2023 年 8 月 28 日（含该日）起，支付基金托管人中国工商银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中信建投睿利 A	中信建投睿利 C	合计
中信建投基金管理有限公司	-	18,036.49	18,036.49
中信建投证券股份有限公司	-	50,907.54	50,907.54
工商银行股份有限公司	-	53.97	53.97
合计	-	68,998.00	68,998.00
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中信建投睿利 A	中信建投睿利 C	合计
中信建投基金管理有限公司	-	12,464.72	12,464.72
中信建投证券股份有限公司	-	71,642.52	71,642.52
合计	-	84,107.24	84,107.24

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.40%年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付给中信建投基金管理有限公司，再由中信建投基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

C 类基金日销售服务费=前一日基金资产净值×0.40%/当年天数

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

中信建投睿利 A

份额单位：份

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2016 年 12 月 07 日）持有的基金份额	10,000,800.00	10,000,800.00
报告期初持有的基金份额	2,000,800.00	2,000,800.00
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-

减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
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	12.0685%	24.4966%

中信建投睿利 C

份额单位：份

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
基金合同生效日（2016 年 12 月 07 日）持有的基金份额	-	-
报告期初持有的基金份额	2,124,269.78	-
报告期间申购/买入总份额	-	2,124,269.78
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	2,124,269.78	2,124,269.78
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	23.9981%	10.8874%

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

中信建投睿利 C

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024 年 12 月 31 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
中信建投利信资本管理（北京）有限公司	892,618.05	10.0840%	892,618.05	4.5749%

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	364,329.98	1,802.58	12,080.07	5,947.32
中信建投证券股份有限公司	1,167,933.66	9,550.42	1,478,554.20	4,507.03

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

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金固定费用为其他费用项目中“审计费”和“信息披露费”等费用。自 2024 年 5 月 28 日起至 2024 年 12 月 31 日，本基金的固定费用由本基金管理人承担，共计人民币 46.688.10 元。

7.4.11 利润分配情况

无。

7.4.12 期末（2024 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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
688139	海尔生物	2024-12-23	重大事项	35.20	2025-01-07	30.60	400	13,814.00	14,080.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人的风险管理机构由董事会下属的公司风险控制与合规委员会、督察长、公司风险管理委员会、风险管理部以及各个业务部门组成。公司实行全面、系统的风险管理，风险管理覆盖

公司所有战略环节、业务环节和操作环节。同时制定了系统化的风险管理程序，对风险管理的整个流程进行评估和改进。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制与合规委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面，由风险管理部负责协调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。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人或其他拥有相关资质的银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易主要以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约可能性很小；在银行间同业市场等场外市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无余额。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无余额。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无余额。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	9,404.26

未评级	-	-
合计	-	9,404.26

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。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无余额。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无余额。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人于开放期内要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人于开放期内每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于本期末，除附注 7.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在一个月以内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（净资产）无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限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。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12（如有）。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接

受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,532,263.64	-	-	-	1,532,263.64
结算备付金	1,317,905.24	-	-	-	1,317,905.24
交易性金融资产	-	-	-	24,717,885.00	24,717,885.00
应收申购款	-	-	-	31,359.58	31,359.58
资产总计	2,850,168.88	-	-	24,749,244.58	27,599,413.46
负债					
应付赎回款	-	-	-	62,938.03	62,938.03
应付管理人报酬	-	-	-	29,711.50	29,711.50
应付托管费	-	-	-	4,951.90	4,951.90
应付销售服务费	-	-	-	3,495.94	3,495.94
其他负债	-	-	-	10,109.88	10,109.88
负债总计	-	-	-	111,207.25	111,207.25
利率敏感度缺口	2,850,168.88	-	-	24,638,037.33	27,488,206.21
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,490,634.27	-	-	-	1,490,634.27
结算备付金	510,167.31	-	-	-	510,167.31
交易性金融资	-	-	9,404.26	25,549,248.60	25,558,652.86

产					
应收申购款	-	-	-	2,033.63	2,033.63
资产总计	2,000,801.58	-	9,404.26	25,551,282.23	27,561,488.07
负债					
应付赎回款	-	-	-	36,655.05	36,655.05
应付管理人报酬	-	-	-	28,306.93	28,306.93
应付托管费	-	-	-	4,717.83	4,717.83
应付销售服务费	-	-	-	6,631.17	6,631.17
其他负债	-	-	-	30,230.00	30,230.00
负债总计	-	-	-	106,540.98	106,540.98
利率敏感度缺口	2,000,801.58	-	9,404.26	25,444,741.25	27,454,947.09

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外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。

本基金严格按照基金合同中对投资组合比例的要求进行资产配置，通过投资组合的分散化降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日		上年度末 2023 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	24,717,885.00	89.92	25,549,248.60	93.06
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	—	—	9,404.26	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	24,717,885.00	89.92	25,558,652.86	93.09

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	2,321,168.57	1,597,021.86
	业绩比较基准下降 5%	-2,321,168.57	-1,597,021.86

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

- 第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。
- 第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。
- 第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	24,703,805.00	25,506,974.00
第二层次	14,080.00	51,678.86
第三层次	—	—
合计	24,717,885.00	25,558,652.86

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券、基金等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、境内股票涨跌停牌等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。本基金以导致各层次

之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

7.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2025 年 3 月 28 日经本基金的基金管理人批准。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	24,717,885.00	89.56
	其中：股票	24,717,885.00	89.56
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,850,168.88	10.33
8	其他各项资产	31,359.58	0.11
9	合计	27,599,413.46	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	54,374.00	0.20
B	采矿业	620,448.00	2.26
C	制造业	16,039,732.00	58.35
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	530,750.00	1.93
E	建筑业	432,160.00	1.57
F	批发和零售业	610,191.00	2.22
G	交通运输、仓储和邮政业	927,286.00	3.37
H	住宿和餐饮业	14,670.00	0.05
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,094,463.00	7.62
J	金融业	1,095,081.00	3.98
K	房地产业	381,937.00	1.39
L	租赁和商务服务业	220,781.00	0.80
M	科学研究和技术服务业	514,764.00	1.87
N	水利、环境和公共设施管理业	532,228.00	1.94
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	35,160.00	0.13
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	613,860.00	2.23
S	综合	-	-
	合计	24,717,885.00	89.92

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无余额。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000623	吉林敖东	10,300	177,881.00	0.65
2	600496	精工钢构	58,200	175,764.00	0.64
3	603699	纽威股份	7,800	172,926.00	0.63
4	600320	振华重工	44,000	172,480.00	0.63
5	600271	航天信息	18,200	165,802.00	0.60
6	601811	新华文轩	9,800	155,330.00	0.57
7	000655	金岭矿业	23,900	146,985.00	0.53
8	300770	新媒股份	3,500	141,435.00	0.51
9	002745	木林森	16,200	141,264.00	0.51
10	002498	汉缆股份	41,600	141,024.00	0.51
11	603508	思维列控	5,900	140,302.00	0.51

12	002204	大连重工	27,800	138,444.00	0.50
13	601369	陕鼓动力	14,900	129,630.00	0.47
14	300358	楚天科技	18,700	128,282.00	0.47
15	002534	西子洁能	11,400	126,654.00	0.46
16	601211	国泰君安	6,700	124,955.00	0.45
17	002683	广东宏大	4,700	124,456.00	0.45
18	600229	城市传媒	17,700	123,369.00	0.45
19	301087	可孚医疗	3,400	120,224.00	0.44
20	002461	珠江啤酒	12,000	118,680.00	0.43
21	002020	京新药业	8,900	113,920.00	0.41
22	002966	苏州银行	13,400	108,674.00	0.40
23	600526	菲达环保	24,200	108,658.00	0.40
24	601009	南京银行	10,200	108,630.00	0.40
25	002546	新联电子	24,700	106,951.00	0.39
26	603158	腾龙股份	13,000	105,040.00	0.38
27	600572	康恩贝	22,500	104,850.00	0.38
28	600282	南钢股份	22,200	104,118.00	0.38
29	601226	华电科工	15,300	103,428.00	0.38
30	002139	拓邦股份	7,500	102,075.00	0.37
31	600352	浙江龙盛	9,900	101,871.00	0.37
32	000001	平安银行	8,700	101,790.00	0.37
33	600551	时代出版	11,600	99,876.00	0.36
34	002818	富森美	6,600	98,604.00	0.36
35	600812	华北制药	18,800	97,196.00	0.35
36	600563	法拉电子	800	95,136.00	0.35
37	601200	上海环境	11,600	94,772.00	0.34
38	605507	国邦医药	4,400	91,652.00	0.33
39	600351	亚宝药业	15,000	91,350.00	0.33
40	000920	沃顿科技	10,200	90,984.00	0.33
41	002412	汉森制药	14,900	89,549.00	0.33
42	000672	上峰水泥	11,700	89,505.00	0.33
43	605358	立昂微	3,600	89,172.00	0.32
44	603039	泛微网络	1,800	88,200.00	0.32
45	603013	亚普股份	5,800	86,884.00	0.32
46	603638	艾迪精密	5,100	86,139.00	0.31
47	600731	湖南海利	15,100	86,070.00	0.31
48	002367	康力电梯	12,500	85,875.00	0.31
49	603337	杰克股份	2,800	85,288.00	0.31
50	002032	苏泊尔	1,600	85,136.00	0.31
51	603886	元祖股份	5,900	85,078.00	0.31
52	003006	百亚股份	3,500	83,965.00	0.31
53	601728	中国电信	11,600	83,752.00	0.30
54	002698	博实股份	4,900	83,300.00	0.30

55	603568	伟明环保	3,800	82,194.00	0.30
56	600966	博汇纸业	15,900	82,044.00	0.30
57	600419	天润乳业	8,800	81,928.00	0.30
58	001872	招商港口	4,000	81,880.00	0.30
59	000910	大亚圣象	10,400	81,848.00	0.30
60	601665	齐鲁银行	14,600	81,614.00	0.30
61	002540	亚太科技	13,200	81,312.00	0.30
62	603871	嘉友国际	4,200	81,270.00	0.30
63	002768	国恩股份	3,500	80,745.00	0.29
64	688502	茂莱光学	400	80,560.00	0.29
65	600928	西安银行	22,100	79,781.00	0.29
66	000533	顺钠股份	13,000	78,780.00	0.29
67	600663	陆家嘴	8,000	78,720.00	0.29
68	688586	江航装备	8,200	78,474.00	0.29
69	002368	太极股份	3,300	78,144.00	0.28
70	002373	千方科技	7,700	78,078.00	0.28
71	002261	拓维信息	4,200	76,902.00	0.28
72	002666	德联集团	17,400	75,864.00	0.28
73	002275	桂林三金	5,000	75,450.00	0.27
74	600050	中国联通	14,200	75,402.00	0.27
75	688550	瑞联新材	2,400	75,096.00	0.27
76	601098	中南传媒	5,000	75,050.00	0.27
77	002390	信邦制药	16,200	73,710.00	0.27
78	600143	金发科技	8,500	73,440.00	0.27
79	601988	中国银行	13,300	73,283.00	0.27
80	600810	神马股份	9,000	72,810.00	0.26
81	601886	江河集团	13,400	72,360.00	0.26
82	000967	盈峰环境	14,500	72,065.00	0.26
83	603707	健友股份	5,400	71,658.00	0.26
84	000036	华联控股	17,500	71,400.00	0.26
85	600941	中国移动	600	70,896.00	0.26
86	600033	福建高速	18,200	70,616.00	0.26
87	002399	海普瑞	6,600	70,554.00	0.26
88	300776	帝尔激光	1,100	69,938.00	0.25
89	600339	中油工程	19,500	69,810.00	0.25
90	600266	城建发展	13,600	69,360.00	0.25
91	000582	北部湾港	8,800	69,344.00	0.25
92	000963	华东医药	2,000	69,200.00	0.25
93	002063	远光软件	12,000	69,120.00	0.25
94	600997	开滦股份	10,100	68,276.00	0.25
95	000951	中国重汽	4,000	67,920.00	0.25
96	600648	外高桥	5,700	67,887.00	0.25
97	601222	林洋能源	9,600	67,872.00	0.25

98	688658	悦康药业	4,700	67,727.00	0.25
99	000828	东莞控股	6,300	67,347.00	0.25
100	600073	光明肉业	9,700	67,318.00	0.24
101	000538	云南白药	1,100	65,945.00	0.24
102	688018	乐鑫科技	300	65,400.00	0.24
103	600741	华域汽车	3,700	65,157.00	0.24
104	000404	长虹华意	8,800	65,120.00	0.24
105	002249	大洋电机	11,000	64,570.00	0.23
106	688190	云路股份	700	64,400.00	0.23
107	001323	慕思股份	1,700	64,277.00	0.23
108	600330	天通股份	9,000	63,900.00	0.23
109	000726	鲁 泰 A	9,800	63,896.00	0.23
110	000700	模塑科技	9,100	63,882.00	0.23
111	603218	日月股份	5,300	63,865.00	0.23
112	688232	新点软件	2,200	63,778.00	0.23
113	002909	集泰股份	12,800	63,616.00	0.23
114	601919	中远海控	4,100	63,550.00	0.23
115	600428	中远海特	8,700	63,510.00	0.23
116	601827	三峰环境	7,400	63,492.00	0.23
117	002811	郑中设计	7,400	63,418.00	0.23
118	600475	华光环能	7,000	63,070.00	0.23
119	002478	常宝股份	11,900	62,951.00	0.23
120	601399	国机重装	20,400	62,832.00	0.23
121	688368	晶丰明源	700	62,300.00	0.23
122	000026	飞亚达	6,000	62,220.00	0.23
123	600420	国药现代	5,200	62,088.00	0.23
124	600664	哈药股份	15,000	61,950.00	0.23
125	000997	新 大 陆	3,100	61,845.00	0.22
126	600268	国电南自	9,200	61,824.00	0.22
127	300190	维尔利	17,500	61,425.00	0.22
128	000852	石化机械	8,900	61,410.00	0.22
129	002536	飞龙股份	5,300	61,374.00	0.22
130	300523	辰安科技	3,100	61,349.00	0.22
131	605286	同力日升	2,000	60,320.00	0.22
132	603618	杭电股份	11,100	60,273.00	0.22
133	688508	芯朋微	1,400	60,158.00	0.22
134	603601	再升科技	17,900	60,144.00	0.22
135	000881	中广核技	8,200	60,106.00	0.22
136	688005	容百科技	1,900	59,945.00	0.22
137	603577	汇金通	7,500	59,925.00	0.22
138	603320	迪贝电气	4,200	59,304.00	0.22
139	002202	金风科技	5,700	58,881.00	0.21
140	601311	骆驼股份	7,100	58,859.00	0.21

141	002448	中原内配	9,400	58,844.00	0.21
142	002921	联诚精密	5,200	56,888.00	0.21
143	002801	微光股份	2,300	56,258.00	0.20
144	600774	汉商集团	7,500	56,175.00	0.20
145	000877	天山股份	9,800	55,468.00	0.20
146	002396	星网锐捷	2,900	55,071.00	0.20
147	002035	华帝股份	7,500	55,050.00	0.20
148	600897	厦门空港	3,600	54,828.00	0.20
149	601898	中煤能源	4,500	54,810.00	0.20
150	000061	农产品	7,800	54,678.00	0.20
151	002558	巨人网络	4,300	54,567.00	0.20
152	600791	京能置业	13,300	54,530.00	0.20
153	601998	中信银行	7,800	54,444.00	0.20
154	601002	晋亿实业	12,500	54,375.00	0.20
155	603355	莱克电气	2,400	54,360.00	0.20
156	600758	辽宁能源	15,800	54,352.00	0.20
157	601163	三角轮胎	3,600	54,252.00	0.20
158	000419	通程控股	9,500	54,245.00	0.20
159	601199	江南水务	9,800	54,194.00	0.20
160	601333	广深铁路	15,800	54,194.00	0.20
161	601003	柳钢股份	19,600	54,096.00	0.20
162	605222	起帆电缆	3,500	53,900.00	0.20
163	600500	中化国际	13,400	53,868.00	0.20
164	600148	长春一东	3,000	53,820.00	0.20
165	603089	正裕工业	6,000	53,820.00	0.20
166	603017	中衡设计	6,700	53,801.00	0.20
167	002858	力盛体育	4,700	53,768.00	0.20
168	600180	瑞茂通	12,500	53,750.00	0.20
169	600477	杭萧钢构	20,900	53,713.00	0.20
170	600929	雪天盐业	9,600	53,664.00	0.20
171	300746	汉嘉设计	4,700	53,627.00	0.20
172	002476	宝莫股份	12,700	53,594.00	0.19
173	000498	山东路桥	9,000	53,550.00	0.19
174	600096	云天化	2,400	53,520.00	0.19
175	600389	江山股份	3,700	53,465.00	0.19
176	002057	中钢天源	7,400	53,428.00	0.19
177	002968	新大正	5,800	53,418.00	0.19
178	002777	久远银海	3,100	53,382.00	0.19
179	300196	长海股份	4,900	53,361.00	0.19
180	000030	富奥股份	10,400	53,352.00	0.19
181	601999	出版传媒	8,500	53,295.00	0.19
182	002645	华宏科技	7,800	53,196.00	0.19
183	603230	内蒙新华	4,200	53,172.00	0.19

184	601619	嘉泽新能	16,000	53,120.00	0.19
185	601279	英利汽车	13,800	52,854.00	0.19
186	600927	永安期货	4,000	52,760.00	0.19
187	688372	伟测科技	900	52,668.00	0.19
188	600433	冠豪高新	16,600	52,622.00	0.19
189	603966	法兰泰克	6,800	52,496.00	0.19
190	300193	佳士科技	5,900	52,451.00	0.19
191	600633	浙数文化	5,000	52,300.00	0.19
192	688722	同益中	4,100	52,275.00	0.19
193	002578	闽发铝业	17,400	52,026.00	0.19
194	002363	隆基机械	7,900	51,903.00	0.19
195	300369	绿盟科技	7,200	51,768.00	0.19
196	688007	光峰科技	3,500	51,765.00	0.19
197	688002	睿创微纳	1,100	51,711.00	0.19
198	688260	昀冢科技	3,700	51,615.00	0.19
199	000531	穗恒运 A	8,900	51,264.00	0.19
200	002773	康弘药业	2,600	50,960.00	0.19
201	000902	新洋丰	3,900	50,856.00	0.19
202	600487	亨通光电	2,900	49,938.00	0.18
203	002361	神剑股份	8,900	48,505.00	0.18
204	601857	中国石油	5,400	48,276.00	0.18
205	605167	利柏特	5,000	48,200.00	0.18
206	601869	长飞光纤	1,600	47,824.00	0.17
207	600750	江中药业	2,100	47,670.00	0.17
208	300435	中泰股份	3,900	47,112.00	0.17
209	000729	燕京啤酒	3,900	46,956.00	0.17
210	000856	冀东装备	6,800	46,920.00	0.17
211	603799	华友钴业	1,600	46,816.00	0.17
212	002228	合兴包装	15,600	46,800.00	0.17
213	603309	维力医疗	3,900	46,722.00	0.17
214	688697	纽威数控	2,800	46,592.00	0.17
215	600446	金证股份	2,700	46,548.00	0.17
216	300207	欣旺达	2,000	44,620.00	0.16
217	002206	海利得	10,300	44,187.00	0.16
218	003011	海象新材	2,900	44,080.00	0.16
219	603093	南华期货	3,700	44,030.00	0.16
220	002884	凌霄泵业	2,400	43,848.00	0.16
221	600051	宁波联合	6,700	43,818.00	0.16
222	300610	晨化股份	4,300	43,000.00	0.16
223	688596	正帆科技	1,200	42,660.00	0.16
224	605080	浙江自然	1,800	42,300.00	0.15
225	000528	柳工	3,500	42,210.00	0.15
226	600391	航发科技	2,100	41,685.00	0.15

227	301031	中熔电气	400	41,608.00	0.15
228	600064	南京高科	5,300	41,181.00	0.15
229	603919	金徽酒	2,100	41,160.00	0.15
230	600873	梅花生物	4,100	41,123.00	0.15
231	002597	金禾实业	1,800	41,094.00	0.15
232	000685	中山公用	4,400	40,612.00	0.15
233	603579	荣泰健康	2,800	40,600.00	0.15
234	002705	新宝股份	2,700	40,500.00	0.15
235	002061	浙江交科	9,900	40,392.00	0.15
236	002442	龙星科技	6,700	40,267.00	0.15
237	601918	新集能源	5,600	40,208.00	0.15
238	002226	江南化工	7,400	40,108.00	0.15
239	688510	航亚科技	2,300	40,066.00	0.15
240	002539	云图控股	5,100	39,882.00	0.15
241	002550	千红制药	6,400	39,680.00	0.14
242	002533	金杯电工	4,000	39,360.00	0.14
243	000885	城发环境	3,000	39,330.00	0.14
244	688183	生益电子	1,000	39,260.00	0.14
245	301297	富乐德	900	38,250.00	0.14
246	603297	永新光学	400	37,528.00	0.14
247	603163	圣晖集成	1,400	37,198.00	0.14
248	600458	时代新材	2,900	37,149.00	0.14
249	688196	卓越新能	1,100	36,949.00	0.13
250	603100	川仪股份	1,700	36,635.00	0.13
251	300685	艾德生物	1,600	36,480.00	0.13
252	603357	设计总院	4,000	36,240.00	0.13
253	300994	久祺股份	3,200	36,096.00	0.13
254	002825	纳尔股份	4,600	35,972.00	0.13
255	300443	金雷股份	1,800	35,856.00	0.13
256	601319	中国人保	4,700	35,814.00	0.13
257	300515	三德科技	3,000	35,730.00	0.13
258	002160	常铝股份	9,600	35,712.00	0.13
259	600637	东方明珠	4,600	35,696.00	0.13
260	600528	中铁工业	4,400	35,464.00	0.13
261	000887	中鼎股份	2,700	35,424.00	0.13
262	002026	山东威达	3,600	35,424.00	0.13
263	002376	新北洋	5,400	35,208.00	0.13
264	600661	昂立教育	3,000	35,160.00	0.13
265	600980	北矿科技	2,300	35,144.00	0.13
266	603313	梦百合	5,200	35,100.00	0.13
267	600498	烽火通信	1,800	35,028.00	0.13
268	002138	顺络电子	1,100	34,628.00	0.13
269	002334	英威腾	4,600	34,592.00	0.13

270	000417	合百集团	5,400	34,452.00	0.13
271	002517	恺英网络	2,500	34,025.00	0.12
272	600063	皖维高新	8,400	33,600.00	0.12
273	600459	贵研铂业	2,400	32,952.00	0.12
274	600765	中航重机	1,600	32,752.00	0.12
275	600967	内蒙一机	3,800	32,300.00	0.12
276	000895	双汇发展	1,200	31,152.00	0.11
277	600027	华电国际	5,500	30,855.00	0.11
278	603676	卫信康	3,100	30,845.00	0.11
279	601377	兴业证券	4,900	30,674.00	0.11
280	601137	博威合金	1,500	30,450.00	0.11
281	688127	蓝特光学	1,100	29,810.00	0.11
282	002609	捷顺科技	3,600	29,736.00	0.11
283	002345	潮宏基	5,100	29,631.00	0.11
284	600894	广日股份	2,000	29,200.00	0.11
285	600486	扬农化工	500	28,935.00	0.11
286	600301	华锡有色	1,700	28,917.00	0.11
287	600298	安琪酵母	800	28,840.00	0.10
288	605166	聚合顺	2,400	28,728.00	0.10
289	600885	宏发股份	900	28,638.00	0.10
290	603301	振德医疗	1,300	28,587.00	0.10
291	600012	皖通高速	1,600	28,240.00	0.10
292	600803	新奥股份	1,300	28,184.00	0.10
293	002027	分众传媒	4,000	28,120.00	0.10
294	600839	四川长虹	2,900	27,985.00	0.10
295	002508	老板电器	1,300	27,859.00	0.10
296	002782	可立克	2,200	27,830.00	0.10
297	600350	山东高速	2,700	27,756.00	0.10
298	601566	九牧王	3,300	27,753.00	0.10
299	601567	三星医疗	900	27,684.00	0.10
300	000739	普洛药业	1,700	27,642.00	0.10
301	600299	安迪苏	2,200	27,610.00	0.10
302	600377	宁沪高速	1,800	27,558.00	0.10
303	600732	爱旭股份	2,500	27,550.00	0.10
304	688009	中国通号	4,400	27,544.00	0.10
305	002033	丽江股份	3,100	27,497.00	0.10
306	603367	辰欣药业	2,000	27,480.00	0.10
307	600535	天士力	1,900	27,474.00	0.10
308	002128	电投能源	1,400	27,412.00	0.10
309	605319	无锡振华	1,300	27,365.00	0.10
310	600995	南网储能	2,700	27,324.00	0.10
311	601168	西部矿业	1,700	27,319.00	0.10
312	002293	罗莱生活	3,500	27,300.00	0.10

313	600863	内蒙华电	6,300	27,279.00	0.10
314	601601	中国太保	800	27,264.00	0.10
315	601058	赛轮轮胎	1,900	27,227.00	0.10
316	601339	百隆东方	5,000	27,200.00	0.10
317	600908	无锡银行	4,600	27,186.00	0.10
318	601101	昊华能源	3,300	27,159.00	0.10
319	001207	联科科技	1,400	27,146.00	0.10
320	600507	方大特钢	6,700	27,135.00	0.10
321	601006	大秦铁路	4,000	27,120.00	0.10
322	002627	三峡旅游	5,400	27,108.00	0.10
323	600578	京能电力	7,700	27,104.00	0.10
324	002483	润邦股份	5,200	27,092.00	0.10
325	603998	方盛制药	2,600	27,092.00	0.10
326	002060	广东建工	7,400	27,084.00	0.10
327	600740	山西焦化	6,700	27,001.00	0.10
328	600312	平高电气	1,400	26,880.00	0.10
329	000089	深圳机场	3,900	26,871.00	0.10
330	603187	海容冷链	2,400	26,856.00	0.10
331	002507	涪陵榨菜	1,900	26,847.00	0.10
332	300682	朗新集团	2,200	26,840.00	0.10
333	603298	杭叉集团	1,500	26,835.00	0.10
334	603008	喜临门	1,600	26,816.00	0.10
335	600521	华海药业	1,500	26,805.00	0.10
336	002019	亿帆医药	2,500	26,800.00	0.10
337	002262	恩华药业	1,100	26,785.00	0.10
338	600000	浦发银行	2,600	26,754.00	0.10
339	002142	宁波银行	1,100	26,741.00	0.10
340	002606	大连电瓷	2,900	26,738.00	0.10
341	000060	中金岭南	5,700	26,733.00	0.10
342	601799	星宇股份	200	26,696.00	0.10
343	000738	航发控制	1,200	26,688.00	0.10
344	603567	珍宝岛	2,300	26,680.00	0.10
345	002543	万和电气	2,600	26,624.00	0.10
346	603043	广州酒家	1,600	26,608.00	0.10
347	002393	力生制药	1,500	26,460.00	0.10
348	601965	中国汽研	1,500	26,430.00	0.10
349	600066	宇通客车	1,000	26,380.00	0.10
350	600141	兴发集团	1,200	26,040.00	0.09
351	688321	微芯生物	1,400	26,012.00	0.09
352	600879	航天电子	2,900	25,984.00	0.09
353	000987	越秀资本	3,700	25,974.00	0.09
354	603556	海兴电力	700	25,893.00	0.09
355	603258	电魂网络	1,300	25,857.00	0.09

356	688409	富创精密	500	25,785.00	0.09
357	603179	新泉股份	600	25,620.00	0.09
358	688106	金宏气体	1,500	25,515.00	0.09
359	688138	清溢光电	1,100	25,190.00	0.09
360	601628	中国人寿	600	25,152.00	0.09
361	002595	豪迈科技	500	25,095.00	0.09
362	002847	盐津铺子	400	25,040.00	0.09
363	301109	军信股份	1,500	25,020.00	0.09
364	300339	润和软件	500	25,015.00	0.09
365	000429	粤高速 A	1,700	24,990.00	0.09
366	688262	国芯科技	900	24,930.00	0.09
367	002859	洁美科技	1,200	24,900.00	0.09
368	688362	甬矽电子	700	23,576.00	0.09
369	688208	道通科技	600	23,496.00	0.09
370	688233	神工股份	1,000	23,450.00	0.09
371	688116	天奈科技	600	23,286.00	0.08
372	002479	富春环保	4,800	22,752.00	0.08
373	603681	永冠新材	1,700	21,913.00	0.08
374	688131	皓元医药	600	21,420.00	0.08
375	600269	赣粤高速	3,800	21,318.00	0.08
376	002864	盘龙药业	700	21,287.00	0.08
377	688513	苑东生物	700	21,091.00	0.08
378	002497	雅化集团	1,800	21,060.00	0.08
379	688270	臻镭科技	600	21,000.00	0.08
380	002865	钧达股份	400	20,440.00	0.07
381	600886	国投电力	1,200	19,944.00	0.07
382	000848	承德露露	2,200	19,734.00	0.07
383	300918	南山智尚	1,900	19,589.00	0.07
384	688388	嘉元科技	1,300	19,149.00	0.07
385	603612	索通发展	1,400	18,914.00	0.07
386	688128	中国电研	900	18,909.00	0.07
387	002880	卫光生物	700	18,907.00	0.07
388	002441	众业达	2,400	18,672.00	0.07
389	688322	奥比中光	400	18,600.00	0.07
390	600361	创新新材	4,800	18,528.00	0.07
391	688378	奥来德	800	18,248.00	0.07
392	002522	浙江众成	4,600	17,986.00	0.07
393	688123	聚辰股份	300	17,556.00	0.06
394	688259	创耀科技	500	17,555.00	0.06
395	001309	德明利	200	17,440.00	0.06
396	688518	联赢激光	1,100	17,424.00	0.06
397	600655	豫园股份	2,700	17,361.00	0.06
398	600667	太极实业	2,500	17,300.00	0.06

399	688206	概伦电子	900	17,019.00	0.06
400	000541	佛山照明	2,700	16,740.00	0.06
401	600170	上海建工	6,100	16,165.00	0.06
402	000652	泰达股份	3,900	16,146.00	0.06
403	301155	海力风电	300	15,993.00	0.06
404	300579	数字认证	500	15,710.00	0.06
405	603129	春风动力	100	15,707.00	0.06
406	301050	雷电微力	300	15,474.00	0.06
407	603713	密尔克卫	300	15,360.00	0.06
408	301327	华宝新能	200	15,342.00	0.06
409	603989	艾华集团	1,000	15,080.00	0.05
410	688800	瑞可达	300	15,033.00	0.05
411	300035	中科电气	1,000	14,950.00	0.05
412	688380	中微半导	500	14,950.00	0.05
413	300236	上海新阳	400	14,948.00	0.05
414	000411	英特集团	1,400	14,910.00	0.05
415	002895	川恒股份	600	14,760.00	0.05
416	600258	首旅酒店	1,000	14,670.00	0.05
417	688298	东方生物	500	14,665.00	0.05
418	300229	拓尔思	700	14,658.00	0.05
419	603281	江瀚新材	600	14,640.00	0.05
420	300620	光库科技	300	14,580.00	0.05
421	601777	千里科技	1,900	14,535.00	0.05
422	605376	博迁新材	500	14,475.00	0.05
423	603733	仙鹤股份	700	14,441.00	0.05
424	000048	京基智农	800	14,400.00	0.05
425	600835	上海机电	800	14,336.00	0.05
426	600882	妙可蓝多	800	14,320.00	0.05
427	688182	灿勤科技	800	14,304.00	0.05
428	002891	中宠股份	400	14,280.00	0.05
429	600216	浙江医药	900	14,274.00	0.05
430	002043	兔宝宝	1,200	14,256.00	0.05
431	600685	中船防务	600	14,220.00	0.05
432	605589	圣泉集团	600	14,148.00	0.05
433	300777	中简科技	500	14,145.00	0.05
434	000766	通化金马	900	14,130.00	0.05
435	603005	晶方科技	500	14,125.00	0.05
436	301171	易点天下	500	14,095.00	0.05
437	688139	海尔生物	400	14,080.00	0.05
438	002088	鲁阳节能	1,100	14,069.00	0.05
439	300415	伊之密	700	14,042.00	0.05
440	301207	华兰疫苗	800	14,008.00	0.05
441	688121	卓然股份	1,300	14,001.00	0.05

442	688798	艾为电子	200	13,964.00	0.05
443	300953	震裕科技	200	13,928.00	0.05
444	002332	仙琚制药	1,400	13,916.00	0.05
445	300666	江丰电子	200	13,890.00	0.05
446	000422	湖北宜化	1,100	13,882.00	0.05
447	002840	华统股份	1,100	13,871.00	0.05
448	300432	富临精工	900	13,842.00	0.05
449	002068	黑猫股份	1,300	13,832.00	0.05
450	002233	塔牌集团	1,800	13,806.00	0.05
451	600618	氯碱化工	1,400	13,804.00	0.05
452	603162	海通发展	1,500	13,800.00	0.05
453	000019	深粮控股	2,100	13,797.00	0.05
454	603609	禾丰股份	1,600	13,792.00	0.05
455	603693	江苏新能	1,400	13,790.00	0.05
456	600452	涪陵电力	1,300	13,767.00	0.05
457	002100	天康生物	2,100	13,755.00	0.05
458	603040	新坐标	600	13,752.00	0.05
459	601069	西部黄金	1,200	13,740.00	0.05
460	600874	创业环保	2,300	13,731.00	0.05
461	603025	大豪科技	900	13,725.00	0.05
462	603565	中谷物流	1,400	13,720.00	0.05
463	001301	尚太科技	200	13,710.00	0.05
464	300743	天地数码	900	13,707.00	0.05
465	600552	凯盛科技	1,200	13,692.00	0.05
466	000875	吉电股份	2,600	13,676.00	0.05
467	300623	捷捷微电	400	13,664.00	0.05
468	300674	宇信科技	700	13,664.00	0.05
469	600295	鄂尔多斯	1,400	13,664.00	0.05
470	601022	宁波远洋	1,700	13,651.00	0.05
471	000088	盐田港	2,800	13,636.00	0.05
472	000860	顺鑫农业	700	13,629.00	0.05
473	300761	立华股份	700	13,622.00	0.05
474	002489	浙江永强	4,200	13,608.00	0.05
475	003013	地铁设计	900	13,608.00	0.05
476	300151	昌红科技	800	13,600.00	0.05
477	601107	四川成渝	2,600	13,598.00	0.05
478	002378	章源钨业	2,100	13,587.00	0.05
479	002948	青岛银行	3,500	13,580.00	0.05
480	601208	东材科技	1,800	13,572.00	0.05
481	002145	中核钛白	3,200	13,568.00	0.05
482	600305	恒顺醋业	1,700	13,566.00	0.05
483	605111	新洁能	400	13,564.00	0.05
484	002004	华邦健康	3,000	13,560.00	0.05

485	600273	嘉化能源	1,700	13,549.00	0.05
486	600058	五矿发展	1,900	13,528.00	0.05
487	600449	宁夏建材	900	13,518.00	0.05
488	600100	同方股份	1,900	13,509.00	0.05
489	300618	寒锐钴业	400	13,508.00	0.05
490	301175	中科环保	2,500	13,500.00	0.05
491	002549	凯美特气	2,200	13,486.00	0.05
492	603132	金徽股份	1,200	13,476.00	0.05
493	002194	武汉凡谷	1,200	13,464.00	0.05
494	688383	新益昌	300	13,461.00	0.05
495	002191	劲嘉股份	3,200	13,440.00	0.05
496	600017	日照港	4,200	13,440.00	0.05
497	600248	陕建股份	3,000	13,440.00	0.05
498	002239	奥特佳	4,400	13,420.00	0.05
499	300206	理邦仪器	1,200	13,416.00	0.05
500	000927	中国铁物	5,100	13,413.00	0.05
501	002941	新疆交建	1,200	13,404.00	0.05
502	000969	安泰科技	1,200	13,380.00	0.05
503	600328	中盐化工	1,700	13,379.00	0.05
504	000928	中钢国际	2,100	13,377.00	0.05
505	603299	苏盐井神	1,200	13,368.00	0.05
506	000420	吉林化纤	3,700	13,357.00	0.05
507	002545	东方铁塔	1,900	13,357.00	0.05
508	002079	苏州固锝	1,300	13,351.00	0.05
509	300672	国科微	200	13,350.00	0.05
510	600635	大众公用	3,000	13,350.00	0.05
511	603118	共进股份	1,500	13,350.00	0.05
512	002176	江特电机	1,800	13,338.00	0.05
513	002649	博彦科技	1,100	13,332.00	0.05
514	002605	姚记科技	500	13,330.00	0.05
515	300702	天宇股份	800	13,328.00	0.05
516	600604	市北高新	2,800	13,328.00	0.05
517	601083	锦江航运	1,400	13,328.00	0.05
518	000735	罗牛山	2,000	13,320.00	0.05
519	600587	新华医疗	800	13,320.00	0.05
520	000966	长源电力	2,800	13,300.00	0.05
521	600854	春兰股份	2,900	13,282.00	0.05
522	002567	唐人神	2,600	13,260.00	0.05
523	301080	百普赛斯	300	13,242.00	0.05
524	300772	运达股份	1,000	13,240.00	0.05
525	002250	联化科技	2,400	13,224.00	0.05
526	600210	紫江企业	2,000	13,220.00	0.05
527	600478	科力远	3,200	13,216.00	0.05

528	300352	北信源	2,500	13,200.00	0.05
529	300463	迈克生物	1,000	13,200.00	0.05
530	603866	桃李面包	2,000	13,200.00	0.05
531	002015	协鑫能科	1,700	13,192.00	0.05
532	002928	华夏航空	1,700	13,192.00	0.05
533	600662	外服控股	2,600	13,182.00	0.05
534	002468	申通快递	1,300	13,169.00	0.05
535	600986	浙文互联	2,200	13,156.00	0.05
536	002237	恒邦股份	1,300	13,130.00	0.05
537	002967	广电计量	800	13,120.00	0.05
538	300065	海兰信	1,600	13,120.00	0.05
539	002446	盛路通信	2,000	13,100.00	0.05
540	600335	国机汽车	2,100	13,083.00	0.05
541	603169	兰石重装	2,400	13,080.00	0.05
542	600993	马应龙	500	13,055.00	0.05
543	300232	洲明科技	1,900	13,053.00	0.05
544	605333	沪光股份	400	13,052.00	0.05
545	600120	浙江东方	2,800	13,048.00	0.05
546	002299	圣农发展	900	13,032.00	0.05
547	002312	川发龙蟒	900	13,023.00	0.05
548	002434	万里扬	2,100	13,020.00	0.05
549	601033	永兴股份	900	13,014.00	0.05
550	300101	振芯科技	600	12,996.00	0.05
551	300079	数码视讯	2,400	12,984.00	0.05
552	601609	金田股份	2,200	12,980.00	0.05
553	603938	三孚股份	1,200	12,972.00	0.05
554	301363	美好医疗	400	12,968.00	0.05
555	002222	福晶科技	400	12,960.00	0.05
556	002961	瑞达期货	900	12,933.00	0.05
557	002212	天融信	2,000	12,900.00	0.05
558	002243	力合科创	1,600	12,896.00	0.05
559	688739	成大生物	500	12,890.00	0.05
560	688300	联瑞新材	200	12,880.00	0.05
561	688579	山大地纬	1,400	12,866.00	0.05
562	605196	华通线缆	1,100	12,848.00	0.05
563	002245	蔚蓝锂芯	1,200	12,828.00	0.05
564	600869	远东股份	2,700	12,825.00	0.05
565	300031	宝通科技	700	12,824.00	0.05
566	301348	蓝箭电子	500	12,810.00	0.05
567	002400	省广集团	1,600	12,784.00	0.05
568	002860	星帅尔	1,300	12,753.00	0.05
569	002402	和而泰	700	12,677.00	0.05
570	688598	金博股份	600	12,636.00	0.05

571	300476	胜宏科技	300	12,627.00	0.05
572	688161	威高骨科	500	12,610.00	0.05
573	301367	怡和嘉业	200	12,600.00	0.05
574	688261	东微半导	300	12,597.00	0.05
575	300705	九典制药	700	12,565.00	0.05
576	603690	至纯科技	500	12,555.00	0.05
577	600206	有研新材	800	12,536.00	0.05
578	688315	诺禾致源	1,000	12,500.00	0.05
579	688266	泽璟制药	200	12,462.00	0.05
580	300726	宏达电子	400	12,440.00	0.05
581	301262	海看股份	500	12,435.00	0.05
582	688432	有研硅	1,100	12,430.00	0.05
583	300170	汉得信息	1,000	12,400.00	0.05
584	600577	精达股份	1,700	12,393.00	0.05
585	301180	万祥科技	800	12,376.00	0.05
586	002459	晶澳科技	900	12,375.00	0.05
587	300083	创世纪	1,900	12,369.00	0.04
588	688209	英集芯	700	12,369.00	0.04
589	603583	捷昌驱动	500	12,355.00	0.04
590	002901	大博医疗	400	12,336.00	0.04
591	002906	华阳集团	400	12,300.00	0.04
592	002851	麦格米特	200	12,292.00	0.04
593	300768	迪普科技	700	12,250.00	0.04
594	688392	骄成超声	300	12,240.00	0.04
595	688103	国力股份	300	12,201.00	0.04
596	300596	利安隆	400	12,200.00	0.04
597	603171	税友股份	400	12,200.00	0.04
598	603678	火炬电子	400	12,200.00	0.04
599	001287	中电港	600	12,186.00	0.04
600	603533	掌阅科技	600	12,186.00	0.04
601	603083	剑桥科技	300	12,180.00	0.04
602	300741	华宝股份	700	12,173.00	0.04
603	000632	三木集团	3,300	12,111.00	0.04
604	301015	百洋医药	500	12,105.00	0.04
605	300638	广和通	600	12,090.00	0.04
606	688212	澳华内镜	300	12,054.00	0.04
607	600850	电科数字	500	11,950.00	0.04
608	688389	普门科技	800	11,912.00	0.04
609	688359	三孚新科	300	11,844.00	0.04
610	002585	双星新材	2,200	11,748.00	0.04
611	300973	立高食品	300	11,709.00	0.04
612	300613	富瀚微	200	11,700.00	0.04
613	688337	普源精电	300	11,700.00	0.04

614	300458	全志科技	300	11,628.00	0.04
615	300346	南大光电	300	11,577.00	0.04
616	688630	芯碁微装	200	11,544.00	0.04
617	688033	天宜上佳	2,000	11,500.00	0.04
618	688313	仕佳光子	700	11,473.00	0.04
619	688351	微电生理	600	11,424.00	0.04
620	300470	中密控股	300	11,310.00	0.04
621	688239	航宇科技	300	11,190.00	0.04
622	003017	大洋生物	600	11,172.00	0.04
623	600480	凌云股份	1,000	10,810.00	0.04
624	300811	铂科新材	200	10,782.00	0.04
625	688699	明微电子	300	10,782.00	0.04
626	300857	协创数据	100	10,689.00	0.04
627	603227	雪峰科技	1,200	10,428.00	0.04
628	000153	丰原药业	1,700	10,421.00	0.04
629	002286	保龄宝	1,400	10,332.00	0.04
630	600522	中天科技	700	10,024.00	0.04
631	600562	国睿科技	500	9,965.00	0.04
632	688246	嘉和美康	400	9,920.00	0.04
633	002140	东华科技	1,000	9,880.00	0.04
634	300453	三鑫医疗	1,300	9,698.00	0.04
635	600037	歌华有线	1,300	9,698.00	0.04
636	600425	青松建化	2,400	9,408.00	0.03
637	688668	鼎通科技	200	9,372.00	0.03
638	688308	欧科亿	500	9,025.00	0.03
639	603165	荣晟环保	700	8,568.00	0.03
640	603416	信捷电气	200	8,390.00	0.03
641	603686	福龙马	800	8,320.00	0.03
642	600875	东方电气	500	7,945.00	0.03
643	603020	爱普股份	1,000	7,740.00	0.03
644	688621	阳光诺和	200	7,540.00	0.03
645	603766	隆鑫通用	800	7,280.00	0.03
646	600184	光电股份	700	7,224.00	0.03
647	688484	南芯科技	200	7,208.00	0.03
648	688201	信安世纪	800	7,064.00	0.03
649	000034	神州数码	200	7,010.00	0.03
650	688559	海目星	200	6,880.00	0.03
651	688305	科德数控	100	6,817.00	0.02
652	002398	垒知集团	1,500	6,585.00	0.02
653	001380	华纬科技	300	6,570.00	0.02
654	688595	芯海科技	200	6,560.00	0.02
655	600784	鲁银投资	1,100	6,479.00	0.02
656	002034	旺能环境	400	6,200.00	0.02

657	603111	康尼机电	1,000	6,030.00	0.02
658	688133	泰坦科技	300	5,472.00	0.02
659	688403	汇成股份	600	5,376.00	0.02
660	300445	康斯特	300	4,881.00	0.02
661	688268	华特气体	100	4,592.00	0.02
662	688609	九联科技	400	4,240.00	0.02
663	688588	凌志软件	300	4,140.00	0.02
664	688093	世华科技	200	4,038.00	0.01
665	688065	凯赛生物	100	3,880.00	0.01
666	000821	京山轻机	300	3,735.00	0.01
667	688707	振华新材	300	3,285.00	0.01

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601857	中国石油	1,067,823.00	3.89
2	601288	农业银行	1,000,148.00	3.64
3	002782	可立克	997,882.00	3.63
4	600366	宁波韵升	987,854.00	3.60
5	002128	电投能源	916,384.00	3.34
6	601168	西部矿业	873,710.00	3.18
7	002283	天润工业	861,442.00	3.14
8	601898	中煤能源	843,819.00	3.07
9	002534	西子洁能	840,498.20	3.06
10	601369	陕鼓动力	821,924.00	2.99
11	002925	盈趣科技	798,430.00	2.91
12	601919	中远海控	794,559.00	2.89
13	688023	安恒信息	785,050.00	2.86
14	600582	天地科技	768,940.00	2.80
15	601000	唐山港	763,084.00	2.78
16	600320	振华重工	753,296.00	2.74
17	603595	东尼电子	752,609.00	2.74
18	002368	太极股份	750,222.00	2.73
19	603348	文灿股份	744,253.00	2.71
20	600642	申能股份	742,670.00	2.71
21	601088	中国神华	740,154.00	2.70
22	002777	久远银海	739,110.00	2.69
23	002291	遥望科技	738,988.00	2.69
24	600968	海油发展	738,628.00	2.69
25	600177	雅戈尔	734,747.00	2.68
26	603915	国茂股份	732,836.00	2.67

27	002705	新宝股份	730,204.00	2.66
28	003031	中瓷电子	721,211.00	2.63
29	002390	信邦制药	720,646.00	2.62
30	002497	雅化集团	715,608.00	2.61
31	688776	国光电气	715,380.48	2.61
32	000598	兴蓉环境	712,601.00	2.60
33	603185	弘元绿能	710,134.87	2.59
34	601886	江河集团	709,538.00	2.58
35	688981	中芯国际	709,087.16	2.58
36	601009	南京银行	708,318.00	2.58
37	688007	光峰科技	706,902.96	2.57
38	688025	杰普特	705,304.18	2.57
39	600023	浙能电力	705,016.00	2.57
40	688368	晶丰明源	701,284.64	2.55
41	600282	南钢股份	695,956.00	2.53
42	002139	拓邦股份	691,168.00	2.52
43	603158	腾龙股份	690,321.00	2.51
44	001207	联科科技	688,117.00	2.51
45	603305	旭升集团	686,065.00	2.50
46	688711	宏微科技	684,084.04	2.49
47	002073	软控股份	683,339.00	2.49
48	601766	中国中车	683,161.00	2.49
49	002206	海利得	677,891.00	2.47
50	002396	星网锐捷	676,620.00	2.46
51	601101	昊华能源	674,973.00	2.46
52	600690	海尔智家	672,843.00	2.45
53	688383	新益昌	669,944.64	2.44
54	603026	石大胜华	666,064.00	2.43
55	601225	陕西煤业	662,561.00	2.41
56	600795	国电电力	661,018.00	2.41
57	002468	申通快递	658,263.00	2.40
58	002683	广东宏大	655,223.80	2.39
59	603866	桃李面包	652,541.00	2.38
60	601985	中国核电	652,412.00	2.38
61	600420	国药现代	647,279.00	2.36
62	688521	芯原股份	644,980.43	2.35
63	300065	海兰信	644,869.00	2.35
64	002245	蔚蓝锂芯	642,796.00	2.34
65	603558	健盛集团	640,474.00	2.33
66	002335	科华数据	639,872.00	2.33
67	002241	歌尔股份	637,923.00	2.32
68	603489	八方股份	637,794.00	2.32
69	000913	钱江摩托	636,991.00	2.32

70	688586	江航装备	634,887.14	2.31
71	600664	哈药股份	633,660.00	2.31
72	603609	禾丰股份	630,113.00	2.30
73	002928	华夏航空	630,016.00	2.29
74	688116	天奈科技	622,959.43	2.27
75	600391	航发科技	622,617.00	2.27
76	605358	立昂微	621,755.00	2.26
77	601825	沪农商行	621,167.00	2.26
78	600073	光明肉业	619,410.00	2.26
79	688208	道通科技	615,035.88	2.24
80	000937	冀中能源	610,564.00	2.22
81	600295	鄂尔多斯	608,535.00	2.22
82	000157	中联重科	604,282.00	2.20
83	002612	朗姿股份	603,440.00	2.20
84	002123	梦网科技	600,014.00	2.19
85	000729	燕京啤酒	598,516.00	2.18
86	000795	英洛华	593,963.00	2.16
87	002020	京新药业	593,684.00	2.16
88	688002	睿创微纳	593,658.63	2.16
89	688028	沃尔德	593,099.01	2.16
90	600012	皖通高速	592,827.00	2.16
91	000039	中集集团	592,758.00	2.16
92	002041	登海种业	591,026.00	2.15
93	002488	金固股份	590,870.00	2.15
94	601988	中国银行	588,828.00	2.14
95	002539	云图控股	587,491.00	2.14
96	000883	湖北能源	586,640.00	2.14
97	600882	妙可蓝多	585,777.00	2.13
98	603132	金徽股份	583,009.00	2.12
99	600479	千金药业	580,931.00	2.12
100	688059	华锐精密	574,877.80	2.09
101	600223	福瑞达	574,797.00	2.09
102	002101	广东鸿图	572,234.00	2.08
103	688220	翱捷科技	571,926.77	2.08
104	002544	普天科技	571,250.00	2.08
105	603218	日月股份	571,145.00	2.08
106	300463	迈克生物	567,590.00	2.07
107	002153	石基信息	567,089.00	2.07
108	002036	联创电子	567,061.00	2.07
109	601916	浙商银行	565,417.00	2.06
110	603871	嘉友国际	565,311.00	2.06
111	002906	华阳集团	563,033.00	2.05
112	600971	恒源煤电	561,687.00	2.05

113	002532	天山铝业	561,637.00	2.05
114	002219	新里程	559,313.00	2.04
115	300101	振芯科技	559,032.00	2.04
116	300674	宇信科技	558,426.00	2.03
117	600500	中化国际	556,957.00	2.03
118	605376	博迁新材	556,231.00	2.03
119	688185	康希诺	555,169.52	2.02
120	601077	渝农商行	553,997.00	2.02
121	002533	金杯电工	553,193.00	2.01
122	600416	湘电股份	552,988.00	2.01
123	600489	中金黄金	552,594.00	2.01
124	002025	航天电器	550,818.00	2.01

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601857	中国石油	1,034,776.00	3.77
2	601288	农业银行	1,019,171.00	3.71
3	600366	宁波韵升	1,015,292.00	3.70
4	002782	可立克	989,372.00	3.60
5	002283	天润工业	972,443.00	3.54
6	002128	电投能源	889,290.00	3.24
7	601168	西部矿业	878,916.00	3.20
8	688023	安恒信息	832,781.39	3.03
9	688711	宏微科技	811,567.25	2.96
10	601898	中煤能源	808,244.00	2.94
11	003031	中瓷电子	800,770.00	2.92
12	002925	盈趣科技	795,922.00	2.90
13	603595	东尼电子	793,178.00	2.89
14	603348	文灿股份	792,639.00	2.89
15	002291	遥望科技	788,176.00	2.87
16	600582	天地科技	783,851.00	2.86
17	601000	唐山港	767,194.00	2.79
18	603915	国茂股份	759,575.00	2.77
19	600968	海油发展	758,332.00	2.76
20	600642	申能股份	756,560.00	2.76
21	601088	中国神华	754,900.00	2.75
22	601919	中远海控	753,497.00	2.74
23	002777	久远银海	737,863.90	2.69
24	603305	旭升集团	732,295.00	2.67
25	000598	兴蓉环境	727,815.00	2.65
26	688025	杰普特	727,470.90	2.65

27	688368	晶丰明源	719,909.67	2.62
28	600177	雅戈尔	719,880.00	2.62
29	688776	国光电气	714,234.64	2.60
30	603026	石大胜华	713,929.00	2.60
31	601766	中国中车	712,341.00	2.59
32	002705	新宝股份	710,501.00	2.59
33	688007	光峰科技	707,052.87	2.58
34	000795	英洛华	699,567.00	2.55
35	002368	太极股份	695,985.00	2.54
36	600023	浙能电力	695,153.00	2.53
37	300065	海兰信	693,528.00	2.53
38	601369	陕鼓动力	690,399.00	2.51
39	002534	西子洁能	690,335.00	2.51
40	603185	弘元绿能	688,438.00	2.51
41	000937	冀中能源	687,004.00	2.50
42	601101	昊华能源	686,464.00	2.50
43	601985	中国核电	685,254.00	2.50
44	002245	蔚蓝锂芯	682,829.00	2.49
45	002335	科华数据	682,135.00	2.48
46	688521	芯原股份	681,545.64	2.48
47	601225	陕西煤业	678,059.00	2.47
48	600690	海尔智家	674,558.00	2.46
49	601886	江河集团	673,252.00	2.45
50	001207	联科科技	672,761.00	2.45
51	000913	钱江摩托	672,632.00	2.45
52	603558	健盛集团	667,543.00	2.43
53	688383	新益昌	664,648.11	2.42
54	002497	雅化集团	662,776.00	2.41
55	603866	桃李面包	662,377.00	2.41
56	688981	中芯国际	660,558.96	2.41
57	605376	博迁新材	659,304.00	2.40
58	002390	信邦制药	658,614.00	2.40
59	002468	申通快递	657,417.00	2.39
60	002241	歌尔股份	654,664.00	2.38
61	600795	国电电力	651,565.00	2.37
62	002206	海利得	650,078.00	2.37
63	688208	道通科技	647,854.97	2.36
64	600882	妙可蓝多	642,074.00	2.34
65	600391	航发科技	641,062.00	2.33
66	002928	华夏航空	639,520.00	2.33
67	002123	梦网科技	635,212.00	2.31
68	601825	沪农商行	634,112.00	2.31
69	002488	金固股份	628,619.50	2.29

70	603489	八方股份	628,369.00	2.29
71	688059	华锐精密	627,047.31	2.28
72	688116	天奈科技	626,834.53	2.28
73	002036	联创电子	621,974.00	2.27
74	000157	中联重科	621,926.00	2.27
75	300389	艾比森	621,464.00	2.26
76	002073	软控股份	619,911.00	2.26
77	002041	登海种业	619,284.00	2.26
78	600295	鄂尔多斯	617,828.00	2.25
79	688028	沃尔德	617,486.76	2.25
80	002612	朗姿股份	617,083.00	2.25
81	002396	星网锐捷	615,177.00	2.24
82	601009	南京银行	612,282.00	2.23
83	603416	信捷电气	610,465.00	2.22
84	605358	立昂微	609,079.00	2.22
85	002544	普天科技	609,061.00	2.22
86	603609	禾丰股份	608,565.00	2.22
87	002791	坚朗五金	605,858.00	2.21
88	002153	石基信息	604,366.00	2.20
89	002139	拓邦股份	601,938.00	2.19
90	688220	翱捷科技	593,010.31	2.16
91	300101	振芯科技	592,868.00	2.16
92	000883	湖北能源	591,164.00	2.15
93	600664	哈药股份	590,029.00	2.15
94	000039	中集集团	589,978.50	2.15
95	002101	广东鸿图	588,431.00	2.14
96	603906	龙蟠科技	588,234.00	2.14
97	600420	国药现代	580,612.00	2.11
98	601916	浙商银行	578,470.00	2.11
99	002683	广东宏大	578,064.00	2.11
100	600320	振华重工	575,284.00	2.10
101	600282	南钢股份	574,360.00	2.09
102	600556	天下秀	573,140.00	2.09
103	000338	潍柴动力	572,338.00	2.08
104	600971	恒源煤电	572,200.00	2.08
105	600479	千金药业	569,620.00	2.07
106	600489	中金黄金	569,532.00	2.07
107	000729	燕京啤酒	568,581.00	2.07
108	603132	金徽股份	567,484.00	2.07
109	600316	洪都航空	567,392.00	2.07
110	600012	皖通高速	567,016.00	2.07
111	002815	崇达技术	566,466.00	2.06
112	603158	腾龙股份	565,477.00	2.06

113	688185	康希诺	564,773.53	2.06
114	600073	光明肉业	564,412.00	2.06
115	600835	上海机电	563,721.00	2.05
116	002025	航天电器	563,360.00	2.05
117	002068	黑猫股份	562,350.00	2.05
118	688066	航天宏图	561,752.63	2.05
119	601077	渝农商行	559,575.00	2.04
120	688586	江航装备	558,916.11	2.04
121	002906	华阳集团	558,595.00	2.03
122	603713	密尔克卫	557,414.00	2.03
123	603871	嘉友国际	555,170.00	2.02
124	300260	新莱应材	554,402.00	2.02
125	000860	顺鑫农业	553,957.00	2.02
126	603919	金徽酒	550,917.00	2.01
127	300682	朗新集团	550,619.00	2.01
128	688378	奥来德	549,648.80	2.00

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	613,986,838.84
卖出股票收入（成交）总额	620,264,623.11

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无余额。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

无余额。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无余额。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无余额。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无余额。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金管理人充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，旨在通过股指期货实现基金的套期保值。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

无。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到监管部门立案调查或报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形说明

报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体中，上海振华重工（集团）股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到舟山市定海区应急管理局的处罚，山东金岭矿业股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到淄博市临淄区交通运输局的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规、基金合同及公司制度的规定。除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	31,359.58
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	31,359.58

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无余额。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无余额。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
中信建投睿利 A	373	44,446.77	13,379,137.13	80.7010%	3,199,508.27	19.2990%
中信建投睿利 C	466	18,995.30	3,209,625.25	36.2595%	5,642,185.13	63.7405%
合计	809	31,434.43	16,588,762.38	65.2319%	8,841,693.40	34.7681%

注：持有人户数合计数少于各分项之和，系部分基金持有人持有多个份额类别基金所致。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	中信建投睿利 A	0	0%
	中信建投睿利 C	0	0%
	合计	0	0%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	中信建投睿利 A	0
	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

9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

截至 2019 年 12 月 7 日，中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同生效届满三年。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

	中信建投睿利 A	中信建投睿利 C
基金合同生效日（2016 年 12 月 07 日）基金份额总额	47,686,882.68	—
本报告期期初基金份额总额	8,167,661.11	19,511,257.51
本报告期基金总申购份额	12,137,844.62	36,260,982.02
减：本报告期基金总赎回份额	3,726,860.33	46,920,429.15
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	—	—
本报告期末基金份额总额	16,578,645.40	8,851,810.38

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金以通讯方式召开了基金份额持有人大会，权益登记日为 2024 年 7 月 18 日，大会投票表决时间为 2024 年 7 月 19 日至 2024 年 8 月 16 日 17:00 止，会议审议的议案为《关于持续运作中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金的议案》。本次会议于 2024 年 8 月 19 日表决通过了《关于持续运作中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金的议案》，决议自 2024 年 8 月 19 日生效。基金管理人于 2024 年 8 月 20 日披露了《关于中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内为本基金提供审计服务的会计师事务所由普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）更换为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）。报告期内本基金应支付审计机构安永华明会计

师事务所（特殊普通合伙）审计费用 10,109.88 元，其已提供审计服务的连续年限为 1 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人
受到稽查或处罚等措施的时间	2024 年 05 月 16 日
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证监会北京监管局
受到的具体措施类型	责令改正
受到稽查或处罚等措施的原因	违反《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》等
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司积极进行整改，截至本报告期末已向中国证监会北京监管局提交完成整改报告。
其他	

注：报告期内基金管理人的高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

11.6.2 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
中信建投证券	4	1,234,251,461.95	100.00%	601,948.38	100.00%	-
银河证券	1	-	-	-	-	019900 席位已退租（2024 年 6 月 30 日）

注：1、本基金的证券交易结算模式自 2023 年 6 月 21 日起转换为券商结算模式，表中的证券交易成交金额及应支付的佣金等数据，为委托证券公司办理证券投资及佣金支付情况。

2、本报告期内本基金无新增办理证券投资委托的证券公司，减少交易单元的证券公司为中国银河证券股份有限公司。

3、根据中国证监会《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》及《中信建投基金管理有限公司公募基金证券交易费用管理办法》，基金管理人选择证券公司参与证券交易的标准和程序如下：

（1）选择证券公司参与证券交易的标准

基金管理人根据自身合规风控能力、信息系统建设水平、运营及交易服务能力、研究服务能力、产品管理规模等情况，审慎选择财务状况良好，经营稳健规范，系统运行安全，合规风控能力、运营及交易服务能力、研究服务能力较强的证券公司参与证券交易。

(2) 选择证券公司参与证券交易的程序

基金管理人指定专人负责参与证券交易的证券公司的准入评估，并根据评估结果完成与证券公司的协议签订及交易佣金费率的确定等工作。

基金管理人建立了“证券研究报告质量评分机制”“证券综合研究服务评分体系”等，每季度组织公募投研部门完成对已合作证券公司的研究服务打分评价，评价结果是确定/调整证券公司股票交易成交金额及佣金比例限制的参考。

4、中国证监会《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》自 2024 年 7 月 1 日起实施，本基金管理人披露的《中信建投基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度）》报告期为 2024 年 7 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日，本基金产品年度报告报告期为 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日，2024 年上半年度仍遵照适用中国证监会原《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》以及本基金管理人原《中信建投基金管理有限公司公募基金交易单元管理办法》的相关规定。

11.7.2 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
中信建投证券	8,112.90	100.00%	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中信建投基金管理有限公司旗	规定报刊	2024-01-22

	下部分基金 2023 年第 4 季度报告提示性公告		
2	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 4 季度报告	规定网站	2024-01-22
3	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	2024-02-07
4	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	2024-02-19
5	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	2024-02-19
6	中信建投基金管理有限公司旗下部分基金 2023 年年度报告提示性公告	规定报刊	2024-03-29
7	中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金 2023 年年度报告	规定网站	2024-03-29
8	中信建投基金管理有限公司旗下全部基金 2024 年第 1 季度报告提示性公告	规定报刊	2024-04-22
9	中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	规定网站	2024-04-22
10	中信建投基金管理有限公司关于终止北京中期时代基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	规定网站、规定报刊	2024-04-30
11	关于中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金变更业绩比较基准并修订基金合同和托管协议的公告	规定网站、规定报刊	2024-06-07
12	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	规定网站	2024-06-07
13	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	2024-06-07
14	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	2024-06-13
15	中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金(A 类份额)基金产品资料概要更新	规定网站	2024-06-13

16	中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金(C类份额)基金产品资料概要更新	规定网站	2024-06-13
17	中信建投基金管理有限公司关于以通讯方式召开中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	规定网站、规定报刊	2024-07-18
18	中信建投基金管理有限公司关于以通讯方式召开中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	规定网站、规定报刊	2024-07-19
19	中信建投基金管理有限公司旗下部分基金 2024 年第 2 季度报告提示性公告	规定报刊	2024-07-19
20	中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金 2024 年第 2 季度报告	规定网站	2024-07-19
21	中信建投基金管理有限公司关于终止喜鹊财富基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	规定网站、规定报刊	2024-07-22
22	关于中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告	规定网站、规定报刊	2024-08-20
23	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分基金的销售机构由北京中植基金销售有限公司变更为华源证券股份有限公司的公告	规定网站、规定报刊	2024-08-20
24	中信建投基金管理有限公司旗下部分基金 2024 年中期报告提示性公告	规定报刊	2024-08-30
25	中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金 2024 年中期报告	规定网站	2024-08-30
26	中信建投基金管理有限公司旗下部分基金 2024 年第 3 季度报告提示性公告	规定报刊	2024-10-25
27	中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金 2024 年第 3 季度报告	规定网站	2024-10-25

28	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分证券投资基金改聘会计师事务所的公告	规定网站、规定报刊	2024-10-26
29	中信建投基金管理有限公司旗下部分基金在中国工商银行股份有限公司开通基金转换业务的公告	规定网站、规定报刊	2024-12-03
30	中信建投基金管理有限公司旗下部分基金在中国工商银行股份有限公司开通基金转换业务的公告	规定网站、规定报刊	2024-12-04
31	中信建投基金管理有限公司关于公司及子公司办公地址变更的公告	规定网站、规定报刊	2024-12-30
32	中信建投基金管理有限公司直销中心办公地址及传真号码变更的公告	规定网站、规定报刊	2024-12-30

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20240131-20240229	0.00	23,767,082.59	23,767,082.59	0.00	0.0000%
	2	20240126-20240130	0.00	7,874,901.56	7,874,901.56	0.00	0.0000%
	3	20240319-20241231	0.00	11,378,337.13	0.00	11,378,337.13	44.7430%
产品特有风险							
本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额 20%的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产，有可能对基金净值产生一定的影响，甚至可能引发基金的流动性风险。							

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，无影响投资者决策的其他重要信息。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金注册的文件；
- 2、《中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》；
- 3、《中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金托管协议》；
- 4、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照。

13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

13.3 查阅方式

投资者可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
二〇二五年三月三十一日