

# 中信建投远见回报混合型证券投资基金

## 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:交通银行股份有限公司

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。

基金托管人交通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

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>1</b>
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>4</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况</b>	<b>5</b>
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	9
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
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	11
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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>13</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
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	13
<b>§ 6 审计报告</b>	<b>13</b>
6.1 审计报告基本信息	13
6.2 审计报告的基本内容	13
<b>§ 7 年度财务报表</b>	<b>15</b>
7.1 资产负债表	15
7.2 利润表	17
7.3 净资产变动表	18
7.4 报表附注	19
<b>§ 8 投资组合报告</b>	<b>43</b>
8.1 期末基金资产组合情况	43
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	44
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	59
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	61
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	62
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	62

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 .....	62
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 .....	62
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	62
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	62
8.12 投资组合报告附注 .....	62
<b>§ 9 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>63</b>
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	63
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	64
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 .....	64
<b>§ 10 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>64</b>
<b>§ 11 重大事件揭示 .....</b>	<b>64</b>
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	65
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 .....	65
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	65
11.4 基金投资策略的改变 .....	65
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	65
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 .....	65
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	65
11.8 其他重大事件 .....	67
<b>§ 12 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>69</b>
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 .....	69
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	69
<b>§ 13 备查文件目录 .....</b>	<b>69</b>
13.1 备查文件目录 .....	69
13.2 存放地点 .....	69
13.3 查阅方式 .....	69

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中信建投远见回报混合型证券投资基金	
基金简称	中信建投远见回报	
基金主代码	011868	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 08 月 10 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	721,759,681.87 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中信建投远见回报 A	中信建投远见回报 C
下属分级基金的交易代码	011868	011869
报告期末下属分级基金的份额总额	591,767,974.58 份	129,991,707.29 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的基础上，通过积极主动的投资管理，力争为基金份额持有人获取超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金采用自上而下的策略，通过对宏观经济基本面（包括经济运行周期、财政及货币政策、产业政策等）的分析判断，和对流动性水平（包括资金面供需情况、证券市场估值水平等）的深入研究，分析股票市场、债券市场、货币市场三大类资产的预期风险和收益，并据此对本基金资产在股票、债券、现金之间的投资比例进行动态调整。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率 × 70% + 中证综合债指数收益率 × 30%
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。

### 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	方圆
	联系电话	010-59100208	95559
	电子邮箱	zhuweibj@csc.com.cn	fangy_20@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	中国（上海）自由贸易试验区银

	苑 3 号楼 1 室	城中路 188 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	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	证券时报
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	
	中信建投远见回报 A	中信建投远见回报 C	中信建投远见回报 A	中信建投远见回报 C	中信建投远见回报 A	中信建投远见回报 C
本期已实现收益	18,960,678.46	1,557,173.14	1,086,296.71	-325,926.32	-232,997,729.95	-55,414,653.54
本期利润	-32,955,076.40	-11,315,644.46	19,920,643.37	4,075,884.92	-243,795,829.32	-58,755,995.71
加权平均基金份额本期	-0.0497	-0.0700	0.0256	0.0234	-0.2707	-0.2813

利润						
本期 加权 平均 净值 利润 率	-6.84%	-9.78%	3.29%	3.03%	-35.35%	-36.85%
本期 基金 份额 净值 增长 率	-5.53%	-5.91%	3.04%	2.65%	-25.14%	-25.45%
<b>3.1. 2 期 末数 据和 指标</b>	2024 年末		2023 年末		2022 年末	
期末 可供 分配 利润	-158,158,886 .58	-36,028,508 .88	-193,347,737 .75	-45,457,751 .67	-210,943,080 .17	-47,740,568 .54
期末 可供 分配 基金 份额 利润	-0.2673	-0.2772	-0.2542	-0.2611	-0.2504	-0.2543
期末 基金 资产 净值	433,609,088. 00	93,963,198. 41	589,879,480. 13	133,759,219 .55	634,019,416. 13	140,504,791 .07
期末 基金 份额 净值	0.7327	0.7228	0.7756	0.7682	0.7527	0.7484
<b>3.1. 3 累 计期 末指 标</b>	2024 年末		2023 年末		2022 年末	
基金 份额 累计	-26.73%	-27.72%	-22.44%	-23.18%	-24.73%	-25.16%

净值增长率						
-------	--	--	--	--	--	--

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

##### 中信建投远见回报 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	0.52%	2.40%	-0.46%	1.21%	0.98%	1.19%
过去六个月	4.81%	2.35%	11.04%	1.15%	-6.23%	1.20%
过去一年	-5.53%	1.96%	13.14%	0.93%	-18.67%	1.03%
过去三年	-27.13%	1.56%	-9.67%	0.82%	-17.46%	0.74%
自基金合同生效起至今	-26.73%	1.49%	-9.75%	0.80%	-16.98%	0.69%

##### 中信建投远见回报 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	0.42%	2.40%	-0.46%	1.21%	0.88%	1.19%
过去六个月	4.59%	2.35%	11.04%	1.15%	-6.45%	1.20%
过去一年	-5.91%	1.96%	13.14%	0.93%	-19.05%	1.03%
过去三年	-28.00%	1.56%	-9.67%	0.82%	-18.33%	0.74%
自基金合同生效起至今	-27.72%	1.49%	-9.75%	0.80%	-17.97%	0.69%

#### 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

中信建投远见回报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

(2021年08月10日-2024年12月31日)



中信建投远见回报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

(2021年08月10日-2024年12月31日)



### 3.2.3 自基金合同生效以来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：基金合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 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		
谢玮	本基金的基金经理、权益投资二部行政负责人	2021-08-10	-	8 年	中国籍，1984 年 9 月生，中国社会科学院研究生院经济学博士。曾任中证金融研究院博士后，从事资本市场研究工作；2016 年 9 月加入中信建投基金管理有限公司，曾任投资研究部研究员、权益投资部总监，现任本公司权益投资二部行政负责人、基金经理，担任中信建投医改灵活配置混合型证券投资基金、中信建投医药健康混合型证券投资基金、中信建投远见回报混合型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

2024 年，全球经济在复杂多变的宏观环境中呈现结构性分化。国内方面，中国经济延续转型升级趋势，政策端以“稳增长、促创新”为核心，货币政策保持适度宽松，财政政策加大对科技创新、绿色经济及消费复苏的支持。海外市场方面，美联储加息周期结束，全球流动性边际改善，但地缘政治冲突、能源价格波动及部分经济体衰退风险仍对市场情绪造成扰动。A 股市场全年呈现“先抑后扬”走势，上半年受企业盈利增速放缓影响震荡调整，下半年在政策发力、产业升级及 AI 技术突破的驱动下显著反弹，结构性机会突出。我们的产品以“宏观驱动、逆向投资、行业比较、个股挖掘”为投资基石，自上而下与自下而上相结合，全市场全行业全赛道全时空梳理个股投资机会，滚动调整持仓组合，在匹配当下市场的风险程度的同时尽可能提升产品收益的概率，不设行业偏好不做走势判断，均衡布局动态调整，以不变的投资框架应万变的行情波动，无论市场强弱，做到知行合一。全年保持中高仓位运作，在市场情绪低迷期适度增配防御性资产，在反弹阶段聚焦高弹性赛道，通过仓位微调控制回撤。超配的 AI 算力产业链、新能源车零部件成为主要收益来源，精准捕捉全球 AI 算力投资浪潮及国产供应链崛起机遇。感谢持有人长期以来的坚持和陪伴，我们将继续稳健修复净值，力争在中长期为持有人带来超越同类产品的表现。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中信建投远见回报 A 基金份额净值为 0.7327 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-5.53%，同期业绩比较基准收益率为 13.14%；截至报告期末中信建投远见回报 C 基金份额净值为 0.7228 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-5.91%，同期业绩比较基准收益率为 13.14%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们预计 2025 年中国宏观经济总体保持平稳增长，美欧反而不确定性加大，降息路径扑朔迷离。新一轮科技革命已在路上，A 股有望出现显著的结构性情行。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术；建立了估值委员会，由公司分管运营领导任估值委员会主任，委员包括权益投资相关部门、固定收益部、多元资产配置部、研究部、特定资产管理部、稽控合规部、风险管理部、运营管理部门部门负责人。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

本基金本报告期末发生连续二十个工作日基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元的情形。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，基金托管人在中信建投远见回报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

本报告期内，中信建投基金管理有限公司在中信建投远见回报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、基金收益分配等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

#### 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

本报告期内，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远见回报混合型证券投资基金的年度报告中财务指标、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 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_A26 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	中信建投远见回报混合型证券投资基金全体基金份额持有人

<p>审计意见</p>	<p>我们审计了中信建投远见回报混合型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。</p> <p>我们认为，后附的中信建投远见回报混合型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远见回报混合型证券投资基金 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。</p>
<p>形成审计意见的基础</p>	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于中信建投远见回报混合型证券投资基金，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。</p>
<p>强调事项</p>	<p>无</p>
<p>其他事项</p>	<p>无</p>
<p>其他信息</p>	<p>中信建投远见回报混合型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估中信建投远见回报混合型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督中信建投远见回报混合型证券投资基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p>

	<p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对中信建投远见回报混合型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致中信建投远见回报混合型证券投资基金不能持续经营。</p> <p>(5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	王珊珊   朱燕
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街1号东方广场安永大楼17层01-12室
审计报告日期	2025-03-28

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：中信建投远见回报混合型证券投资基金

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
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	17,262,451.25	12,415,789.06
结算备付金		4,339,373.13	1,016,459.27
存出保证金		284,398.56	132,728.36

交易性金融资产	7.4.7.2	509,054,100.87	713,626,626.74
其中：股票投资		494,396,065.81	685,311,280.00
基金投资		-	-
债券投资		14,658,035.06	28,315,346.74
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		-	5,794,471.79
应收股利		-	-
应收申购款		10,664.13	15,034.17
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		530,950,987.94	733,001,109.39
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024 年 12 月 31 日</b>	<b>上年度末 2023 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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		600,686.96	4,672,366.41
应付赎回款		1,004,169.95	3,020,091.92
应付管理人报酬		577,135.61	705,147.78
应付托管费		96,189.27	117,524.62
应付销售服务费		34,412.69	42,772.29
应付投资顾问费		-	-
应交税费		303.38	1.31
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	1,065,803.67	804,505.38
负债合计		3,378,701.53	9,362,409.71
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.7	721,759,681.87	934,627,792.73
未分配利润	7.4.7.8	-194,187,395.46	-210,989,093.05
净资产合计		527,572,286.41	723,638,699.68
负债和净资产总计		530,950,987.94	733,001,109.39

注：报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额总额 721,759,681.87 份，其中中信建投远见回报 A 类基金份额净值 0.7327 元，基金份额 591,767,974.58 份；中信建投远见回报 C 类基金份额净值 0.7228 元，基金份额 129,991,707.29 份。

## 7.2 利润表

会计主体：中信建投远见回报混合型证券投资基金

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
<b>一、营业总收入</b>		-35,276,159.10	36,988,101.99
1. 利息收入		144,871.39	154,210.82
其中：存款利息收入	7.4.7.9	144,871.39	154,210.82
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		29,209,966.49	13,579,093.91
其中：股票投资收益	7.4.7.10	19,245,087.64	-6,721,671.68
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	665,246.43	-365,642.40
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.13	-	-
股利收益	7.4.7.14	9,299,632.42	20,666,407.99
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	-64,788,572.46	23,236,157.90
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	157,575.48	18,639.36
<b>减：二、营业总支出</b>		8,994,561.76	12,991,573.70
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	7,167,161.39	10,424,892.85
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,194,526.93	1,737,482.14
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	462,502.23	539,411.58
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	104,679.67
其中：卖出回购金融资产支出		-	104,679.67
6. 信用减值损失	7.4.7.17	-	-
7. 税金及附加		28.83	9.52
8. 其他费用	7.4.7.18	170,342.38	185,097.94
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-44,270,720.86	23,996,528.29
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-44,270,720.86	23,996,528.29
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-

六、综合收益总额		-44,270,720.86	23,996,528.29
----------	--	----------------	---------------

### 7.3 净资产变动表

会计主体：中信建投远见回报混合型证券投资基金

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	934,627,792.73	-210,989,093.05	723,638,699.68
二、本期期初净资产	934,627,792.73	-210,989,093.05	723,638,699.68
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-212,868,110.86	16,801,697.59	-196,066,413.27
(一)、综合收益总额	-	-44,270,720.86	-44,270,720.86
(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)	-212,868,110.86	61,072,418.45	-151,795,692.41
其中：1. 基金申购款	44,603,957.38	-11,117,526.97	33,486,430.41
2. 基金赎回款	-257,472,068.24	72,189,945.42	-185,282,122.82
(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	721,759,681.87	-194,187,395.46	527,572,286.41
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	1,030,107,059.41	-255,582,852.21	774,524,207.20
二、本期期初净资产	1,030,107,059.41	-255,582,852.21	774,524,207.20
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-95,479,266.68	44,593,759.16	-50,885,507.52
(一)、综合收益总额	-	23,996,528.29	23,996,528.29
(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)	-95,479,266.68	20,597,230.87	-74,882,035.81
其中：1. 基金申购款	93,906,446.95	-21,471,259.46	72,435,187.49
2. 基金赎回款	-189,385,713.63	42,068,490.33	-147,317,223.30
(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	934,627,792.73	-210,989,093.05	723,638,699.68

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

中信建投远见回报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（2021）695号《关于准予中信建投远见回报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《中信建投远见回报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，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币1,577,752,906.81元，业经普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）普华永道中天验字（2021）第0782号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《中信建投远见回报混合型证券投资基金基金合同》于2021年8月10日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为1,578,306,132.97份基金份额，其中认购资金利息折合553,226.16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《中信建投远见回报混合型证券投资基金招募说明书》，本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用的基金份额，称为A类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额，称为C类基金份额。本基金A类、C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

本基金主要投资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（包含主板、中小板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票、存托凭证）、债券（包括国内依法发行和上市交易的国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、公开发行的次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券等）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、货币市场工具、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需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，并可依据届时有效的法律法规适时合理地调整投资范围。本基金的投资组合比例为：股票（含存托凭证）资产占基金资产的60%-95%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约和国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或者到期日在一年以内的政府债券。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率×70%+中证综合债指数收益率×30%。

### 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）交易印花税税率，由原先的 3% 调整为 1%，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

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

#### (2) 增值税

根据财政部、国家税务总局财税〔2016〕36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》

的规定，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

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

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

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

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

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，以利息及利息性质的收入为销售额；

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	17,262,451.25	12,415,789.06
等于：本金	17,260,551.96	12,413,063.51
加：应计利息	1,899.29	2,725.55
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	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计	17,262,451.25	12,415,789.06

##### 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	539,306,997.75	-	494,396,065.81	-44,910,931.94	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	14,395,214.37	166,123.08	14,658,035.06	96,697.61
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	14,395,214.37	166,123.08	14,658,035.06	96,697.61
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	553,702,212.12	166,123.08	509,054,100.87	-44,814,234.33	

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	665,370,740.87	-	685,311,280.00	19,940,539.13	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	27,985,351.00	296,196.74	28,315,346.74	33,799.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	27,985,351.00	296,196.74	28,315,346.74	33,799.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	693,356,091.87	296,196.74	713,626,626.74	19,974,338.13	

#### 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	-	-
应付赎回费	-	9.76
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	900,803.67	624,495.62
其中：交易所市场	900,803.67	624,495.62
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	165,000.00	180,000.00
合计	1,065,803.67	804,505.38

7.4.7.7 实收基金

中信建投远见回报 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	760,512,797.16	760,512,797.16
本期申购	19,236,053.61	19,236,053.61
本期赎回（以“-”号填列）	-187,980,876.19	-187,980,876.19
本期末	591,767,974.58	591,767,974.58

中信建投远见回报 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	174,114,995.57	174,114,995.57
本期申购	25,367,903.77	25,367,903.77
本期赎回（以“-”号填列）	-69,491,192.05	-69,491,192.05
本期末	129,991,707.29	129,991,707.29

7.4.7.8 未分配利润

中信建投远见回报 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	-193,347,737.75	22,714,420.72	-170,633,317.03
本期期初	-193,347,737.75	22,714,420.72	-170,633,317.03
本期利润	18,960,678.46	-51,915,754.86	-32,955,076.40
本期基金份额交易产生的变动数	45,992,909.63	-563,402.78	45,429,506.85
其中：基金申购款	-5,449,230.72	605,129.35	-4,844,101.37
基金赎回款	51,442,140.35	-1,168,532.13	50,273,608.22
本期已分配利润	-	-	-

本期末	-128,394,149.66	-29,764,736.92	-158,158,886.58
-----	-----------------	----------------	-----------------

中信建投远见回报 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	-45,457,751.67	5,101,975.65	-40,355,776.02
本期期初	-45,457,751.67	5,101,975.65	-40,355,776.02
本期利润	1,557,173.14	-12,872,817.60	-11,315,644.46
本期基金份额交易产生的变动数	14,355,988.23	1,286,923.37	15,642,911.60
其中：基金申购款	-7,137,320.22	863,894.62	-6,273,425.60
基金赎回款	21,493,308.45	423,028.75	21,916,337.20
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-29,544,590.30	-6,483,918.58	-36,028,508.88

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 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
活期存款利息收入	120,585.42	127,681.57
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	21,554.81	24,098.75
其他	2,731.16	2,430.50
合计	144,871.39	154,210.82

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	2,351,539,118.24	2,463,707,158.40

减：卖出股票成本总额	2,328,621,895.81	2,465,463,992.72
减：交易费用	3,672,134.79	4,964,837.36
买卖股票差价收入	19,245,087.64	-6,721,671.68

#### 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	307,237.76	492,323.78
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	358,008.67	-857,966.18
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	665,246.43	-365,642.40

##### 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	38,223,623.25	79,678,902.38
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	37,286,966.48	79,331,562.87
减：应计利息总额	578,312.61	1,204,756.20
减：交易费用	335.49	549.49
买卖债券差价收入	358,008.67	-857,966.18

#### 7.4.7.12 资产支持证券投资收益

无。

#### 7.4.7.13 衍生工具收益

无。

#### 7.4.7.14 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	9,299,632.42	20,666,407.99
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	9,299,632.42	20,666,407.99

#### 7.4.7.15 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	-64,788,572.46	23,236,157.90
——股票投资	-64,851,471.07	21,755,164.03
——债券投资	62,898.61	1,480,993.87
——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	-64,788,572.46	23,236,157.90

#### 7.4.7.16 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	157,575.48	18,631.40
转换费收入	-	7.96
合计	157,575.48	18,639.36

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%。

#### 7.4.7.17 信用减值损失

无。

#### 7.4.7.18 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	45,000.00	60,000.00

信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	0
汇划手续费	5,342.38	5,097.94
合计	170,342.38	185,097.94

#### 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
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	1,337,444,034.42	29.37%	3,163,126,578.10	65.12%

###### 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
-------	--	---

	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	19,311,451.00	50.96%	63,658,776.95	68.43%

#### 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	-	-	47,500,000.00	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	644,598.56	29.37%	261,701.72	29.05%
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	1,697,556.20	65.10%	271,822.62	43.53%

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	7,167,161.39	10,424,892.85
其中：应支付销售机构的客户维护费	3,473,873.42	5,128,376.72
应支付基金管理人的净管理费	3,693,287.97	5,296,516.13

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	1,194,526.93	1,737,482.14

注：1、自 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 8 月 27 日，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 0.25%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。

#### 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		
	中信建投远见回报 A	中信建投远见回报 C	合计
交通银行股份有限公司	-	7,307.36	7,307.36
中信建投基金管理有限公司	-	146.90	146.90
中信建投期货有限公司	-	40.73	40.73
中信建投证券股份有限公司	-	382,432.63	382,432.63
合计	-	389,927.62	389,927.62

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		
	中信建投远见回报 A	中信建投远见回报 C	合计
中信建投基金管理有限公司	-	158.69	158.69
中信建投证券股份有限公司	-	490,472.30	490,472.30
中信建投期货有限公司	-	56.94	56.94
交通银行股份有限公司	-	8,023.27	8,023.27
合计	-	498,711.20	498,711.20

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 0.40% 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 × 0.40% / 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

无。

##### 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

无。

#### 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
交通银行股份有限公司	17,262,451.25	120,585.42	12,415,789.06	127,681.57

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。

#### 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

无。

#### 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
000421	南京公用	2024-12-27	重大事项	6.48	2025-01-13	7.13	71,600	475,319.33	463,968.00	-

##### 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并与各部门合作完成运作风险管理。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性和定量相结合的分析方法去

评估各种风险发生的可能性及其发生可能给基金资产造成的损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制可在可承受的范围之内。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，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	1,990,423.28	550,040.99
未评级	-	-
合计	1,990,423.28	550,040.99

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同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（净资产）无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

##### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期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	17,262,451.25	-	-	-	17,262,451.25
结算备付金	4,339,373.13	-	-	-	4,339,373.13
存出保证金	284,398.56	-	-	-	284,398.56
交易性金融资产	12,667,611.78	1,990,423.28	-	494,396,065.81	509,054,100.87
应收申购款	-	-	-	10,664.13	10,664.13
资产总计	34,553,834.72	1,990,423.28	-	494,406,729.94	530,950,987.94
负债					
应付清算款	-	-	-	600,686.96	600,686.96
应付赎回款	-	-	-	1,004,169.95	1,004,169.95
应付管理人报酬	-	-	-	577,135.61	577,135.61
应付托管费	-	-	-	96,189.27	96,189.27
应付销售服务费	-	-	-	34,412.69	34,412.69
应交税费	-	-	-	303.38	303.38
其他负债	-	-	-	1,065,803.67	1,065,803.67
负债总计	-	-	-	3,378,701.53	3,378,701.53
利率敏感度缺口	34,553,834.72	1,990,423.28	-	491,028,028.41	527,572,286.41
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	12,415,789.06	-	-	-	12,415,789.06
结算备付金	1,016,459.27	-	-	-	1,016,459.27
存出保证金	132,728.36	-	-	-	132,728.36
交易性金融资产	27,765,305.75	-	550,040.99	685,311,280.00	713,626,626.74
应收清算款	-	-	-	5,794,471.79	5,794,471.79
应收申购款	-	-	-	15,034.17	15,034.17
资产总计	41,330,282.44	-	550,040.99	691,120,785.96	733,001,109.39

负债					
应付清算款	-	-	-	4,672,366.41	4,672,366.41
应付赎回款	-	-	-	3,020,091.92	3,020,091.92
应付管理人报酬	-	-	-	705,147.78	705,147.78
应付托管费	-	-	-	117,524.62	117,524.62
应付销售服务费	-	-	-	42,772.29	42,772.29
应交税费	-	-	-	1.31	1.31
其他负债	-	-	-	804,505.38	804,505.38
负债总计	-	-	-	9,362,409.71	9,362,409.71
利率敏感度缺口	41,330,282.44	-	550,040.99	681,758,376.25	723,638,699.68

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	494,396,065.81	93.71	685,311,280.00	94.70

交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	1,990,423.28	0.38	550,040.99	0.08
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	496,386,489.09	94.09	685,861,320.99	94.78

#### 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%	45,755,644.65	37,606,025.76
	业绩比较基准下降 5%	-45,755,644.65	-37,606,025.76

#### 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	495,922,521.09	685,311,280.00
第二层次	13,131,579.78	28,315,346.74
第三层次	-	-
合计	509,054,100.87	713,626,626.74

###### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-
项目	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	695,870.68	695,870.68
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	787,495.52	787,495.52
当期利得或损失总额	-	91,624.84	91,624.84
其中：计入损益的利得或损失	-	91,624.84	91,624.84
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-

注：本报告期不涉及第三层次的交易性金融资产。

于 2023 年度，本基金从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资。计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

#### 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	494,396,065.81	93.12
	其中：股票	494,396,065.81	93.12
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	14,658,035.06	2.76
	其中：债券	14,658,035.06	2.76
	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	21,601,824.38	4.07
8	其他各项资产	295,062.69	0.06
9	合计	530,950,987.94	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	10,307,631.46	1.95
B	采矿业	33,635,666.00	6.38
C	制造业	309,683,020.01	58.70
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	15,397,148.64	2.92
E	建筑业	1,256,525.72	0.24
F	批发和零售业	9,451,837.42	1.79
G	交通运输、仓储和邮政业	17,642,785.50	3.34
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	34,983,154.79	6.63
J	金融业	40,247,248.00	7.63
K	房地产业	340,646.00	0.06
L	租赁和商务服务业	439,570.17	0.08
M	科学研究和技术服务业	14,585,805.91	2.76
N	水利、环境和公共设施管理业	1,042,491.19	0.20
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,169,084.00	0.41
R	文化、体育和娱乐业	3,213,451.00	0.61
S	综合	-	-
	合计	494,396,065.81	93.71

### 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	300436	广生堂	280,000	9,147,600.00	1.73
2	002432	九安医疗	200,000	8,156,000.00	1.55
3	600760	中航沈飞	125,800	6,380,576.00	1.21
4	688351	微电生理	330,000	6,283,200.00	1.19
5	603259	药明康德	108,100	5,949,824.00	1.13
6	688192	迪哲医药	128,400	5,324,748.00	1.01
7	600893	航发动力	125,700	5,210,265.00	0.99
8	300750	宁德时代	19,300	5,133,800.00	0.97
9	601398	工商银行	732,200	5,066,824.00	0.96
10	601728	中国电信	675,000	4,873,500.00	0.92

11	601229	上海银行	523,100	4,786,365.00	0.91
12	601988	中国银行	836,300	4,608,013.00	0.87
13	601939	建设银行	522,900	4,596,291.00	0.87
14	601288	农业银行	836,800	4,468,512.00	0.85
15	300633	开立医疗	143,300	4,211,587.00	0.80
16	300759	康龙化成	161,700	4,155,690.00	0.79
17	600036	招商银行	104,900	4,122,570.00	0.78
18	600282	南钢股份	878,000	4,117,820.00	0.78
19	688266	泽璟制药	66,000	4,112,460.00	0.78
20	002821	凯莱英	53,800	4,093,642.00	0.78
21	601899	紫金矿业	265,700	4,017,384.00	0.76
22	601816	京沪高铁	627,800	3,867,248.00	0.73
23	601838	成都银行	209,400	3,582,834.00	0.68
24	688072	拓荆科技	22,185	3,409,168.95	0.65
25	688608	恒玄科技	9,600	3,123,552.00	0.59
26	601699	潞安环能	209,400	3,006,984.00	0.57
27	688443	智翔金泰	119,400	2,995,746.00	0.57
28	600900	长江电力	99,700	2,946,135.00	0.56
29	000001	平安银行	251,300	2,940,210.00	0.56
30	002299	圣农发展	200,000	2,896,000.00	0.55
31	002458	益生股份	300,000	2,883,000.00	0.55
32	601006	大秦铁路	418,500	2,837,430.00	0.54
33	000099	中信海直	104,900	2,765,164.00	0.52
34	603214	爱婴室	121,600	2,743,296.00	0.52
35	688197	首药控股	88,400	2,637,856.00	0.50
36	000937	冀中能源	417,100	2,636,072.00	0.50
37	002237	恒邦股份	258,900	2,614,890.00	0.50
38	601666	平煤股份	251,100	2,516,022.00	0.48
39	603456	九洲药业	178,500	2,441,880.00	0.46
40	601069	西部黄金	211,000	2,415,950.00	0.46
41	600188	兖矿能源	167,900	2,379,143.00	0.45
42	600988	赤峰黄金	152,200	2,375,842.00	0.45
43	600971	恒源煤电	250,000	2,352,500.00	0.45
44	600547	山东黄金	103,200	2,335,416.00	0.44
45	300363	博腾股份	147,900	2,332,383.00	0.44
46	600941	中国移动	19,300	2,280,488.00	0.43
47	600997	开滦股份	333,400	2,253,784.00	0.43
48	600050	中国联通	418,700	2,223,297.00	0.42
49	002155	湖南黄金	139,800	2,199,054.00	0.42
50	000932	华菱钢铁	501,900	2,097,942.00	0.40
51	300703	创源股份	145,700	2,079,139.00	0.39
52	601111	中国国航	261,800	2,070,838.00	0.39
53	600546	山煤国际	167,900	1,986,257.00	0.38

54	002050	三花智控	79,100	1,859,641.00	0.35
55	688212	澳华内镜	45,400	1,824,172.00	0.35
56	601689	拓普集团	36,900	1,808,100.00	0.34
57	603758	秦安股份	218,500	1,804,810.00	0.34
58	603127	昭衍新药	107,800	1,792,714.00	0.34
59	003021	兆威机电	24,200	1,788,622.00	0.34
60	000768	中航西飞	63,200	1,784,768.00	0.34
61	002329	皇氏集团	490,400	1,780,152.00	0.34
62	688234	天岳先进	34,000	1,740,800.00	0.33
63	600029	南方航空	261,800	1,699,082.00	0.32
64	688089	嘉必优	83,637	1,591,612.11	0.30
65	600489	中金黄金	127,500	1,533,825.00	0.29
66	001965	招商公路	99,500	1,388,025.00	0.26
67	600774	汉商集团	184,900	1,384,901.00	0.26
68	300235	方直科技	128,400	1,384,152.00	0.26
69	688319	欧林生物	129,487	1,372,562.20	0.26
70	002594	比亚迪	4,800	1,356,768.00	0.26
71	300658	延江股份	261,900	1,356,642.00	0.26
72	601168	西部矿业	84,100	1,351,487.00	0.26
73	600990	四创电子	63,200	1,344,896.00	0.25
74	300106	西部牧业	152,000	1,334,560.00	0.25
75	688256	寒武纪	2,000	1,316,000.00	0.25
76	600703	三安光电	104,900	1,276,633.00	0.24
77	600115	中国东航	314,000	1,256,000.00	0.24
78	688165	埃夫特	46,981	1,240,298.40	0.24
79	002762	金发拉比	210,300	1,219,740.00	0.23
80	300788	中信出版	38,000	1,199,660.00	0.23
81	600419	天润乳业	127,800	1,189,818.00	0.23
82	002389	航天彩虹	63,200	1,140,760.00	0.22
83	601857	中国石油	125,900	1,125,546.00	0.21
84	872190	雷神科技	38,241	1,113,577.92	0.21
85	300059	东方财富	42,400	1,094,768.00	0.21
86	300456	赛微电子	63,200	1,085,776.00	0.21
87	600909	华安证券	178,200	1,079,892.00	0.20
88	688085	三友医疗	50,000	1,059,500.00	0.20
89	002925	盈趣科技	66,700	1,044,522.00	0.20
90	000995	皇台酒业	63,200	1,042,800.00	0.20
91	605177	东亚药业	50,900	1,002,730.00	0.19
92	002865	钧达股份	19,300	986,230.00	0.19
93	600969	郴电国际	152,100	978,003.00	0.19
94	605507	国邦医药	46,800	974,844.00	0.18
95	600979	广安爱众	209,100	966,042.00	0.18
96	833914	远航精密	58,937	944,170.74	0.18

97	000988	华工科技	21,000	909,300.00	0.17
98	300254	仟源医药	103,000	901,250.00	0.17
99	600111	北方稀土	42,400	899,728.00	0.17
100	000831	中国稀土	32,000	897,600.00	0.17
101	300233	金城医药	74,000	888,000.00	0.17
102	000970	中科三环	84,100	872,117.00	0.17
103	300007	汉威科技	42,400	867,080.00	0.16
104	688190	云路股份	9,400	864,800.00	0.16
105	600392	盛和资源	84,100	864,548.00	0.16
106	002292	奥飞娱乐	99,700	862,405.00	0.16
107	688626	翔宇医疗	29,284	860,656.76	0.16
108	837403	康农种业	39,907	857,202.36	0.16
109	600775	南京熊猫	85,300	856,412.00	0.16
110	300884	狄耐克	76,300	853,034.00	0.16
111	831010	凯添燃气	96,444	849,671.64	0.16
112	301293	三博脑科	19,600	848,288.00	0.16
113	430556	雅达股份	110,794	845,358.22	0.16
114	831689	克莱特	43,740	844,182.00	0.16
115	600616	金枫酒业	146,300	833,910.00	0.16
116	834058	华洋赛车	31,416	824,355.84	0.16
117	601990	南京证券	94,600	819,236.00	0.16
118	300497	富祥药业	97,800	815,652.00	0.15
119	600694	大商股份	30,900	814,833.00	0.15
120	000987	越秀资本	115,500	810,810.00	0.15
121	300086	康芝药业	163,000	798,700.00	0.15
122	300430	诚益通	51,800	792,540.00	0.15
123	301207	华兰疫苗	45,200	791,452.00	0.15
124	833171	国航远洋	129,592	784,031.60	0.15
125	002350	北京科锐	102,900	782,040.00	0.15
126	688185	康希诺	12,800	781,440.00	0.15
127	600372	中航机载	63,200	779,256.00	0.15
128	836942	恒立钻具	56,486	778,941.94	0.15
129	836699	海达尔	20,339	776,949.80	0.15
130	688255	凯尔达	29,079	776,700.09	0.15
131	833523	德瑞锂电	38,589	771,394.11	0.15
132	837006	晟楠科技	31,237	768,430.20	0.15
133	600887	伊利股份	25,200	760,536.00	0.14
134	830974	凯大催化	109,998	760,086.18	0.14
135	002195	岩山科技	189,700	753,109.00	0.14
136	688253	英诺特	20,600	746,956.00	0.14
137	002114	罗平锌电	132,200	745,608.00	0.14
138	839790	联迪信息	21,862	745,494.20	0.14
139	000563	陕国投A	209,400	745,464.00	0.14

140	834062	科润智控	97,293	745,264.38	0.14
141	830799	艾融软件	14,448	745,083.36	0.14
142	002371	北方华创	1,900	742,900.00	0.14
143	873806	云星宇	57,771	737,157.96	0.14
144	600982	宁波能源	178,700	736,244.00	0.14
145	837046	亿能电力	48,739	735,958.90	0.14
146	300024	机器人	40,800	732,360.00	0.14
147	688276	百克生物	29,000	728,190.00	0.14
148	300314	戴维医疗	64,000	720,640.00	0.14
149	688670	金迪克	59,400	719,928.00	0.14
150	831305	海希通讯	51,931	719,244.35	0.14
151	688012	中微公司	3,800	718,808.00	0.14
152	002428	云南锗业	38,000	718,200.00	0.14
153	688552	航天南湖	43,000	718,100.00	0.14
154	002173	创新医疗	90,100	717,196.00	0.14
155	000933	神火股份	42,400	716,560.00	0.14
156	301118	恒光股份	38,900	716,149.00	0.14
157	000417	合百集团	111,800	713,284.00	0.14
158	430139	华岭股份	29,485	712,947.30	0.14
159	002182	宝武镁业	63,200	712,896.00	0.14
160	870866	绿亨科技	98,620	712,036.40	0.13
161	834415	恒拓开源	46,896	711,412.32	0.13
162	002736	国信证券	63,200	707,840.00	0.13
163	600780	通宝能源	125,700	707,691.00	0.13
164	831195	三祥科技	64,451	707,671.98	0.13
165	600560	金自天正	48,300	707,112.00	0.13
166	830832	齐鲁华信	120,000	706,800.00	0.13
167	601136	首创证券	32,000	704,000.00	0.13
168	601607	上海医药	33,500	703,500.00	0.13
169	831445	龙竹科技	94,100	702,927.00	0.13
170	000426	兴业银锡	63,200	702,784.00	0.13
171	600028	中国石化	105,000	701,400.00	0.13
172	600858	银座股份	126,300	700,965.00	0.13
173	832522	纳科诺尔	13,857	700,055.64	0.13
174	600855	航天长峰	54,200	698,096.00	0.13
175	837663	明阳科技	48,281	696,212.02	0.13
176	831167	鑫汇科	34,795	695,204.10	0.13
177	832171	志晟信息	33,379	694,616.99	0.13
178	870357	雅葆轩	37,025	694,218.75	0.13
179	688408	中信博	9,600	691,200.00	0.13
180	600316	洪都航空	21,500	690,580.00	0.13
181	839371	欧福蛋业	100,267	689,836.96	0.13
182	872953	国子软件	23,534	689,546.20	0.13

183	688095	福昕软件	10,200	685,032.00	0.13
184	839167	同享科技	35,723	684,095.45	0.13
185	300747	锐科激光	35,700	684,012.00	0.13
186	834475	三友科技	42,372	683,036.64	0.13
187	831175	派诺科技	36,640	678,572.80	0.13
188	605117	德业股份	8,000	678,400.00	0.13
189	301246	宏源药业	50,100	677,853.00	0.13
190	838163	方大新材	48,352	676,444.48	0.13
191	836807	奔朗新材	85,733	676,433.37	0.13
192	300866	安克创新	6,900	673,716.00	0.13
193	871857	泓禧科技	47,509	672,727.44	0.13
194	600527	江南高纤	304,200	672,282.00	0.13
195	600827	百联股份	61,400	671,102.00	0.13
196	836720	吉冈精密	43,575	671,055.00	0.13
197	835207	众诚科技	37,523	670,911.24	0.13
198	832662	方盛股份	33,470	669,400.00	0.13
199	430425	乐创技术	36,531	669,247.92	0.13
200	300455	航天智装	51,500	667,440.00	0.13
201	300489	光智科技	12,200	667,096.00	0.13
202	871970	大禹生物	118,647	666,796.14	0.13
203	837821	则成电子	20,771	666,541.39	0.13
204	832023	田野股份	149,510	665,319.50	0.13
205	838262	太湖雪	26,620	662,039.40	0.13
206	688539	高华科技	26,008	660,863.28	0.13
207	430564	天润科技	45,657	657,460.80	0.12
208	833819	颖泰生物	184,807	656,064.85	0.12
209	836414	欧普泰	60,017	654,785.47	0.12
210	831396	许昌智能	69,571	653,967.40	0.12
211	688207	格灵深瞳	45,908	653,729.92	0.12
212	833394	民士达	33,560	651,064.00	0.12
213	839946	华阳变速	102,503	650,894.05	0.12
214	600808	马钢股份	209,600	647,664.00	0.12
215	300466	赛摩智能	86,600	645,170.00	0.12
216	300014	亿纬锂能	13,800	645,012.00	0.12
217	835185	贝特瑞	32,831	643,815.91	0.12
218	600592	龙溪股份	65,000	642,200.00	0.12
219	430476	海能技术	66,031	640,500.70	0.12
220	601985	中国核电	61,300	639,359.00	0.12
221	839493	并行科技	8,994	636,865.14	0.12
222	002156	通富微电	21,500	635,325.00	0.12
223	836547	无锡晶海	40,597	634,937.08	0.12
224	603278	大业股份	83,600	634,524.00	0.12
225	301517	陕西华达	11,700	632,151.00	0.12

226	872931	无锡鼎邦	59,467	631,539.54	0.12
227	873152	天宏锂电	42,179	630,576.05	0.12
228	430718	合肥高科	50,545	629,790.70	0.12
229	430478	哈一药业	37,530	629,378.10	0.12
230	002297	博云新材	91,200	627,456.00	0.12
231	836433	大唐药业	102,487	626,195.57	0.12
232	831641	格利尔	51,248	624,713.12	0.12
233	838924	广脉科技	41,393	623,378.58	0.12
234	837023	芭薇股份	44,137	623,214.44	0.12
235	688682	霍莱沃	17,886	622,432.80	0.12
236	301087	可孚医疗	17,600	622,336.00	0.12
237	830964	润农节水	88,586	621,873.72	0.12
238	838275	驱动力	95,714	621,183.86	0.12
239	688636	智明达	22,082	620,504.20	0.12
240	833230	欧康医药	44,371	620,306.58	0.12
241	871694	中裕科技	41,602	619,037.76	0.12
242	870436	大地电气	36,801	618,992.82	0.12
243	688593	新相微	33,800	618,540.00	0.12
244	300763	锦浪科技	10,100	616,807.00	0.12
245	831370	新安洁	180,723	616,265.43	0.12
246	002840	华统股份	48,800	615,368.00	0.12
247	688041	海光信息	4,100	614,139.00	0.12
248	300274	阳光电源	8,300	612,789.00	0.12
249	839273	一致魔芋	29,231	612,097.14	0.12
250	832089	禾昌聚合	53,965	608,185.55	0.12
251	873167	新赣江	43,157	607,218.99	0.12
252	600882	妙可蓝多	33,900	606,810.00	0.12
253	300711	广哈通信	26,200	606,530.00	0.11
254	003816	中国广核	146,700	605,871.00	0.11
255	300827	上能电气	13,800	605,820.00	0.11
256	000531	穗恒运A	104,900	604,224.00	0.11
257	601949	中国出版	84,100	603,838.00	0.11
258	301103	何氏眼科	30,000	603,600.00	0.11
259	603398	沐邦高科	26,200	602,862.00	0.11
260	002916	深南电路	4,800	600,000.00	0.11
261	688390	固德威	14,648	599,103.20	0.11
262	300006	莱美药业	163,300	597,678.00	0.11
263	832419	路斯股份	40,836	596,205.60	0.11
264	871642	通易航天	51,305	593,598.85	0.11
265	833346	威贸电子	25,505	592,736.20	0.11
266	872374	云里物里	23,495	591,604.10	0.11
267	002100	天康生物	90,200	590,810.00	0.11
268	600098	广州发展	91,400	586,788.00	0.11

269	600702	舍得酒业	8,900	586,777.00	0.11
270	002343	慈文传媒	94,600	586,520.00	0.11
271	600975	新五丰	94,600	586,520.00	0.11
272	688063	派能科技	14,644	586,492.20	0.11
273	873132	泰鹏智能	48,039	586,075.80	0.11
274	603193	润本股份	25,000	583,750.00	0.11
275	600056	中国医药	52,500	582,750.00	0.11
276	688606	奥泰生物	9,196	582,106.80	0.11
277	002567	唐人神	113,800	580,380.00	0.11
278	301383	天键股份	11,000	579,150.00	0.11
279	833781	瑞奇智造	72,462	578,971.38	0.11
280	603806	福斯特	39,100	578,680.00	0.11
281	000600	建投能源	102,100	577,886.00	0.11
282	873223	荣亿精密	60,169	577,622.40	0.11
283	835640	富士达	21,134	576,112.84	0.11
284	688472	阿特斯	45,839	575,737.84	0.11
285	835305	云创数据	28,313	575,037.03	0.11
286	601012	隆基绿能	36,500	573,415.00	0.11
287	002511	中顺洁柔	84,000	572,040.00	0.11
288	300438	鹏辉能源	20,300	570,633.00	0.11
289	002129	TCL 中环	64,300	570,341.00	0.11
290	600597	光明乳业	66,700	569,618.00	0.11
291	833943	优机股份	34,675	568,670.00	0.11
292	300498	温氏股份	34,300	566,293.00	0.11
293	300761	立华股份	29,100	566,286.00	0.11
294	603689	皖天然气	63,000	565,740.00	0.11
295	002714	牧原股份	14,700	565,068.00	0.11
296	300068	南都电源	35,000	564,900.00	0.11
297	837174	宏裕包材	49,229	564,164.34	0.11
298	688237	超卓航科	24,889	561,744.73	0.11
299	605296	神农集团	20,200	559,540.00	0.11
300	835184	国源科技	51,783	559,256.40	0.11
301	835985	海泰新能	55,860	558,600.00	0.11
302	837344	三元基因	31,308	556,969.32	0.11
303	833455	汇隆活塞	79,587	556,313.13	0.11
304	600101	明星电力	63,200	556,160.00	0.11
305	831961	创远信科	37,516	555,987.12	0.11
306	603477	巨星农牧	31,300	555,575.00	0.11
307	833580	科创新材	58,262	555,236.86	0.11
308	002241	歌尔股份	21,500	554,915.00	0.11
309	873576	天力复合	26,596	552,132.96	0.10
310	000899	赣能股份	63,200	550,472.00	0.10
311	688223	晶科能源	77,007	547,519.77	0.10

312	300601	康泰生物	31,900	547,085.00	0.10
313	834770	艾能聚	34,845	545,324.25	0.10
314	688183	生益电子	13,889	545,282.14	0.10
315	600511	国药股份	15,900	544,098.00	0.10
316	430418	苏轴股份	23,721	542,262.06	0.10
317	600438	通威股份	24,500	541,695.00	0.10
318	836149	旭杰科技	47,058	541,637.58	0.10
319	833751	惠同新材	44,497	540,638.55	0.10
320	002459	晶澳科技	39,300	540,375.00	0.10
321	831856	浩淼科技	64,084	537,664.76	0.10
322	833873	中设咨询	121,275	536,035.50	0.10
323	688515	裕太微	5,400	534,600.00	0.10
324	688599	天合光能	27,647	533,587.10	0.10
325	832566	梓潼宫	58,233	532,831.95	0.10
326	688298	东方生物	18,121	531,488.93	0.10
327	300679	电连技术	8,900	531,330.00	0.10
328	301030	仕净科技	22,000	531,080.00	0.10
329	870204	沪江材料	30,387	529,949.28	0.10
330	873833	美心翼申	46,460	529,644.00	0.10
331	688019	安集科技	3,800	529,568.00	0.10
332	832491	奥迪威	24,598	528,857.00	0.10
333	603893	瑞芯微	4,800	528,288.00	0.10
334	688317	之江生物	32,340	525,525.00	0.10
335	836221	易实精密	35,559	525,206.43	0.10
336	831855	浙江大农	31,431	524,897.70	0.10
337	601865	福莱特	26,600	523,754.00	0.10
338	836419	万德股份	54,271	523,715.15	0.10
339	837748	路桥信息	26,822	523,565.44	0.10
340	831627	力王股份	27,199	522,764.78	0.10
341	838227	美登科技	10,737	521,281.35	0.10
342	300142	沃森生物	43,100	520,648.00	0.10
343	836717	瑞星股份	61,248	519,383.04	0.10
344	600183	生益科技	21,500	517,075.00	0.10
345	873706	铁拓机械	41,945	515,084.60	0.10
346	300857	协创数据	4,800	513,072.00	0.10
347	603871	嘉友国际	26,500	512,775.00	0.10
348	603986	兆易创新	4,800	512,640.00	0.10
349	834682	球冠电缆	65,287	512,502.95	0.10
350	831278	泰德股份	58,562	511,246.26	0.10
351	873665	科强股份	49,609	510,972.70	0.10
352	688981	中芯国际	5,400	510,948.00	0.10
353	836892	广咨国际	46,499	510,094.03	0.10
354	871553	凯腾精工	72,887	506,564.65	0.10

355	836239	长虹能源	17,726	506,431.82	0.10
356	688047	龙芯中科	3,800	502,664.00	0.10
357	688008	澜起科技	7,400	502,460.00	0.10
358	300621	维业股份	52,700	501,177.00	0.09
359	603501	韦尔股份	4,800	501,168.00	0.09
360	688152	麒麟信安	9,600	499,584.00	0.09
361	603676	卫信康	50,000	497,500.00	0.09
362	832876	慧为智能	30,429	496,296.99	0.09
363	836504	博迅生物	27,990	495,143.10	0.09
364	002267	陕天然气	58,400	493,480.00	0.09
365	873339	恒太照明	62,565	493,012.20	0.09
366	873305	九菱科技	26,220	491,887.20	0.09
367	872925	锦好医疗	42,255	491,848.20	0.09
368	872541	铁大科技	40,105	486,072.60	0.09
369	688739	成大生物	18,800	484,664.00	0.09
370	002932	明德生物	26,300	483,920.00	0.09
371	833030	立方控股	31,132	482,546.00	0.09
372	002273	水晶光电	21,500	477,730.00	0.09
373	835508	殷图网联	16,524	476,882.64	0.09
374	832978	开特股份	35,229	475,591.50	0.09
375	603053	成都燃气	47,400	475,422.00	0.09
376	300433	蓝思科技	21,500	470,850.00	0.09
377	002578	闽发铝业	157,300	470,327.00	0.09
378	833575	康乐卫士	28,392	469,319.76	0.09
379	838701	豪声电子	16,354	467,233.78	0.09
380	600732	爱旭股份	42,300	466,146.00	0.09
381	000028	国药一致	15,900	465,075.00	0.09
382	000421	南京公用	71,600	463,968.00	0.09
383	601138	工业富联	21,500	462,250.00	0.09
384	872351	华光源海	44,873	462,191.90	0.09
385	000725	京东方A	105,000	460,950.00	0.09
386	301392	汇成真空	7,400	457,024.00	0.09
387	870508	丰安股份	36,415	454,823.35	0.09
388	836270	天铭科技	43,421	452,881.03	0.09
389	688037	芯源微	5,400	451,602.00	0.09
390	832885	星辰科技	36,925	450,485.00	0.09
391	603297	永新光学	4,800	450,336.00	0.09
392	600584	长电科技	11,000	449,460.00	0.09
393	300474	景嘉微	4,800	448,752.00	0.09
394	600917	重庆燃气	73,800	448,704.00	0.09
395	600903	贵州燃气	57,500	448,500.00	0.09
396	002475	立讯精密	11,000	448,360.00	0.08
397	832278	鹿得医疗	62,674	448,119.10	0.08

398	301078	孩子王	39,300	447,234.00	0.08
399	002030	达安基因	78,500	445,880.00	0.08
400	300339	润和软件	8,900	445,267.00	0.08
401	836961	西磁科技	16,073	445,222.10	0.08
402	002384	东山精密	15,200	443,840.00	0.08
403	831832	科达自控	20,823	443,113.44	0.08
404	603721	中广天择	16,900	440,583.00	0.08
405	688195	腾景科技	10,958	440,292.44	0.08
406	838171	邦德股份	30,969	439,759.80	0.08
407	837242	建邦科技	18,369	439,570.17	0.08
408	600617	国新能源	162,800	439,560.00	0.08
409	002463	沪电股份	11,000	436,150.00	0.08
410	688502	茂莱光学	2,147	432,405.80	0.08
411	836263	中航泰达	54,926	426,225.76	0.08
412	833427	华维设计	38,681	425,491.00	0.08
413	603353	和顺石油	26,500	425,325.00	0.08
414	600199	金种子酒	31,900	424,270.00	0.08
415	300408	三环集团	11,000	423,610.00	0.08
416	002983	芯瑞达	21,500	422,260.00	0.08
417	834014	特瑞斯	37,094	418,791.26	0.08
418	871245	威博液压	10,963	418,786.60	0.08
419	834599	同力股份	32,663	416,779.88	0.08
420	834021	流金科技	76,987	412,650.32	0.08
421	603296	华勤技术	5,800	411,510.00	0.08
422	688596	正帆科技	11,317	402,319.35	0.08
423	002174	游族网络	43,000	402,050.00	0.08
424	002938	鹏鼎控股	11,000	401,280.00	0.08
425	688361	中科飞测	4,581	401,066.55	0.08
426	000722	湖南发展	42,200	398,790.00	0.08
427	603650	彤程新材	11,400	398,658.00	0.08
428	300002	神州泰岳	34,200	396,378.00	0.08
429	833284	灵鸽科技	25,792	393,328.00	0.07
430	688123	聚辰股份	6,700	392,084.00	0.07
431	002222	福晶科技	12,100	392,040.00	0.07
432	830779	武汉蓝电	11,755	389,090.50	0.07
433	832471	美邦科技	31,847	386,941.05	0.07
434	300122	智飞生物	14,700	386,610.00	0.07
435	300260	新莱应材	14,200	384,678.00	0.07
436	601595	上海电影	15,500	382,850.00	0.07
437	300666	江丰电子	5,500	381,975.00	0.07
438	300003	乐普医疗	33,500	379,890.00	0.07
439	688409	富创精密	7,342	378,626.94	0.07
440	873169	七丰精工	28,473	378,121.44	0.07

441	872808	曙光数创	5,576	376,156.96	0.07
442	300476	胜宏科技	8,900	374,601.00	0.07
443	300315	掌趣科技	65,900	362,450.00	0.07
444	600509	天富能源	55,400	358,438.00	0.07
445	601231	环旭电子	21,500	354,750.00	0.07
446	300467	迅游科技	22,400	352,352.00	0.07
447	873703	广厦环能	16,989	352,351.86	0.07
448	873690	捷众科技	19,550	350,336.00	0.07
449	300115	长盈精密	21,500	349,160.00	0.07
450	002366	融发核电	75,700	347,463.00	0.07
451	003009	中天火箭	8,900	347,100.00	0.07
452	688010	福光股份	12,163	346,645.50	0.07
453	002138	顺络电子	11,000	346,280.00	0.07
454	832175	东方碳素	33,544	344,496.88	0.07
455	873527	夜光明	29,190	343,274.40	0.07
456	002635	安洁科技	21,500	342,280.00	0.06
457	600641	万业企业	23,300	340,646.00	0.06
458	002600	领益智造	42,400	339,200.00	0.06
459	873726	卓兆点胶	16,321	339,150.38	0.06
460	300598	诚迈科技	6,900	333,960.00	0.06
461	870976	视声智能	17,346	330,614.76	0.06
462	002409	雅克科技	5,700	330,315.00	0.06
463	835857	百甲科技	57,364	326,974.80	0.06
464	300328	宜安科技	44,300	326,048.00	0.06
465	872392	佳合科技	18,043	322,969.70	0.06
466	830879	基康仪器	27,318	321,532.86	0.06
467	688589	力合微	11,400	312,018.00	0.06
468	832110	雷特科技	9,540	311,958.00	0.06
469	688561	奇安信	11,600	311,228.00	0.06
470	830809	安达科技	62,199	309,751.02	0.06
471	600892	大晟文化	83,900	309,591.00	0.06
472	600429	三元股份	69,800	307,120.00	0.06
473	837592	华信永道	4,950	306,999.00	0.06
474	002987	京北方	21,400	304,522.00	0.06
475	838402	硅烷科技	33,541	294,825.39	0.06
476	832651	天罡股份	11,904	294,624.00	0.06
477	600460	士兰微	11,000	286,220.00	0.05
478	300318	博晖创新	50,000	286,000.00	0.05
479	873679	前进科技	17,422	285,546.58	0.05
480	839729	永顺生物	42,244	280,077.72	0.05
481	836395	朗鸿科技	21,937	277,064.31	0.05
482	835892	中科美菱	20,074	274,813.06	0.05
483	430017	星昊医药	19,791	273,313.71	0.05

484	831087	秋乐种业	22,966	272,147.10	0.05
485	838670	恒进感应	17,389	271,790.07	0.05
486	839725	惠丰钻石	6,989	271,452.76	0.05
487	833429	康比特	17,589	268,935.81	0.05
488	871396	常辅股份	16,896	268,815.36	0.05
489	831152	昆工科技	24,014	267,756.10	0.05
490	430685	新芝生物	25,406	267,525.18	0.05
491	835438	戈碧迦	16,734	265,903.26	0.05
492	871753	天纺标	9,356	263,090.72	0.05
493	839792	东和新材	29,534	261,966.58	0.05
494	835237	力佳科技	11,705	261,957.90	0.05
495	834639	晨光电缆	43,740	259,378.20	0.05
496	831526	凯华材料	9,862	255,820.28	0.05
497	832000	安徽凤凰	14,239	255,447.66	0.05
498	873693	阿为特	7,179	254,567.34	0.05
499	831768	拾比佰	33,873	250,660.20	0.05
500	831726	朱老六	12,507	248,889.30	0.05
501	831039	国义招标	32,748	248,884.80	0.05
502	836826	盖世食品	23,907	248,632.80	0.05
503	873570	坤博精工	8,258	247,574.84	0.05
504	870656	海昇药业	15,846	247,197.60	0.05
505	838030	德众汽车	43,627	246,928.82	0.05
506	834033	康普化学	13,048	245,432.88	0.05
507	830946	森萱医药	27,770	244,653.70	0.05
508	838810	春光药装	28,305	244,555.20	0.05
509	836957	汉维科技	24,529	242,346.52	0.05
510	835670	数字人	15,659	241,305.19	0.05
511	838971	天马新材	9,523	240,741.44	0.05
512	871263	莱赛激光	16,525	239,943.00	0.05
513	871478	巨能股份	9,111	239,892.63	0.05
514	920002	万达轴承	3,547	239,174.21	0.05
515	836871	派特尔	21,503	238,898.33	0.05
516	837212	智新电子	16,242	236,645.94	0.04
517	430489	佳先股份	14,398	236,127.20	0.04
518	835368	连城数控	8,030	235,921.40	0.04
519	002563	森马服饰	33,500	235,170.00	0.04
520	870199	倍益康	11,752	230,456.72	0.04
521	873593	鼎智科技	6,070	229,506.70	0.04
522	833454	同心传动	19,555	227,229.10	0.04
523	832735	德源药业	7,242	227,109.12	0.04
524	834950	迅安科技	14,370	224,746.80	0.04
525	871981	晶赛科技	8,418	222,908.64	0.04
526	838837	华原股份	22,488	219,482.88	0.04

527	836675	秉扬科技	24,725	205,959.25	0.04
528	430047	诺思兰德	17,837	205,660.61	0.04
529	836260	中寰股份	18,184	186,567.84	0.04
530	834407	驰诚股份	10,522	184,240.22	0.03
531	870299	灿能电力	18,903	183,548.13	0.03
532	832225	利通科技	17,994	183,538.80	0.03
533	873001	纬达光电	10,905	182,876.85	0.03
534	600973	宝胜股份	28,900	182,070.00	0.03
535	603039	泛微网络	3,700	181,300.00	0.03
536	835179	凯德石英	6,932	176,350.08	0.03
537	834261	一诺威	17,309	171,186.01	0.03
538	871634	新威凌	11,244	169,784.40	0.03
539	831834	三维股份	22,713	165,804.90	0.03
540	605111	新洁能	4,800	162,768.00	0.03
541	873122	中纺标	3,297	162,344.28	0.03
542	837092	汉鑫科技	4,544	159,040.00	0.03
543	870726	鸿智科技	8,122	158,460.22	0.03
544	832802	保丽洁	9,626	149,588.04	0.03
545	872895	花溪科技	12,161	147,269.71	0.03
546	839719	宁新新材	13,860	144,421.20	0.03
547	002265	建设工业	6,100	141,947.00	0.03
548	430510	丰光精密	8,588	141,787.88	0.03
549	834765	美之高	4,112	140,054.72	0.03
550	002190	成飞集成	7,200	139,248.00	0.03
551	832145	恒合股份	15,228	138,117.96	0.03
552	002419	天虹股份	23,500	137,710.00	0.03
553	600482	中国动力	5,600	137,032.00	0.03
554	833509	同惠电子	9,584	136,476.16	0.03
555	832149	利尔达	15,380	136,420.60	0.03
556	300114	中航电测	1,900	136,382.00	0.03
557	600391	航发科技	6,800	134,980.00	0.03
558	600072	中船科技	9,500	133,475.00	0.03
559	600764	中国海防	4,700	133,104.00	0.03
560	830896	旺成科技	9,369	132,102.90	0.03
561	600862	中航高科	5,200	131,352.00	0.02
562	000738	航发控制	5,900	131,216.00	0.02
563	600150	中国船舶	3,600	129,456.00	0.02
564	601989	中国重工	26,700	128,427.00	0.02
565	688375	国博电子	2,591	127,891.76	0.02
566	836247	华密新材	6,114	126,987.78	0.02
567	600765	中航重机	6,200	126,914.00	0.02
568	600850	电科数字	5,300	126,670.00	0.02
569	002179	中航光电	3,200	125,760.00	0.02

570	000050	深天马A	13,800	124,614.00	0.02
571	002544	普天科技	5,800	124,294.00	0.02
572	300308	中际旭创	1,000	123,510.00	0.02
573	002226	江南化工	22,700	123,034.00	0.02
574	000625	长安汽车	9,200	122,912.00	0.02
575	002415	海康威视	4,000	122,800.00	0.02
576	688586	江航装备	12,807	122,562.99	0.02
577	300567	精测电子	1,900	122,170.00	0.02
578	833533	骏创科技	5,441	121,878.40	0.02
579	600877	电科芯片	9,200	121,348.00	0.02
580	003031	中瓷电子	2,300	120,497.00	0.02
581	600523	贵航股份	10,100	120,392.00	0.02
582	300847	中船汉光	7,000	119,980.00	0.02
583	688563	航材股份	2,142	119,609.28	0.02
584	000065	北方国际	12,200	119,316.00	0.02
585	600967	内蒙一机	14,000	119,000.00	0.02
586	600151	航天机电	14,900	118,902.00	0.02
587	000519	中兵红箭	8,200	118,490.00	0.02
588	688151	华强科技	7,617	118,292.01	0.02
589	600879	航天电子	13,200	118,272.00	0.02
590	600343	航天动力	11,200	117,600.00	0.02
591	002189	中光学	5,700	117,306.00	0.02
592	688297	中无人机	2,911	117,255.08	0.02
593	600262	北方股份	6,400	117,184.00	0.02
594	600495	晋西车轴	30,700	116,660.00	0.02
595	601698	中国卫通	5,700	116,280.00	0.02
596	002017	东信和平	11,200	116,144.00	0.02
597	002935	天奥电子	7,200	115,920.00	0.02
598	300446	航天智造	7,000	115,570.00	0.02
599	688146	中船特气	3,964	115,114.56	0.02
600	300516	久之洋	3,400	115,022.00	0.02
601	600271	航天信息	12,600	114,786.00	0.02
602	600071	凤凰光学	5,500	114,675.00	0.02
603	000901	航天科技	10,400	114,088.00	0.02
604	601606	长城军工	9,700	114,072.00	0.02
605	002368	太极股份	4,800	113,664.00	0.02
606	600705	中航产融	31,300	113,619.00	0.02
607	002246	北化股份	11,100	112,665.00	0.02
608	600501	航天晨光	6,200	112,468.00	0.02
609	301311	昆船智能	6,200	112,158.00	0.02
610	603698	航天工程	7,200	112,032.00	0.02
611	600118	中国卫星	4,100	111,930.00	0.02
612	600178	东安动力	9,600	111,744.00	0.02

613	688631	莱斯信息	1,275	111,039.75	0.02
614	300212	易华录	4,700	109,980.00	0.02
615	835579	机科股份	5,915	109,900.70	0.02
616	600776	东方通信	9,800	109,662.00	0.02
617	600480	凌云股份	10,100	109,181.00	0.02
618	002025	航天电器	2,200	106,832.00	0.02
619	600698	湖南天雁	23,600	106,672.00	0.02
620	600148	长春一东	5,400	96,876.00	0.02
621	832982	锦波生物	462	95,634.00	0.02
622	688036	传音控股	1,000	95,000.00	0.02
623	300394	天孚通信	1,000	91,360.00	0.02
624	832469	富恒新材	7,778	90,224.80	0.02
625	600038	中直股份	2,300	88,688.00	0.02
626	603138	海量数据	4,800	68,976.00	0.01
627	601360	三六零	4,700	48,645.00	0.01
628	836077	吉林碳谷	4,356	48,612.96	0.01
629	600536	中国软件	1,000	46,690.00	0.01
630	002901	大博医疗	1,200	37,008.00	0.01
631	688169	石头科技	100	21,929.00	0.00
632	000066	中国长城	1,000	14,570.00	0.00
633	600435	北方导航	1,000	9,760.00	0.00
634	603171	税友股份	100	3,050.00	0.00
635	688232	新点软件	100	2,899.00	0.00
636	301153	中科江南	100	2,794.00	0.00
637	003005	竞业达	100	2,712.00	0.00
638	688369	致远互联	100	2,007.00	0.00
639	300674	宇信科技	100	1,952.00	0.00
640	300525	博思软件	100	1,558.00	0.00
641	600588	用友网络	100	1,073.00	0.00

## 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	688192	迪哲医药	46,526,291.88	6.43
2	688072	拓荆科技	41,589,771.11	5.75
3	688117	圣诺生物	39,777,082.01	5.50
4	688197	首药控股	39,277,514.76	5.43
5	688351	微电生理	28,307,840.60	3.91
6	688076	诺泰生物	27,630,133.21	3.82
7	688062	迈威生物	27,017,069.24	3.73
8	300308	中际旭创	25,234,989.00	3.49

9	601666	平煤股份	24,425,397.00	3.38
10	688443	智翔金泰	23,187,030.35	3.20
11	688617	惠泰医疗	22,855,507.38	3.16
12	688418	震有科技	21,192,280.27	2.93
13	688356	键凯科技	20,895,010.42	2.89
14	002475	立讯精密	19,953,658.00	2.76
15	688266	泽璟制药	19,920,825.00	2.75
16	000099	中信海直	19,903,597.00	2.75
17	600593	大连圣亚	19,406,499.00	2.68
18	601816	京沪高铁	19,109,974.00	2.64
19	688302	海创药业	19,028,581.42	2.63
20	688236	春立医疗	18,947,580.33	2.62
21	600760	中航沈飞	18,424,823.00	2.55
22	300832	新产业	18,008,607.00	2.49
23	300389	艾比森	17,420,860.20	2.41
24	300436	广生堂	17,293,202.00	2.39
25	002938	鹏鼎控股	16,490,630.00	2.28
26	600703	三安光电	15,295,248.00	2.11
27	002600	领益智造	14,880,238.00	2.06
28	600893	航发动力	14,801,131.00	2.05

#### 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	688192	迪哲医药	55,337,923.24	7.65
2	688076	诺泰生物	46,947,011.09	6.49
3	688197	首药控股	44,241,609.11	6.11
4	688117	圣诺生物	44,127,444.34	6.10
5	688617	惠泰医疗	42,407,005.93	5.86
6	688062	迈威生物	41,258,350.29	5.70
7	688072	拓荆科技	37,935,818.44	5.24
8	688351	微电生理	36,331,790.67	5.02
9	601666	平煤股份	32,953,410.08	4.55
10	688236	春立医疗	31,377,825.58	4.34
11	300308	中际旭创	29,952,283.01	4.14
12	300857	协创数据	29,950,022.00	4.14
13	300394	天孚通信	28,083,802.16	3.88
14	688235	百济神州	27,259,416.05	3.77
15	002475	立讯精密	22,780,063.00	3.15
16	688169	石头科技	22,762,459.87	3.15
17	688302	海创药业	22,134,812.59	3.06
18	000099	中信海直	21,331,762.00	2.95

19	688036	传音控股	20,815,381.80	2.88
20	002517	恺英网络	20,677,673.00	2.86
21	688356	键凯科技	20,216,302.68	2.79
22	688428	诺诚健华	19,682,521.24	2.72
23	688418	震有科技	19,378,309.05	2.68
24	603338	浙江鼎力	18,369,946.00	2.54
25	688981	中芯国际	18,248,472.59	2.52
26	300832	新产业	18,203,168.76	2.52
27	688266	泽璟制药	18,193,968.32	2.51
28	688008	澜起科技	17,825,151.02	2.46
29	300115	长盈精密	17,658,006.15	2.44
30	600971	恒源煤电	17,332,707.00	2.40
31	603699	纽威股份	17,204,090.00	2.38
32	605167	利柏特	17,199,157.00	2.38
33	300389	艾比森	16,815,696.00	2.32
34	688183	生益电子	16,725,445.53	2.31
35	002600	领益智造	16,605,879.00	2.29
36	300633	开立医疗	16,291,574.00	2.25
37	601699	潞安环能	16,179,512.40	2.24
38	300476	胜宏科技	16,133,639.00	2.23
39	601816	京沪高铁	16,059,472.00	2.22
40	600584	长电科技	15,813,147.80	2.19
41	600188	兖矿能源	15,618,301.60	2.16
42	688443	智翔金泰	15,502,479.68	2.14
43	688376	美埃科技	15,148,491.56	2.09
44	300433	蓝思科技	15,125,244.00	2.09
45	002273	水晶光电	15,015,245.00	2.07

#### 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	2,202,558,152.69
卖出股票收入（成交）总额	2,351,539,118.24

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	国家债券	12,667,611.78	2.40
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-

5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	1,990,423.28	0.38
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	14,658,035.06	2.78

### 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	019740	24 国债 09	75,000	7,594,754.79	1.44
2	019733	24 国债 02	30,000	3,057,333.70	0.58
3	019749	24 国债 15	20,000	2,015,523.29	0.38
4	128108	蓝帆转债	20,070	1,990,423.28	0.38

### 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

无。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

无。

### 8.12 投资组合报告附注

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

报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	284,398.56
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	10,664.13
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	295,062.69

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	128108	蓝帆转债	1,990,423.28	0.38

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 远见回报 A	12,195	48,525.46	11,136,042.31	1.8818%	580,631,932.27	98.1182%

中信建投 远见回报 C	3,603	36,078.74	1,662,680.68	1.2791%	128,329,026.61	98.7209%
合计	15,615	46,222.20	12,798,722.99	1.7733%	708,960,958.88	98.2267%

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	中信建投远见回报 A	2,144,505.01	0.3624%
	中信建投远见回报 C	442,148.98	0.3401%
	合计	2,586,653.99	0.3584%

## 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	中信建投远见回报 A	>100
	中信建投远见回报 C	10~50
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	中信建投远见回报 A	10~50
	中信建投远见回报 C	10~50
	合计	50~100

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

	中信建投远见回报 A	中信建投远见回报 C
基金合同生效日（2021 年 08 月 10 日）基金份额总额	1,196,028,296.70	382,277,836.27
本报告期期初基金份额总额	760,512,797.16	174,114,995.57
本报告期基金总申购份额	19,236,053.61	25,367,903.77
减：本报告期基金总赎回份额	187,980,876.19	69,491,192.05
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	591,767,974.58	129,991,707.29

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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 45,000.00 元整，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	
东北证券	1	1,484,573,015.12	32.60%	703,865.48	32.07%	-
中信建投证券	2	1,337,444,034.42	29.37%	644,598.56	29.37%	-
华创证券	1	1,156,385,642.44	25.39%	555,288.89	25.30%	-
国盛证券	1	439,261,712.25	9.65%	239,790.56	10.93%	-
广发证券	2	136,432,866.70	3.00%	51,161.83	2.33%	-

注：1、本报告期内，本基金租用的交易单元未发生变更。

2、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。

3、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	成交金	占当期债券回	成交金	占当期权	成	占

		交总额的比例	额	购成交总额的 比例	额	证成交总 额的比例	交 金 额	当 期 基 金 成 交 总 额 的 比 例
东北证 券	7,631,591.82	20.14%	-	-	-	-	-	-
中信建 投证券	19,311,451.00	50.96%	-	-	-	-	-	-
华创证 券	2,701,442.00	7.13%	-	-	-	-	-	-
国盛证 券	8,251,717.17	21.77%	-	-	-	-	-	-
广发证 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 下部分基金 2023 年第 4 季度报 告提示性公告	规定报刊	2024-01-22
2	中信建投远见回报混合型证券 投资基金 2023 年第 4 季度报告	规定网站	2024-01-22
3	中信建投基金管理有限公司关 于终止和合期货有限公司办理 旗下基金相关销售业务的公告	规定网站、规定报刊	2024-02-28
4	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
5	中信建投远见回报混合型证券 投资基金 2023 年年度报告	规定网站	2024-03-29
6	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
7	中信建投远见回报混合型证券 投资基金 2024 年第 1 季度报告	规定网站	2024-04-22
8	中信建投基金管理有限公司关	规定网站、规定报刊	2024-06-07

	于暂停海银基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告		
9	中信建投远见回报混合型证券投资基金(A类份额)基金产品资料概要更新	规定网站	2024-06-28
10	中信建投远见回报混合型证券投资基金(C类份额)基金产品资料概要更新	规定网站	2024-06-28
11	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
12	中信建投远见回报混合型证券投资基金 2024 年第 2 季度报告	规定网站	2024-07-19
13	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
14	中信建投远见回报混合型证券投资基金招募说明书(更新)	规定网站	2024-08-16
15	中信建投远见回报混合型证券投资基金(A类份额)基金产品资料概要更新	规定网站	2024-08-16
16	中信建投远见回报混合型证券投资基金(C类份额)基金产品资料概要更新	规定网站	2024-08-16
17	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
18	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
19	中信建投远见回报混合型证券投资基金 2024 年中期报告	规定网站	2024-08-30
20	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
21	中信建投远见回报混合型证券投资基金 2024 年第 3 季度报告	规定网站	2024-10-25
22	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

23	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
24	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

本报告期内，未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

### 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、《中信建投远见回报混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《中信建投远见回报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。

### 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