

中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金

2025 年中期报告

2025 年 06 月 30 日

基金管理人:中信建投基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

报告送出日期:2025 年 08 月 29 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2025年08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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2025年01月01日起至2025年06月30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 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	11
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	11
§ 5 托管人报告	11
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	14
6.4 报表附注	15
§ 7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	39
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	60
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	61
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	61
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	61
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	61
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	61
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	61
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	61
7.12 投资组合报告附注	62

§ 8 基金份额持有人信息	62
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	62
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	63
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	63
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	63
§ 9 开放式基金份额变动	63
§ 10 重大事件揭示	64
10.1 基金份额持有人大会决议	64
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	64
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	64
10.4 基金投资策略的改变	64
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	64
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	64
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	64
10.8 其他重大事件	65
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	66
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	66
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	66
§ 12 备查文件目录	66
12.1 备查文件目录	66
12.2 存放地点	67
12.3 查阅方式	67

§ 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	21,638,752.02 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	13,871,647.91 份	7,767,104.11 份

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中信建投基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责 人	姓名	朱伟	郭明
	联系电话	010-59100208	010-66105799
	电子邮箱	zhuweibj@csc.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4009-108-108	95588

传真	010-59100298	010-66105798
注册地址	北京市怀柔区桥梓镇八龙桥雅苑 3 号楼 1 室	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址	北京市东城区朝阳门内大街 188 号鸿安国际大厦 6、8 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	100010	100140
法定代表人	黄凌	廖林

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中信建投基金管理有限公司	北京市东城区朝阳门内大街 188 号鸿安国际大厦 6、8 层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2025 年 01 月 01 日-2025 年 06 月 30 日）	
	中信建投睿利 A	中信建投睿利 C
本期已实现收益	1,963,698.70	1,032,893.93
本期利润	2,963,585.75	1,546,688.48
加权平均基金份额本期利润	0.1931	0.2019
本期加权平均净值利润率	16.43%	17.80%
本期基金份额净值增长率	18.81%	18.58%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2025 年 06 月 30 日）	
期末可供分配利润	4,157,458.00	1,965,079.88
期末可供分配基金份额利润	0.2997	0.2530
期末基金资产净值	18,029,105.91	9,732,183.99
期末基金份额净值	1.2997	1.2530
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2025 年 06 月 30 日）	
基金份额累计净值增长率	53.46%	48.13%

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
过去一个月	6.08%	0.93%	2.71%	0.47%	3.37%	0.46%
过去三个月	10.21%	1.64%	1.20%	0.88%	9.01%	0.76%
过去六个月	18.81%	1.43%	2.21%	0.80%	16.60%	0.63%
过去一年	44.46%	1.73%	13.44%	1.02%	31.02%	0.71%
过去三年	11.66%	1.40%	-1.71%	0.75%	13.37%	0.65%
自基金合同生效起至今	53.46%	1.13%	19.83%	0.73%	33.63%	0.40%

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
过去一个月	6.05%	0.93%	2.71%	0.47%	3.34%	0.46%
过去三个月	10.11%	1.64%	1.20%	0.88%	8.91%	0.76%
过去六个月	18.58%	1.43%	2.21%	0.80%	16.37%	0.63%
过去一年	43.89%	1.73%	13.44%	1.02%	30.45%	0.71%
过去三年	10.33%	1.40%	-1.71%	0.75%	12.04%	0.65%
自基金合同生效起至今	48.13%	1.17%	20.99%	0.75%	27.14%	0.42%

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

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

中信建投睿利A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2016年12月07日-2025年06月30日)



中信建投睿利C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2017年05月26日-2025年06月30日)



注：1、以上第 1 张图为中信建投睿利 A 基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图，绘图日期为 2016 年 12 月 7 日（基金合同生效日）至 2025 年 6 月 30 日；

2、以上第 2 张图为中信建投睿利 C 基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图，绘图日期为 2017 年 5 月 26 日（首笔份额登记日）至 2025 年 6 月 30 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%”。

§ 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 61 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	-	13 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、中信建投上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金经理。
艾翀	本基金的基金经理	2024-02-06	-	8 年	中国籍，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、中信建投致远混合型证券投资基金、中信建投上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金经理。

注：1、基金经理任职日期、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，未发现不同投资

组合之间存在非公平交易的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2025 年上半年，中国经济虽然受到了特朗普关税的冲击，但是仍然保持了稳健增强，二季度 GDP 同比增速 5.2%，略低于一季度的 5.4%。制造业 PMI 在 4 月受到关税冲击，新出口订单等下滑明显，达到了 49%，5 月大企业出现明显支撑 PMI 企稳回升 49.5%，6 月进一步装备制造业和消费品行业带领下复苏到 49.7%，7 月是制造业的传统淡季加上需求端引导的生产放缓 PMI 回落到 49.3%。跟 PMI 的趋势类似，进出口 4 月受到关税冲击明显，对美出口下降 21%，5 月 6 月持续恢复，对东盟和欧盟的增速较快，半导体出口增速较快。地产销售弱企稳，1 月到 6 月百强地产销售额同比下滑扩大到 11.8%，相对于一季度的 5.9% 有所扩大。在“两新”等消费政策支持下，二季度国内消费稳步复苏，社零同比增幅温和扩张，但 CPI 仍然在低位运行，PPI 则持续下滑，到 7 月“反内卷”政策已经显现效果，PMI 中的原材料购进价格和出厂价格都出现了上行。基建和投资增速相对一季度略有放缓，在 7 月受到暴雨影响，基建增速可能进一步下滑。美国二季度经济复苏企稳，二季度 GDP 达到 3%，显著超预期，相对于 4 月末的预测结构，消费和投资均有所下滑，而出口出现明显提升同时进口大幅下降。关税政策是超预期的主要原因，而该影响并非内生影响。特朗普在 4 月末对全球加税以后给出了 90 天的暂停谈判期，其后又在 7 月 7 日延期到了 8 月 1 日。当前与全球主要国家都已经达成了正式协议，与中国签署了框架协议并再延期 90 天。乌克兰为了继续获得美国的武器和其他方面的支持，跟美国签署了矿产协议，然而俄乌谈判进展缓慢。7 月的非农数据大幅不及预期且前面几月的就业数据也有下调，市场预计美联储 9 月降息概率为 90% 以上。美债收益率震荡上升，美股走势强劲并创出历史新高，非农数据之后股债均转为震荡。A 股在 4 月初受到关税冲击出现快速回撤，其后持续回升恢复到 2022 年 4 月以来的高点，当前仍然在上行趋势中。银行、军工、新消费和创新药在二季度都有阶段性强势表现，尤其是银行二季度上涨 12.62%，并持续创出历史新高。微盘股和北证为代表的小市值，以景气度投资为代表的成长因子表现优异。跟股市表现不同，十年国债活跃券的利率水平出现明显下行，已经重新接近历史低位，但是 7 月上旬开始显著抬升。

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 1.2997 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 18.81%，同期业绩比较基准收益率为 2.21%；截至报告期末中信建投睿利 C 基金份额净值为 1.2530 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 18.58%，同期业绩比较基准收益率为 2.21%。

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 年三季度，中国已经和美国签署了对等关税的框架协议，特朗普对全球主要国家的对等关税政策也已经最终落地，从二季度的情况来看，美国很可能确实能通过关税政策获取一些实际利益，并给美国国内经济提供一些支撑，尽管这种实际利益的增加可能是不可持续的；市场预测美联储今年的首次降息可能在 9 月或者更晚。同时国内十年国债利率已经接近前低，7 月上旬人民币兑美元汇率有所走强，所以海外形势可能不会对国内政策形成显著制约，国内政策可能仍然“以我为主”。国内经济在三季度可能会进一步复苏，随着关税政策落地出口继续修复，同时在“两新”等政策支持下消费也会继续复苏。预期更多行业将在 2025 年内出现盈利拐点。维持对权益的风险偏好较优的判断，全年各个板块可能都会有表现机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

本基金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 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本基金托管人依法对中信建投基金管理有限公司编制和披露的本基金 2025 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2025 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 06 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	2,759,818.52	1,532,263.64
结算备付金		863,245.60	1,317,905.24
存出保证金		301,891.20	-
交易性金融资产	6.4.7.2	23,855,178.68	24,717,885.00
其中：股票投资		23,855,178.68	24,717,885.00
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券		-	-
投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-

应收股利		-	-
应收申购款		120,196.93	31,359.58
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		27,900,330.93	27,599,413.46
负债和净资产	附注号	本期末 2025 年 06 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		93,018.16	62,938.03
应付管理人报酬		26,007.34	29,711.50
应付托管费		4,334.56	4,951.90
应付销售服务费		2,989.89	3,495.94
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1,754.45	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	10,936.63	10,109.88
负债合计		139,041.03	111,207.25
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	21,638,752.02	25,430,455.78
未分配利润	6.4.7.8	6,122,537.88	2,057,750.43
净资产合计		27,761,289.90	27,488,206.21
负债和净资产总计		27,900,330.93	27,599,413.46

注：报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额总额 21,638,752.02 份，其中中信建投睿利 A 类基金份额净值 1.2997 元，基金份额 13,871,647.91 份；中信建投睿利 C 类基金份额净值 1.2530 元，基金份额 7,767,104.11 份。

6.2 利润表

会计主体：中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
一、营业总收入		4,713,911.66	-1,312,220.37
1. 利息收入		8,025.64	14,893.13
其中：存款利息收入	6.4.7.9	8,025.64	14,893.13

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）		3,188,844.65	-125,690.94
其中：股票投资收益	6.4.7.10	2,869,453.36	-381,161.42
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	-479.47
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.12	115,293.31	-55,500.68
股利收益	6.4.7.13	204,097.98	311,450.63
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	1,513,681.60	-1,203,295.27
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	3,359.77	1,872.71
减：二、营业总支出		203,637.43	338,919.85
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	158,687.47	215,531.37
2. 托管费	6.4.10.2.2	26,447.92	35,921.93
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	17,246.04	44,541.42
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.16	-	-
7. 税金及附加		549.09	273.57
8. 其他费用	6.4.7.17	706.91	42,651.56
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,510,274.23	-1,651,140.22
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,510,274.23	-1,651,140.22
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		4,510,274.23	-1,651,140.22

6.3 净资产变动表

会计主体：中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
-----	---------------------------------------

	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	25,430,455.78	2,057,750.43	27,488,206.21
二、本期期初净资产	25,430,455.78	2,057,750.43	27,488,206.21
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-3,791,703.76	4,064,787.45	273,083.69
(一)、综合收益总额	-	4,510,274.23	4,510,274.23
(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)	-3,791,703.76	-445,486.78	-4,237,190.54
其中：1. 基金申购款	3,407,088.24	668,756.47	4,075,844.71
2. 基金赎回款	-7,198,792.00	-1,114,243.25	-8,313,035.25
(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	21,638,752.02	6,122,537.88	27,761,289.90
项 目	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 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)	8,028,790.20	-3,846,494.75	4,182,295.45
(一)、综合收益总额	-	-1,651,140.22	-1,651,140.22
(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)	8,028,790.20	-2,195,354.53	5,833,435.67
其中：1. 基金申购款	45,857,961.40	-5,358,605.12	40,499,356.28
2. 基金赎回款	-37,829,171.20	3,163,250.59	-34,665,920.61
(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	35,707,708.82	-4,070,466.28	31,637,242.54

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

黄凌	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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可〔2016〕第 1962 号《关于准予中信建投睿利灵活配置混

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

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

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

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%”。

6.4.2 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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2025 年 06 月 30 日的财务状况以及 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日。

6.4.4.2 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。

6.4.4.3 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。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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的有关过去事项、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。

6.4.4.5 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。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 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。

6.4.4.8 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）”。

6.4.4.9 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。

6.4.4.10 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。

6.4.4.11 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。

6.4.4.12 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。

6.4.4.13 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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 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。

6.4.6 税项

（1）印花税

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

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

（2）增值税

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

存款利息收入不征收增值税；

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

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税〔2017〕90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额；

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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 06 月 30 日
活期存款	1,168,624.24
等于：本金	1,168,517.31
加：应计利息	106.93
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	1,591,194.28
等于：本金	1,591,099.09
加：应计利息	95.19
减：坏账准备	-
合计	2,759,818.52

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 06 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	23,071,115.07	-	23,855,178.68	784,063.61
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	23,071,115.07	-	23,855,178.68	784,063.61	

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 06 月 30 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	2,393,840.00	-	-	-
一股指期货	2,393,840.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	2,393,840.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IM2507	中证 1000 股指期货 2507 合约	2	2,515,760.00	121,920.00
合计				121,920.00
减：可抵销期货暂收款				121,920.00
净额				0.00

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

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

6.4.7.5 其他资产

无余额。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	40.15
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	10,109.88
其他应付	786.60
合计	10,936.63

6.4.7.7 实收基金

中信建投睿利 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	16,578,645.40	16,578,645.40
本期申购	1,287,194.23	1,287,194.23
本期赎回（以“-”号填列）	-3,994,191.72	-3,994,191.72
本期末	13,871,647.91	13,871,647.91

中信建投睿利 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	8,851,810.38	8,851,810.38
本期申购	2,119,894.01	2,119,894.01
本期赎回（以“-”号填列）	-3,204,600.28	-3,204,600.28
本期末	7,767,104.11	7,767,104.11

6.4.7.8 未分配利润

中信建投睿利 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	5,046,934.55	-3,490,688.17	1,556,246.38

本期期初	5,046,934.55	-3,490,688.17	1,556,246.38
本期利润	1,963,698.70	999,887.05	2,963,585.75
本期基金份额交易产生的变动数	-824,315.20	461,941.07	-362,374.13
其中：基金申购款	477,794.46	-195,913.76	281,880.70
基金赎回款	-1,302,109.66	657,854.83	-644,254.83
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,186,318.05	-2,028,860.05	4,157,458.00

中信建投睿利 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,340,745.91	-1,839,241.86	501,504.05
本期期初	2,340,745.91	-1,839,241.86	501,504.05
本期利润	1,032,893.93	513,794.55	1,546,688.48
本期基金份额交易产生的变动数	-276,722.79	193,610.14	-83,112.65
其中：基金申购款	725,109.96	-338,234.19	386,875.77
基金赎回款	-1,001,832.75	531,844.33	-469,988.42
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,096,917.05	-1,131,837.17	1,965,079.88

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	797.95
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	2,700.31
结算备付金利息收入	4,527.38
其他	-
合计	8,025.64

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	222,754,244.48
减：卖出股票成本总额	219,551,049.94
减：交易费用	333,741.18
买卖股票差价收入	2,869,453.36

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

无余额。

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无余额。

6.4.7.12 衍生工具收益

6.4.7.12.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.12.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
期货投资	115,293.31

6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	204,097.98
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	204,097.98

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	1,393,516.05
——股票投资	1,393,516.05
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	121,920.00
——权证投资	-
——期货投资	121,920.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	1,754.45
合计	1,513,681.60

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	3,359.77
合计	3,359.77

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

6.4.7.16 信用减值损失

无。

6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
审计费用	-
信息披露费	-
证券出借违约金	-
汇划手续费	706.91
合计	706.91

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

财政部、税务总局于 2025 年 7 月 31 日发布《财政部 税务总局关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》（财政部 税务总局公告 2025 年第 4 号），规定自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

无。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中信建投基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
中信建投利信资本管理（北京）有限公	基金管理人的子公司

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中信建投证券股份有限公司	440,049,072.05	100.00%	698,344,593.83	100.00%

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 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%

6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中信建投证券股份有限公司	193,393.61	100.00%	0.00	0.00%
关联方名称	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中信建投证券股份有限公司	365,531.03	100.00%	-	-

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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	158,687.47	215,531.37
其中：应支付销售机构的客户维护费	46,856.82	68,656.01
应支付基金管理人的净管理费	111,830.65	146,875.36

注：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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	26,447.92	35,921.93

注：支付基金托管人中国工商银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中信建投睿利 A	中信建投睿利 C	合计
中信建投基金管理有限公司	-	6,784.88	6,784.88
中信建投证券股份有限公司	-	8,619.97	8,619.97

中国工商银行股份有限公司	-	129.10	129.10
合计	-	15,533.95	15,533.95
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中信建投睿利 A	中信建投睿利 C	合计
中信建投基金管理有限公司	-	12,191.58	12,191.58
中信建投证券股份有限公司	-	31,199.78	31,199.78
合计	-	43,391.36	43,391.36

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

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

中信建投睿利 A

份额单位：份

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
基金合同生效日（2016 年 12 月 07 日）持有的基金份额	10,000,800.00	10,000,800.00
报告期初持有的基金份额	2,000,800.00	2,000,800.00
报告期间申购/买入总份额	-	-
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	14.4237%	10.6665%

中信建投睿利 C

份额单位：份

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
报告期初持有的基金份额	2,124,269.78	2,124,269.78
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	2,124,269.78	2,124,269.78
报告期末持有的基金份额占基	27.3496%	12.5327%

金总份额比例		
--------	--	--

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

中信建投睿利 C

份额单位：份

关联方名称	本期末 2025 年 06 月 30 日		上年度末 2024 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
中信建投利信资本管理（北京）有限公司	892,618.05	11.4923%	892,618.05	10.0840%

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行股份有限公司	1,168,624.24	797.95	9,365.05	1,466.25
中信建投证券股份有限公司	1,591,099.09	2,700.31	2,192,642.60	6,150.92

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。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金固定费用为其他费用项目中“审计费用”等费用。自 2025 年 1 月 1 日起至 2025 年 6 月 30 日，本基金的固定费用由本基金管理人承担，共计人民币 9,917.81 元。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2025 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金管理人的风险管理机构由董事会下属的公司风险控制与合规委员会、督察长、公司风险管理委员会、风险管理部以及各个业务部门组成。公司实行全面、系统的风险管理，风险管理覆盖公司所有战略环节、业务环节和操作环节。同时制定了系统化的风险管理程序，对风险管理的整个流程进行评估和改进。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制与合规委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面，由风险管理部负责协调并与各部门合作完成运作风险管理。

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无余额。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无余额。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无余额。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无余额。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无余额。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无余额。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人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 6.4.12.3 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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短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 6.4.12（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。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年 06 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	2,759,818.52	-	-	-	2,759,818.52
结算备付金	863,245.60	-	-	-	863,245.60
存出保证金	301,891.20	-	-	-	301,891.20
交易性金融资产	-	-	-	23,855,178.68	23,855,178.68
应收申购款	-	-	-	120,196.93	120,196.93
资产总计	3,924,955.32	-	-	23,975,375.61	27,900,330.93
负债					
应付赎回款	-	-	-	93,018.16	93,018.16
应付管理人报酬	-	-	-	26,007.34	26,007.34
应付托管费	-	-	-	4,334.56	4,334.56

应付销售服务费	-	-	-	2,989.89	2,989.89
应交税费	-	-	-	1,754.45	1,754.45
其他负债	-	-	-	10,936.63	10,936.63
负债总计	-	-	-	139,041.03	139,041.03
利率敏感度缺口	3,924,955.32	-	-	23,836,334.58	27,761,289.90
上年度末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,532,263.64	-	-	-	1,532,263.64
结算备付金	1,317,905.24	-	-	-	1,317,905.24
交易性金融资产	-	-	-	24,717,885.00	24,717,885.00
应收申购款	-	-	-	31,359.58	31,359.58
资产总计	2,850,168.88	-	-	24,749,244.58	27,599,413.46
负债					
应付赎回款	-	-	-	62,938.03	62,938.03
应付管理人报酬	-	-	-	29,711.50	29,711.50
应付托管费	-	-	-	4,951.90	4,951.90
应付销售服务费	-	-	-	3,495.94	3,495.94
其他负债	-	-	-	10,109.88	10,109.88
负债总计	-	-	-	111,207.25	111,207.25
利率敏感度缺口	2,850,168.88	-	-	24,638,037.33	27,488,206.21

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

6.4.13.4.1.2 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。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易

的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 06 月 30 日		上年度末 2024 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	23,855,178.68	85.93	24,717,885.00	89.92
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	23,855,178.68	85.93	24,717,885.00	89.92

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2025 年 06 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	2,276,483.26	2,321,168.57
	业绩比较基准下降 5%	-2,276,483.26	-2,321,168.57

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

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

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025 年 06 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	23,855,178.68	24,703,805.00
第二层次	—	14,080.00
第三层次	—	—
合计	23,855,178.68	24,717,885.00

6.4.14.2.2 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。

6.4.14.3 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。

6.4.14.4 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。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.15.1 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。

6.4.15.2 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。

6.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2025 年 8 月 28 日经本基金的基金管理人批准。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	23,855,178.68	85.50
	其中：股票	23,855,178.68	85.50
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	3,623,064.12	12.99
8	其他各项资产	422,088.13	1.51
9	合计	27,900,330.93	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	137,018.00	0.49
B	采矿业	202,828.00	0.73
C	制造业	19,006,084.22	68.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	195,022.00	0.70
E	建筑业	247,864.00	0.89
F	批发和零售业	520,436.00	1.87
G	交通运输、仓储和邮政业	375,691.00	1.35
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,214,794.46	4.38
J	金融业	191,883.00	0.69
K	房地产业	140,076.00	0.50
L	租赁和商务服务业	648,190.00	2.33
M	科学研究和技术服务业	377,806.00	1.36
N	水利、环境和公共设施管理业	50,025.00	0.18
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	40,225.00	0.14
Q	卫生和社会工作	40,232.00	0.14
R	文化、体育和娱乐业	414,669.00	1.49
S	综合	52,335.00	0.19
	合计	23,855,178.68	85.93

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无余额。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	002209	达意隆	13,500	169,425.00	0.61
2	002454	松芝股份	21,800	168,296.00	0.61
3	603187	海容冷链	14,100	165,816.00	0.60
4	000586	汇源通信	14,700	163,464.00	0.59
5	600742	富维股份	16,900	160,719.00	0.58
6	301318	维海德	4,300	145,512.00	0.52
7	300606	金太阳	7,100	140,012.00	0.50
8	603601	再升科技	34,400	139,664.00	0.50
9	603612	索通发展	7,500	137,850.00	0.50
10	002012	凯恩股份	24,100	136,406.00	0.49
11	605168	三人行	4,600	135,378.00	0.49
12	603269	海鸥股份	14,200	132,344.00	0.48
13	600675	中华企业	45,800	131,904.00	0.48
14	002399	海普瑞	11,000	131,010.00	0.47
15	300547	川环科技	4,300	129,946.00	0.47
16	600819	耀皮玻璃	22,200	129,204.00	0.47
17	002971	和远气体	5,500	128,315.00	0.46
18	002972	科安达	10,400	127,816.00	0.46
19	600826	兰生股份	15,400	126,280.00	0.45
20	002228	合兴包装	35,700	126,021.00	0.45
21	605555	德昌股份	7,580	125,600.60	0.45
22	000719	中原传媒	9,900	122,859.00	0.44
23	002999	天禾股份	16,600	115,868.00	0.42
24	301195	北路智控	3,000	107,400.00	0.39
25	002643	万润股份	9,300	107,043.00	0.39
26	001266	宏英智能	4,000	105,800.00	0.38
27	688677	海泰新光	2,700	105,327.00	0.38
28	300111	向日葵	28,900	94,792.00	0.34
29	300727	润禾材料	3,600	94,644.00	0.34
30	688636	智明达	2,800	94,612.00	0.34
31	600329	XD 达仁堂	2,800	93,408.00	0.34
32	603309	维力医疗	7,300	92,856.00	0.33
33	300389	艾比森	8,000	92,640.00	0.33
34	000823	超声电子	7,800	92,430.00	0.33
35	002925	盈趣科技	5,100	91,698.00	0.33
36	688786	悦安新材	3,900	90,870.00	0.33
37	300559	佳发教育	7,700	90,860.00	0.33
38	300893	松原安全	3,700	90,724.00	0.33
39	603230	内蒙新华	7,000	90,370.00	0.33
40	300206	理邦仪器	7,500	90,150.00	0.32
41	603508	思维列控	3,400	90,032.00	0.32

42	600071	凤凰光学	4,200	89,712.00	0.32
43	600218	全柴动力	10,000	89,700.00	0.32
44	603987	康德莱	11,600	89,320.00	0.32
45	600885	宏发股份	4,000	89,240.00	0.32
46	605001	威奥股份	12,400	89,156.00	0.32
47	603095	越剑智能	5,400	88,722.00	0.32
48	300218	安利股份	5,900	88,382.00	0.32
49	300140	节能环保	14,300	88,231.00	0.32
50	002913	奥士康	3,000	88,230.00	0.32
51	002344	海宁皮城	20,300	88,102.00	0.32
52	605128	上海沿浦	2,900	87,754.00	0.32
53	600330	天通股份	12,200	87,474.00	0.32
54	688676	金盘科技	2,606	87,170.70	0.31
55	002350	北京科锐	12,700	87,122.00	0.31
56	601869	长飞光纤	2,100	85,512.00	0.31
57	600055	万东医疗	4,900	84,672.00	0.31
58	600846	同济科技	7,200	81,936.00	0.30
59	000657	中钨高新	6,700	79,462.00	0.29
60	688261	东微半导	1,900	78,375.00	0.28
61	002545	东方铁塔	8,800	78,232.00	0.28
62	001223	欧克科技	1,700	76,398.00	0.28
63	600993	马应龙	2,700	76,356.00	0.28
64	002396	星网锐捷	3,400	76,330.00	0.27
65	688665	四方光电	1,700	76,024.00	0.27
66	600459	贵研铂业	4,900	75,999.00	0.27
67	603808	歌力思	9,000	74,700.00	0.27
68	301202	朗威股份	1,800	73,980.00	0.27
69	002637	赞宇科技	7,400	73,852.00	0.27
70	600315	上海家化	3,500	73,745.00	0.27
71	688138	清溢光电	2,700	73,413.00	0.26
72	300735	光弘科技	2,900	72,790.00	0.26
73	600268	国电南自	9,300	72,726.00	0.26
74	001256	炜冈科技	3,300	72,666.00	0.26
75	002516	旷达科技	14,100	72,615.00	0.26
76	603896	寿仙谷	3,400	72,522.00	0.26
77	001231	农心科技	3,600	72,432.00	0.26
78	301252	同星科技	2,900	72,297.00	0.26
79	002491	通鼎互联	12,700	72,136.00	0.26
80	301018	申菱环境	1,900	72,086.00	0.26
81	603516	淳中科技	2,000	71,800.00	0.26
82	603070	万控智造	5,400	71,766.00	0.26
83	688381	帝奥微	3,300	71,478.00	0.26
84	002066	瑞泰科技	5,900	70,918.00	0.26

85	000906	浙商中拓	11,000	70,070.00	0.25
86	000790	华神科技	18,000	69,840.00	0.25
87	603916	苏博特	7,700	69,762.00	0.25
88	301276	嘉曼服饰	3,800	69,122.00	0.25
89	300790	宇瞳光学	3,300	69,003.00	0.25
90	688668	鼎通科技	1,100	68,706.00	0.25
91	605288	凯迪股份	1,300	67,743.00	0.24
92	600499	科达制造	6,900	67,620.00	0.24
93	002293	罗莱生活	7,600	66,424.00	0.24
94	600020	中原高速	13,600	65,008.00	0.23
95	301061	匠心家居	800	62,032.00	0.22
96	688179	阿拉丁	4,600	58,512.00	0.21
97	688022	瀚川智能	3,900	57,798.00	0.21
98	603717	天域生物	7,700	55,825.00	0.20
99	688079	美迪凯	5,500	55,220.00	0.20
100	300956	英力股份	3,400	55,148.00	0.20
101	300246	宝莱特	6,900	55,131.00	0.20
102	688315	诺禾致源	3,900	55,068.00	0.20
103	300981	中红医疗	4,600	55,062.00	0.20
104	000553	安道麦 A	7,600	54,872.00	0.20
105	002905	金逸影视	5,900	54,752.00	0.20
106	600337	美克家居	24,700	54,587.00	0.20
107	002782	可立克	4,200	54,516.00	0.20
108	002377	国创高新	18,300	54,351.00	0.20
109	002382	蓝帆医疗	9,700	54,320.00	0.20
110	300396	迪瑞医疗	3,900	54,210.00	0.20
111	000635	英力特	6,100	54,107.00	0.19
112	000751	锌业股份	17,200	54,008.00	0.19
113	002788	鹭燕医药	6,300	53,991.00	0.19
114	688127	蓝特光学	2,100	53,991.00	0.19
115	300982	苏文电能	3,000	53,970.00	0.19
116	600780	通宝能源	9,100	53,963.00	0.19
117	600594	益佰制药	14,000	53,900.00	0.19
118	600888	新疆众和	7,900	53,878.00	0.19
119	600784	鲁银投资	8,400	53,760.00	0.19
120	000761	本钢板材	14,900	53,640.00	0.19
121	600269	赣粤高速	10,600	53,636.00	0.19
122	002081	金螳螂	15,600	53,508.00	0.19
123	000828	东莞控股	5,000	53,450.00	0.19
124	002302	西部建设	9,200	53,360.00	0.19
125	002578	闽发铝业	15,900	53,265.00	0.19
126	002947	恒铭达	1,600	53,104.00	0.19
127	000755	山西高速	10,900	53,083.00	0.19

128	688260	昀冢科技	3,200	52,736.00	0.19
129	600673	东阳光	4,500	52,335.00	0.19
130	688090	瑞松科技	1,500	51,585.00	0.19
131	688160	步科股份	600	51,420.00	0.19
132	688663	新风光	1,900	51,205.00	0.18
133	688026	洁特生物	3,100	50,840.00	0.18
134	688526	科前生物	3,200	49,856.00	0.18
135	688607	康众医疗	2,600	48,750.00	0.18
136	301031	中熔电气	600	47,790.00	0.17
137	301327	华宝新能	900	46,224.00	0.17
138	002487	大金重工	1,400	46,060.00	0.17
139	000026	飞亚达	2,900	45,878.00	0.17
140	688523	航天环宇	2,100	45,171.00	0.16
141	601208	东材科技	4,700	44,556.00	0.16
142	688400	凌云光	1,600	44,112.00	0.16
143	300770	新媒股份	1,100	43,989.00	0.16
144	603219	富佳股份	3,000	43,530.00	0.16
145	603766	隆鑫通用	3,400	43,384.00	0.16
146	002539	云图控股	4,600	43,148.00	0.16
147	002511	中顺洁柔	6,400	43,008.00	0.15
148	603809	豪能股份	2,800	42,840.00	0.15
149	003010	若羽臣	700	42,420.00	0.15
150	002701	奥瑞金	7,100	42,245.00	0.15
151	600757	长江传媒	4,500	41,760.00	0.15
152	600305	恒顺醋业	5,400	41,742.00	0.15
153	600987	航民股份	5,900	41,713.00	0.15
154	600057	厦门象屿	5,900	41,477.00	0.15
155	600273	嘉化能源	4,900	41,454.00	0.15
156	300553	集智股份	1,000	41,430.00	0.15
157	600480	凌云股份	3,400	41,378.00	0.15
158	605016	百龙创园	2,000	41,260.00	0.15
159	300652	雷迪克	700	41,223.00	0.15
160	601369	陕鼓动力	4,700	41,219.00	0.15
161	601811	新华文轩	2,800	40,796.00	0.15
162	300525	博思软件	2,800	40,768.00	0.15
163	300229	拓尔思	2,200	40,568.00	0.15
164	300378	鼎捷数智	1,100	40,260.00	0.15
165	300768	迪普科技	2,300	39,445.00	0.14
166	605488	福莱新材	1,200	39,276.00	0.14
167	603197	保隆科技	1,000	39,070.00	0.14
168	300986	志特新材	3,100	39,060.00	0.14
169	600435	北方导航	2,500	38,975.00	0.14
170	600262	北方股份	1,700	38,760.00	0.14

171	000408	藏格矿业	900	38,403.00	0.14
172	001269	欧晶科技	1,500	38,400.00	0.14
173	002185	华天科技	3,800	38,380.00	0.14
174	688598	金博股份	1,500	38,130.00	0.14
175	688233	神工股份	1,200	38,124.00	0.14
176	688191	智洋创新	1,600	38,048.00	0.14
177	688215	瑞晟智能	1,000	38,020.00	0.14
178	603089	正裕工业	2,900	37,903.00	0.14
179	688599	天合光能	2,600	37,778.00	0.14
180	301002	崧盛股份	1,700	37,587.00	0.14
181	688577	浙海德曼	800	37,512.00	0.14
182	300787	海能实业	2,700	37,395.00	0.13
183	688697	纽威数控	2,800	37,352.00	0.13
184	002993	奥海科技	900	37,323.00	0.13
185	003031	中瓷电子	700	37,247.00	0.13
186	002632	道明光学	4,000	37,200.00	0.13
187	688360	德马科技	2,000	37,100.00	0.13
188	002080	中材科技	1,900	37,050.00	0.13
189	002394	联发股份	4,500	37,035.00	0.13
190	603327	福蓉科技	4,000	37,000.00	0.13
191	688112	鼎阳科技	1,000	36,970.00	0.13
192	301043	绿岛风	1,200	36,912.00	0.13
193	600867	通化东宝	4,500	36,900.00	0.13
194	600099	林海股份	3,400	36,856.00	0.13
195	002935	天奥电子	2,300	36,800.00	0.13
196	600106	重庆路桥	6,000	36,780.00	0.13
197	300470	中密控股	1,000	36,770.00	0.13
198	603611	诺力股份	1,700	36,618.00	0.13
199	601600	中国铝业	5,200	36,608.00	0.13
200	601168	西部矿业	2,200	36,586.00	0.13
201	688035	德邦科技	900	36,558.00	0.13
202	600739	辽宁成大	3,300	36,300.00	0.13
203	600850	电科数字	1,500	36,285.00	0.13
204	300970	华绿生物	2,500	36,250.00	0.13
205	301218	华是科技	1,700	36,244.00	0.13
206	688435	英方软件	1,100	36,234.00	0.13
207	300286	安科瑞	1,600	36,112.00	0.13
208	300512	中亚股份	4,200	36,036.00	0.13
209	301102	兆讯传媒	3,300	36,036.00	0.13
210	002171	楚江新材	3,700	36,001.00	0.13
211	000551	创元科技	2,800	35,980.00	0.13
212	688087	英科再生	1,400	35,980.00	0.13
213	600339	中油工程	11,000	35,970.00	0.13

214	301399	英特科技	1,800	35,910.00	0.13
215	605155	西大门	3,000	35,910.00	0.13
216	688611	杭州柯林	1,100	35,893.00	0.13
217	301419	阿莱德	1,300	35,880.00	0.13
218	002926	华西证券	4,000	35,760.00	0.13
219	301199	迈赫股份	1,400	35,728.00	0.13
220	300151	昌红科技	2,900	35,699.00	0.13
221	002835	同为股份	1,900	35,663.00	0.13
222	605286	同力日升	900	35,658.00	0.13
223	300795	米奥会展	2,400	35,640.00	0.13
224	832982	锦波生物	100	35,596.00	0.13
225	601108	财通证券	4,500	35,595.00	0.13
226	001210	金房能源	2,600	35,594.00	0.13
227	688358	祥生医疗	1,200	35,580.00	0.13
228	301128	强瑞技术	700	35,574.00	0.13
229	601236	红塔证券	4,200	35,574.00	0.13
230	601107	四川成渝	5,900	35,518.00	0.13
231	301353	普莱得	1,400	35,448.00	0.13
232	600768	宁波富邦	3,100	35,433.00	0.13
233	002817	黄山胶囊	4,800	35,424.00	0.13
234	688162	巨一科技	1,300	35,412.00	0.13
235	688545	兴福电子	1,300	35,399.00	0.13
236	300406	九强生物	2,500	35,375.00	0.13
237	688603	天承科技	800	35,360.00	0.13
238	600685	中船防务	1,300	35,347.00	0.13
239	300432	富临精工	2,700	35,289.00	0.13
240	603966	法兰泰克	3,800	35,264.00	0.13
241	003025	思进智能	2,600	35,204.00	0.13
242	301397	溯联股份	1,000	35,180.00	0.13
243	605228	神通科技	3,200	35,168.00	0.13
244	301370	国科恒泰	3,300	35,145.00	0.13
245	600362	江西铜业	1,500	35,145.00	0.13
246	001311	多利科技	1,700	35,139.00	0.13
247	300590	移为通信	2,700	35,127.00	0.13
248	301398	星源卓镁	900	35,127.00	0.13
249	301172	君逸数码	1,700	35,105.00	0.13
250	600261	阳光照明	10,700	35,096.00	0.13
251	688350	富淼科技	2,200	35,068.00	0.13
252	301387	光大同创	900	35,010.00	0.13
253	001368	通达创智	1,500	34,905.00	0.13
254	001367	海森药业	1,600	34,896.00	0.13
255	300976	达瑞电子	700	34,853.00	0.13
256	603027	千禾味业	3,000	34,830.00	0.13

257	001380	华纬科技	1,700	34,816.00	0.13
258	600502	安徽建工	7,400	34,780.00	0.13
259	002462	嘉事堂	2,600	34,762.00	0.13
260	600455	博通股份	1,300	34,762.00	0.13
261	603067	振华股份	2,280	34,747.20	0.13
262	600861	北京人力	1,800	34,740.00	0.13
263	002978	安宁股份	1,100	34,738.00	0.13
264	002777	久远银海	1,900	34,694.00	0.12
265	301181	标榜股份	1,400	34,692.00	0.12
266	688475	萤石网络	1,100	34,672.00	0.12
267	300845	捷安高科	3,100	34,658.00	0.12
268	300428	立中集团	1,900	34,618.00	0.12
269	600615	丰华股份	3,100	34,596.00	0.12
270	300996	普联软件	2,300	34,569.00	0.12
271	688175	高凌信息	1,700	34,561.00	0.12
272	000523	红棉股份	10,600	34,556.00	0.12
273	603082	北自科技	900	34,425.00	0.12
274	600160	巨化股份	1,200	34,416.00	0.12
275	003005	竞业达	1,700	34,357.00	0.12
276	300932	三友联众	3,000	34,350.00	0.12
277	300390	天华新能	1,800	34,326.00	0.12
278	603499	翔港科技	2,080	34,299.20	0.12
279	603882	金域医学	1,200	34,272.00	0.12
280	603668	天马科技	2,600	34,268.00	0.12
281	300613	富瀚微	700	34,216.00	0.12
282	603515	XD 欧普照	1,900	34,181.00	0.12
283	688335	复洁环保	2,800	34,160.00	0.12
284	600769	祥龙电业	3,300	34,155.00	0.12
285	603519	立霸股份	2,800	34,048.00	0.12
286	301133	金钟股份	1,500	34,020.00	0.12
287	002346	柘中股份	2,500	34,000.00	0.12
288	002014	永新股份	2,800	33,936.00	0.12
289	001300	三柏硕	2,500	33,875.00	0.12
290	002107	沃华医药	5,900	33,748.00	0.12
291	301328	维峰电子	800	33,720.00	0.12
292	688255	凯尔达	1,000	33,690.00	0.12
293	301130	西点药业	1,200	33,600.00	0.12
294	301270	汉仪股份	700	33,362.00	0.12
295	300983	尤安设计	1,700	33,184.00	0.12
296	301291	明阳电气	800	32,920.00	0.12
297	603018	华设集团	4,000	32,840.00	0.12
298	833943	优机股份	1,200	32,784.00	0.12
299	688129	东来技术	1,200	32,640.00	0.12

300	600222	太龙药业	5,800	32,422.00	0.12
301	836699	海达尔	700	32,368.00	0.12
302	600271	航天信息	3,500	32,340.00	0.12
303	600482	中国动力	1,400	32,298.00	0.12
304	830839	万通液压	1,000	32,200.00	0.12
305	872392	佳合科技	1,500	31,845.00	0.11
306	301119	正强股份	900	31,824.00	0.11
307	870357	雅葆轩	1,100	31,570.00	0.11
308	835368	连城数控	1,100	31,537.00	0.11
309	870976	视声智能	1,100	31,449.00	0.11
310	688205	德科立	500	31,345.00	0.11
311	832419	路斯股份	1,300	31,213.00	0.11
312	873690	捷众科技	1,200	31,188.00	0.11
313	301209	联合化学	300	31,122.00	0.11
314	834950	迅安科技	1,600	31,040.00	0.11
315	836720	吉冈精密	2,100	30,933.00	0.11
316	872541	铁大科技	1,800	30,906.00	0.11
317	831195	三祥科技	1,700	30,787.00	0.11
318	430718	合肥高科	1,700	30,719.00	0.11
319	832651	天罡股份	1,000	30,700.00	0.11
320	873122	中纺标	700	30,639.00	0.11
321	836892	广咨国际	1,900	30,590.00	0.11
322	832000	安徽凤凰	1,400	30,576.00	0.11
323	871694	中裕科技	1,600	30,560.00	0.11
324	832278	鹿得医疗	2,800	30,464.00	0.11
325	832089	禾昌聚合	1,800	30,438.00	0.11
326	920682	球冠电缆	3,100	30,380.00	0.11
327	430418	苏轴股份	1,000	30,240.00	0.11
328	837242	建邦科技	900	30,168.00	0.11
329	833751	惠同新材	1,700	30,124.00	0.11
330	836942	XD 恒立钻	1,500	30,045.00	0.11
331	834062	科润智控	2,800	30,044.00	0.11
332	832978	开特股份	1,200	29,988.00	0.11
333	873339	恒太照明	2,700	29,970.00	0.11
334	834599	同力股份	1,400	29,960.00	0.11
335	834058	华洋赛车	800	29,888.00	0.11
336	839371	欧福蛋业	2,700	29,808.00	0.11
337	430478	哈一药业	1,400	29,736.00	0.11
338	836208	青矩技术	800	29,688.00	0.11
339	430476	海能技术	1,600	29,536.00	0.11
340	837023	芭薇股份	1,500	29,535.00	0.11
341	600150	中国船舶	900	29,286.00	0.11
342	870508	丰安股份	1,400	29,246.00	0.11

343	600486	扬农化工	500	29,000.00	0.10
344	002438	江苏神通	2,300	28,934.00	0.10
345	833523	德瑞锂电	1,100	28,919.00	0.10
346	834261	一诺威	1,900	28,785.00	0.10
347	688502	茂莱光学	100	28,766.00	0.10
348	873703	广厦环能	1,700	28,764.00	0.10
349	832735	德源药业	800	28,736.00	0.10
350	834033	康普化学	1,400	28,728.00	0.10
351	834014	特瑞斯	2,000	28,500.00	0.10
352	603173	福斯达	800	28,440.00	0.10
353	002864	盘龙药业	1,000	28,270.00	0.10
354	002156	通富微电	1,100	28,182.00	0.10
355	000819	岳阳兴长	1,800	28,170.00	0.10
356	836547	无锡晶海	1,100	28,116.00	0.10
357	002442	龙星科技	4,400	28,072.00	0.10
358	833429	康比特	1,200	28,044.00	0.10
359	835185	贝特瑞	1,200	27,960.00	0.10
360	832110	雷特科技	700	27,783.00	0.10
361	600288	大恒科技	2,700	27,756.00	0.10
362	603811	诚意药业	3,000	27,690.00	0.10
363	603656	泰禾智能	1,500	27,675.00	0.10
364	605111	新洁能	900	27,666.00	0.10
365	002783	凯龙股份	3,200	27,616.00	0.10
366	600380	健康元	2,500	27,575.00	0.10
367	600237	铜峰电子	3,800	27,550.00	0.10
368	603020	爱普股份	3,000	27,540.00	0.10
369	837403	康农种业	1,100	27,489.00	0.10
370	600251	冠农股份	3,600	27,468.00	0.10
371	002367	康力电梯	3,900	27,417.00	0.10
372	002020	京新药业	2,100	27,405.00	0.10
373	600498	烽火通信	1,300	27,339.00	0.10
374	601609	金田股份	3,900	27,339.00	0.10
375	600583	海油工程	5,000	27,300.00	0.10
376	000726	鲁 泰 A	4,300	27,262.00	0.10
377	603059	倍加洁	1,100	27,126.00	0.10
378	601555	东吴证券	3,100	27,125.00	0.10
379	601728	中国电信	3,500	27,125.00	0.10
380	002166	莱茵生物	3,500	27,090.00	0.10
381	000705	浙江震元	3,200	27,040.00	0.10
382	603229	奥翔药业	3,100	27,032.00	0.10
383	002661	克明食品	2,700	27,027.00	0.10
384	603101	汇嘉时代	3,600	27,000.00	0.10
385	300452	山河药辅	2,200	26,994.00	0.10

386	002029	七 匹 狼	4,000	26,960.00	0.10
387	600584	长电科技	800	26,952.00	0.10
388	601872	招商轮船	4,300	26,918.00	0.10
389	002728	特一药业	3,200	26,912.00	0.10
390	000100	TCL 科技	6,200	26,846.00	0.10
391	600267	海正药业	2,900	26,825.00	0.10
392	600873	梅花生物	2,500	26,725.00	0.10
393	601857	中国石油	3,100	26,505.00	0.10
394	600352	浙江龙盛	2,600	26,416.00	0.10
395	000059	华锦股份	4,900	26,411.00	0.10
396	600096	云天化	1,200	26,364.00	0.09
397	601098	中南传媒	2,000	26,240.00	0.09
398	600750	江中药业	1,200	26,196.00	0.09
399	000513	丽珠集团	700	25,228.00	0.09
400	688696	极米科技	200	22,872.00	0.08
401	688690	纳微科技	1,000	22,830.00	0.08
402	688667	菱电电控	400	21,284.00	0.08
403	688013	天臣医疗	700	20,461.00	0.07
404	688388	嘉元科技	1,000	20,080.00	0.07
405	688269	凯立新材	600	19,920.00	0.07
406	688498	源杰科技	100	19,500.00	0.07
407	688556	高测股份	2,700	19,386.00	0.07
408	688182	灿勤科技	700	19,292.00	0.07
409	688377	迪威尔	800	19,096.00	0.07
410	688566	吉贝尔	700	19,033.00	0.07
411	688669	聚石化学	1,000	18,870.00	0.07
412	688109	品茗科技	600	18,678.00	0.07
413	688578	艾力斯	200	18,608.00	0.07
414	688590	新致软件	900	18,486.00	0.07
415	688625	呈和科技	600	18,348.00	0.07
416	688226	威腾电气	700	18,298.00	0.07
417	688008	澜起科技	200	16,400.00	0.06
418	688123	聚辰股份	200	16,198.00	0.06
419	688036	传音控股	200	15,940.00	0.06
420	688122	西部超导	300	15,564.00	0.06
421	688181	八亿时空	500	15,560.00	0.06
422	688314	康拓医疗	500	15,440.00	0.06
423	688080	映翰通	300	15,267.00	0.05
424	688020	方邦股份	400	15,148.00	0.05
425	688268	华特气体	300	15,111.00	0.05
426	688338	赛科希德	600	15,108.00	0.05
427	688621	阳光诺和	300	14,967.00	0.05
428	688557	兰剑智能	500	14,965.00	0.05

429	688722	同益中	700	14,889.00	0.05
430	688236	春立医疗	800	14,872.00	0.05
431	688100	威胜信息	400	14,820.00	0.05
432	688308	欧科亿	800	14,760.00	0.05
433	688551	科威尔	500	14,695.00	0.05
434	688586	江航装备	1,300	14,625.00	0.05
435	688135	利扬芯片	700	14,497.00	0.05
436	688196	卓越新能	300	14,421.00	0.05
437	688312	燕麦科技	600	14,418.00	0.05
438	688357	建龙微纳	500	14,395.00	0.05
439	688456	有研粉材	400	14,380.00	0.05
440	688106	金宏气体	800	14,312.00	0.05
441	688168	安博通	200	14,174.00	0.05
442	688698	伟创电气	300	14,160.00	0.05
443	688466	金科环境	800	14,144.00	0.05
444	688367	工大高科	800	14,120.00	0.05
445	688309	恒誉环保	782	14,005.62	0.05
446	688681	科汇股份	1,000	14,000.00	0.05
447	688097	博众精工	500	13,955.00	0.05
448	688580	伟思医疗	300	13,947.00	0.05
449	688002	睿创微纳	200	13,944.00	0.05
450	688379	华光新材	400	13,864.00	0.05
451	688133	泰坦科技	600	13,812.00	0.05
452	688050	爱博医疗	200	13,770.00	0.05
453	688779	五矿新能	2,500	13,600.00	0.05
454	688328	深科达	600	13,590.00	0.05
455	688029	南微医学	200	13,510.00	0.05
456	688777	中控技术	300	13,473.00	0.05
457	688528	秦川物联	1,300	13,468.00	0.05
458	688085	三友医疗	700	13,461.00	0.05
459	688519	南亚新材	300	13,440.00	0.05
460	688606	奥泰生物	200	13,440.00	0.05
461	688057	金达莱	1,100	13,420.00	0.05
462	688121	卓然股份	1,100	13,288.00	0.05
463	688418	震有科技	500	13,230.00	0.05
464	688597	煜邦电力	1,680	13,154.40	0.05
465	688311	盟升电子	300	12,915.00	0.05
466	688067	爱威科技	600	12,906.00	0.05
467	688248	南网科技	400	12,584.00	0.05
468	688169	石头科技	80	12,524.00	0.05
469	688513	苑东生物	300	12,318.00	0.04
470	688103	国力股份	200	12,168.00	0.04
471	688049	炬芯科技	200	12,100.00	0.04

472	688228	开普云	200	11,876.00	0.04
473	688322	奥比中光	200	11,802.00	0.04
474	600967	内蒙一机	600	11,610.00	0.04
475	688288	鸿泉物联	400	11,604.00	0.04
476	688629	华丰科技	200	11,440.00	0.04
477	001236	弘业期货	700	11,186.00	0.04
478	688778	厦钨新能	200	11,184.00	0.04
479	603713	密尔克卫	200	10,664.00	0.04
480	600259	广晟有色	200	10,624.00	0.04
481	688155	先惠技术	200	10,324.00	0.04
482	688787	海天瑞声	97	10,299.46	0.04
483	301606	绿联科技	200	10,286.00	0.04
484	603267	鸿远电子	200	10,054.00	0.04
485	301600	慧翰股份	100	9,796.00	0.04
486	000737	北方铜业	900	9,774.00	0.04
487	001301	尚太科技	200	9,752.00	0.04
488	301551	无线传媒	200	9,748.00	0.04
489	001339	智微智能	200	9,666.00	0.03
490	688088	虹软科技	200	9,650.00	0.03
491	688521	芯原股份	100	9,650.00	0.03
492	300570	太辰光	100	9,638.00	0.03
493	301205	联特科技	100	9,586.00	0.03
494	688686	奥普特	100	9,562.00	0.03
495	300100	双林股份	200	9,416.00	0.03
496	300913	兆龙互连	200	9,364.00	0.03
497	688270	臻镭科技	200	9,312.00	0.03
498	002881	美格智能	200	9,280.00	0.03
499	688190	云路股份	100	9,256.00	0.03
500	688209	英集芯	500	9,235.00	0.03
501	605296	神农集团	300	9,222.00	0.03
502	001287	中电港	500	9,155.00	0.03
503	688116	天奈科技	200	9,154.00	0.03
504	002315	焦点科技	200	9,138.00	0.03
505	300226	上海钢联	400	9,136.00	0.03
506	300641	正丹股份	400	9,116.00	0.03
507	000935	四川双马	500	9,110.00	0.03
508	000049	德赛电池	400	9,104.00	0.03
509	300674	宇信科技	300	9,087.00	0.03
510	688147	微导纳米	300	9,054.00	0.03
511	300762	上海瀚讯	400	9,052.00	0.03
512	001308	康冠科技	400	9,048.00	0.03
513	301510	固高科技	300	9,015.00	0.03
514	300655	晶瑞电材	900	9,009.00	0.03

515	688584	上海合晶	500	8,940.00	0.03
516	301109	军信股份	600	8,928.00	0.03
517	600216	浙江医药	600	8,874.00	0.03
518	600338	西藏珠峰	800	8,872.00	0.03
519	300008	天海防务	1,200	8,868.00	0.03
520	300184	力源信息	900	8,838.00	0.03
521	603698	航天工程	500	8,810.00	0.03
522	002434	万里扬	1,200	8,796.00	0.03
523	603297	永新光学	100	8,735.00	0.03
524	603306	华懋科技	200	8,700.00	0.03
525	688567	孚能科技	600	8,700.00	0.03
526	002896	中大力德	150	8,686.50	0.03
527	603393	新天然气	300	8,685.00	0.03
528	002194	武汉凡谷	600	8,676.00	0.03
529	688146	中船特气	300	8,673.00	0.03
530	300596	利安隆	300	8,631.00	0.03
531	300685	艾德生物	400	8,612.00	0.03
532	600550	保变电气	1,000	8,600.00	0.03
533	688348	XD 昱能科	200	8,594.00	0.03
534	603236	移远通信	100	8,580.00	0.03
535	301500	飞南资源	400	8,568.00	0.03
536	300493	润欣科技	400	8,508.00	0.03
537	600058	五矿发展	1,100	8,503.00	0.03
538	603383	顶点软件	200	8,480.00	0.03
539	603588	高能环境	1,500	8,460.00	0.03
540	002611	东方精工	700	8,442.00	0.03
541	002690	美亚光电	500	8,435.00	0.03
542	000837	秦川机床	700	8,414.00	0.03
543	603025	大豪科技	600	8,412.00	0.03
544	603127	昭衍新药	400	8,412.00	0.03
545	600186	莲花控股	1,400	8,400.00	0.03
546	002034	旺能环境	500	8,395.00	0.03
547	002010	传化智联	1,500	8,370.00	0.03
548	300088	长信科技	1,400	8,344.00	0.03
549	300687	赛意信息	300	8,334.00	0.03
550	002840	华统股份	800	8,328.00	0.03
551	601778	晶科科技	2,800	8,316.00	0.03
552	688403	汇成股份	800	8,312.00	0.03
553	002928	华夏航空	1,000	8,310.00	0.03
554	600320	振华重工	1,900	8,303.00	0.03
555	000902	新洋丰	600	8,298.00	0.03
556	300185	通裕重工	2,900	8,294.00	0.03
557	002093	国脉科技	700	8,281.00	0.03

558	000089	深圳机场	1,200	8,280.00	0.03
559	600179	安通控股	3,000	8,280.00	0.03
560	688327	云从科技	600	8,274.00	0.03
561	301297	富乐德	200	8,266.00	0.03
562	300182	捷成股份	1,500	8,265.00	0.03
563	300133	华策影视	1,100	8,261.00	0.03
564	603609	禾丰股份	1,000	8,260.00	0.03
565	600063	皖维高新	1,800	8,244.00	0.03
566	000970	中科三环	700	8,239.00	0.03
567	601619	嘉泽新能	2,300	8,234.00	0.03
568	603477	巨星农牧	400	8,232.00	0.03
569	300083	创世纪	1,000	8,220.00	0.03
570	003006	百亚股份	300	8,214.00	0.03
571	601801	XD 皖新传	1,200	8,196.00	0.03
572	600163	中闽能源	1,600	8,192.00	0.03
573	600635	大众公用	2,100	8,190.00	0.03
574	603876	鼎胜新材	900	8,181.00	0.03
575	600728	佳都科技	1,500	8,175.00	0.03
576	600266	城建发展	1,800	8,172.00	0.03
577	600986	浙文互联	1,000	8,170.00	0.03
578	002243	力合科创	1,000	8,160.00	0.03
579	601126	四方股份	500	8,135.00	0.03
580	600869	远东股份	1,600	8,128.00	0.03
581	002681	奋达科技	1,200	8,124.00	0.03
582	002239	奥特佳	2,800	8,120.00	0.03
583	600073	光明肉业	1,100	8,118.00	0.03
584	600682	南京新百	1,200	8,064.00	0.03
585	600195	中牧股份	1,100	8,063.00	0.03
586	301215	中汽股份	1,300	8,060.00	0.03
587	000062	深圳华强	300	8,058.00	0.03
588	301069	凯盛新材	500	8,055.00	0.03
589	002489	浙江永强	2,200	8,052.00	0.03
590	600075	新疆天业	1,900	8,037.00	0.03
591	000767	晋控电力	2,800	8,008.00	0.03
592	301526	国际复材	2,200	8,008.00	0.03
593	002091	江苏国泰	1,100	7,997.00	0.03
594	000019	深粮控股	1,200	7,992.00	0.03
595	002761	浙江建投	900	7,983.00	0.03
596	600963	岳阳林纸	1,800	7,974.00	0.03
597	000927	中国铁物	3,100	7,967.00	0.03
598	600006	东风股份	1,100	7,953.00	0.03
599	688630	芯碁微装	100	7,937.00	0.03
600	002004	华邦健康	1,900	7,923.00	0.03

601	002061	浙江交科	2,000	7,920.00	0.03
602	600552	凯盛科技	700	7,910.00	0.03
603	605507	国邦医药	400	7,908.00	0.03
604	000685	中山公用	900	7,902.00	0.03
605	600490	鹏欣资源	1,800	7,902.00	0.03
606	600138	中青旅	800	7,880.00	0.03
607	688351	微电生理	400	7,880.00	0.03
608	601096	宏盛华源	1,900	7,866.00	0.03
609	601678	滨化股份	1,900	7,866.00	0.03
610	600120	浙江东方	1,300	7,865.00	0.03
611	688372	伟测科技	130	7,852.00	0.03
612	301078	孩子王	600	7,842.00	0.03
613	600976	健民集团	200	7,842.00	0.03
614	601900	南方传媒	500	7,820.00	0.03
615	002051	中工国际	900	7,767.00	0.03
616	688128	中国电研	300	7,350.00	0.03
617	603583	捷昌驱动	200	7,304.00	0.03
618	002901	大博医疗	200	7,248.00	0.03
619	300850	新强联	200	7,164.00	0.03
620	688767	博拓生物	200	7,160.00	0.03
621	301080	百普赛斯	100	7,153.00	0.03
622	688025	杰普特	100	7,150.00	0.03
623	000915	华特达因	200	7,070.00	0.03
624	301068	大地海洋	200	6,860.00	0.02
625	688392	骄成超声	100	6,813.00	0.02
626	688561	奇安信	200	6,796.00	0.02
627	300274	阳光电源	100	6,777.00	0.02
628	603063	禾望电气	200	6,772.00	0.02
629	688559	海目星	200	6,580.00	0.02
630	002074	国轩高科	200	6,492.00	0.02
631	300049	福瑞股份	200	6,486.00	0.02
632	000997	新大陆	200	6,476.00	0.02
633	603790	雅运股份	300	6,465.00	0.02
634	300467	迅游科技	300	6,441.00	0.02
635	002738	中矿资源	200	6,432.00	0.02
636	002938	鹏鼎控股	200	6,406.00	0.02
637	600547	山东黄金	200	6,386.00	0.02
638	600835	上海机电	300	6,375.00	0.02
639	300602	飞荣达	300	6,363.00	0.02
640	300843	胜蓝股份	200	6,338.00	0.02
641	300938	信测标准	300	6,303.00	0.02
642	603590	康辰药业	200	6,288.00	0.02
643	300738	奥飞数据	300	6,279.00	0.02

644	002290	禾盛新材	200	6,250.00	0.02
645	603076	乐惠国际	200	6,242.00	0.02
646	603699	纽威股份	200	6,234.00	0.02
647	688093	世华科技	200	6,210.00	0.02
648	002891	中宠股份	100	6,187.00	0.02
649	002414	高德红外	600	6,150.00	0.02
650	002484	江海股份	300	6,147.00	0.02
651	002626	金达威	300	6,138.00	0.02
652	688518	联赢激光	300	6,117.00	0.02
653	600882	妙可蓝多	200	6,106.00	0.02
654	600114	东睦股份	300	6,102.00	0.02
655	603920	世运电路	200	6,102.00	0.02
656	300382	斯莱克	400	6,084.00	0.02
657	603456	九洲药业	400	6,084.00	0.02
658	002624	完美世界	400	6,068.00	0.02
659	603239	浙江仙通	400	6,044.00	0.02
660	600183	生益科技	200	6,030.00	0.02
661	000893	亚钾国际	200	6,028.00	0.02
662	300693	盛弘股份	200	5,992.00	0.02
663	002459	晶澳科技	600	5,988.00	0.02
664	603681	永冠新材	400	5,988.00	0.02
665	601579	会稽山	300	5,973.00	0.02
666	688185	康希诺	100	5,963.00	0.02
667	300244	迪安诊断	400	5,960.00	0.02
668	002149	西部材料	300	5,955.00	0.02
669	002837	英维克	200	5,942.00	0.02
670	300662	科锐国际	200	5,942.00	0.02
671	603185	弘元绿能	400	5,940.00	0.02
672	300739	明阳电路	400	5,936.00	0.02
673	600643	爱建集团	800	5,936.00	0.02
674	688299	长阳科技	300	5,931.00	0.02
675	688310	迈得医疗	400	5,896.00	0.02
676	301180	万祥科技	400	5,892.00	0.02
677	605259	绿田机械	300	5,883.00	0.02
678	688246	嘉和美康	200	5,878.00	0.02
679	603683	晶华新材	400	5,876.00	0.02
680	605255	天普股份	300	5,868.00	0.02
681	600760	中航沈飞	100	5,862.00	0.02
682	002515	金字火腿	1,000	5,860.00	0.02
683	002311	海大集团	100	5,859.00	0.02
684	601231	环旭电子	400	5,852.00	0.02
685	601336	新华保险	100	5,850.00	0.02
686	688006	杭可科技	300	5,850.00	0.02

687	002932	明德生物	300	5,838.00	0.02
688	002148	北纬科技	800	5,824.00	0.02
689	603915	国茂股份	400	5,816.00	0.02
690	002649	博彦科技	400	5,812.00	0.02
691	603927	中科软	300	5,802.00	0.02
692	002221	东华能源	600	5,796.00	0.02
693	300102	乾照光电	500	5,785.00	0.02
694	300910	瑞丰新材	100	5,775.00	0.02
695	300918	南山智尚	300	5,769.00	0.02
696	688393	安必平	200	5,748.00	0.02
697	300756	金马游乐	200	5,738.00	0.02
698	688613	奥精医疗	300	5,736.00	0.02
699	002845	同兴达	400	5,720.00	0.02
700	300383	光环新网	400	5,720.00	0.02
701	603680	今创集团	500	5,715.00	0.02
702	002531	天顺风能	800	5,712.00	0.02
703	688658	悦康药业	300	5,712.00	0.02
704	688678	福立旺	300	5,712.00	0.02
705	600446	金证股份	300	5,691.00	0.02
706	001203	大中矿业	600	5,670.00	0.02
707	002056	横店东磁	400	5,660.00	0.02
708	600668	尖峰集团	400	5,660.00	0.02
709	603118	共进股份	500	5,635.00	0.02
710	603659	璞泰来	300	5,634.00	0.02
711	600478	科力远	900	5,625.00	0.02
712	002392	北京利尔	900	5,616.00	0.02
713	600556	天下秀	1,100	5,610.00	0.02
714	603367	辰欣药业	400	5,608.00	0.02
715	601700	风范股份	1,200	5,604.00	0.02
716	605336	帅丰电器	300	5,601.00	0.02
717	600521	华海药业	300	5,589.00	0.02
718	603109	神驰机电	200	5,588.00	0.02
719	600389	江山股份	300	5,580.00	0.02
720	002057	中钢天源	600	5,574.00	0.02
721	603039	泛微网络	100	5,570.00	0.02
722	000967	盈峰环境	800	5,560.00	0.02
723	000783	长江证券	800	5,544.00	0.02
724	002339	积成电子	700	5,544.00	0.02
725	002378	章源钨业	700	5,537.00	0.02
726	600633	浙数文化	400	5,536.00	0.02
727	000758	中色股份	1,100	5,533.00	0.02
728	002183	怡亚通	1,200	5,532.00	0.02
729	000672	上峰水泥	700	5,530.00	0.02

730	600866	星湖科技	800	5,528.00	0.02
731	601216	君正集团	1,000	5,520.00	0.02
732	003036	泰坦股份	400	5,508.00	0.02
733	300420	五洋自控	1,600	5,504.00	0.02
734	605050	福然德	400	5,500.00	0.02
735	603586	金麒麟	300	5,496.00	0.02
736	000987	越秀资本	800	5,488.00	0.02
737	600458	时代新材	400	5,488.00	0.02
738	603087	甘李药业	100	5,478.00	0.02
739	000676	智度股份	600	5,472.00	0.02
740	300359	全通教育	900	5,463.00	0.02
741	601311	XD 骆驼股	600	5,418.00	0.02
742	300825	阿尔特	500	5,405.00	0.02
743	300557	理工光科	200	5,400.00	0.02
744	002212	天融信	700	5,390.00	0.02
745	600578	京能电力	1,200	5,388.00	0.02
746	603885	吉祥航空	400	5,388.00	0.02
747	300889	爱克股份	400	5,384.00	0.02
748	000680	山推股份	600	5,382.00	0.02
749	300636	同和药业	700	5,376.00	0.02
750	002838	道恩股份	300	5,373.00	0.02
751	000563	陕国投 A	1,500	5,355.00	0.02
752	600880	博瑞传播	1,000	5,350.00	0.02
753	002706	良信股份	600	5,346.00	0.02
754	002860	星帅尔	400	5,336.00	0.02
755	300586	美联新材	500	5,335.00	0.02
756	000009	中国宝安	600	5,328.00	0.02
757	002324	普利特	500	5,315.00	0.02
758	002191	劲嘉股份	1,300	5,304.00	0.02
759	000030	富奥股份	900	5,301.00	0.02
760	603108	润达医疗	300	5,298.00	0.02
761	002436	兴森科技	400	5,296.00	0.02
762	300283	温州宏丰	800	5,296.00	0.02
763	600741	华域汽车	300	5,295.00	0.02
764	300926	博俊科技	200	5,294.00	0.02
765	300669	沪宁股份	200	5,284.00	0.02
766	605196	华通线缆	300	5,283.00	0.02
767	600999	招商证券	300	5,277.00	0.02
768	600595	中孚实业	1,200	5,256.00	0.02
769	603701	德宏股份	300	5,244.00	0.02
770	600732	爱旭股份	400	5,240.00	0.02
771	603333	尚纬股份	700	5,236.00	0.02
772	300440	运达科技	500	5,225.00	0.02

773	300348	长亮科技	300	5,217.00	0.02
774	300181	佐力药业	300	5,199.00	0.02
775	301221	光庭信息	100	5,197.00	0.02
776	688505	复旦张江	600	5,196.00	0.02
777	300583	赛托生物	300	5,172.00	0.02
778	300765	新诺威	100	5,169.00	0.02
779	603933	睿能科技	300	5,166.00	0.02
780	002215	诺普信	500	5,165.00	0.02
781	002025	航天电器	100	5,141.00	0.02
782	300894	火星号	400	5,132.00	0.02
783	002202	金风科技	500	5,125.00	0.02
784	000682	东方电子	500	5,120.00	0.02
785	605018	长华集团	400	5,096.00	0.02
786	300409	道氏技术	300	5,082.00	0.02
787	603218	日月股份	400	5,076.00	0.02
788	000766	通化金马	200	5,074.00	0.02
789	300901	中胤时尚	300	5,073.00	0.02
790	688156	路德环境	300	5,073.00	0.02
791	300035	中科电气	300	5,064.00	0.02
792	603386	骏亚科技	400	5,060.00	0.02
793	603636	南威软件	400	5,056.00	0.02
794	300487	蓝晓科技	100	5,030.00	0.02
795	688089	嘉必优	200	5,030.00	0.02
796	002270	华明装备	300	5,022.00	0.02
797	688219	会通股份	400	5,020.00	0.02
798	603159	上海亚虹	300	5,019.00	0.02
799	300723	一品红	100	5,012.00	0.02
800	603950	长源东谷	200	5,006.00	0.02
801	002907	华森制药	300	4,995.00	0.02
802	000933	神火股份	300	4,992.00	0.02
803	601717	郑煤机	300	4,986.00	0.02
804	603203	快克智能	200	4,974.00	0.02
805	300450	先导智能	200	4,970.00	0.02
806	002096	易普力	400	4,964.00	0.02
807	603112	华翔股份	300	4,962.00	0.02
808	300442	润泽科技	100	4,953.00	0.02
809	002281	光迅科技	100	4,932.00	0.02
810	001207	联科科技	200	4,908.00	0.02
811	300759	康龙化成	200	4,908.00	0.02
812	301101	明月镜片	100	4,895.00	0.02
813	300174	元力股份	300	4,890.00	0.02
814	002352	顺丰控股	100	4,876.00	0.02
815	002126	银轮股份	200	4,856.00	0.02

816	688510	航亚科技	200	4,836.00	0.02
817	603379	三美股份	100	4,812.00	0.02
818	000807	云铝股份	300	4,794.00	0.02
819	688591	泰凌微	100	4,790.00	0.02
820	002931	锋龙股份	300	4,785.00	0.02
821	002130	沃尔核材	200	4,764.00	0.02
822	688321	微芯生物	200	4,756.00	0.02
823	300585	奥联电子	300	4,755.00	0.02
824	002294	信立泰	100	4,733.00	0.02
825	002929	润建股份	100	4,726.00	0.02
826	601689	拓普集团	100	4,725.00	0.02
827	605008	长鸿高科	300	4,725.00	0.02
828	300620	光库科技	100	4,711.00	0.02
829	000988	华工科技	100	4,701.00	0.02
830	688319	欧林生物	300	4,698.00	0.02
831	603179	新泉股份	100	4,697.00	0.02
832	301178	天亿马	100	4,670.00	0.02
833	603979	金诚信	100	4,644.00	0.02
834	002402	和而泰	200	4,634.00	0.02
835	603308	应流股份	200	4,616.00	0.02
836	605020	永和股份	200	4,608.00	0.02
837	300014	亿纬锂能	100	4,581.00	0.02
838	300679	电连技术	100	4,538.00	0.02
839	600285	羚锐制药	200	4,534.00	0.02
840	300101	振芯科技	200	4,526.00	0.02
841	300443	金雷股份	200	4,520.00	0.02
842	300752	隆利科技	200	4,496.00	0.02
843	301096	百诚医药	100	4,490.00	0.02
844	300660	江苏雷利	100	4,424.00	0.02
845	605133	嵘泰股份	100	4,408.00	0.02
846	301188	力诺药包	200	4,326.00	0.02
847	603171	税友股份	100	4,291.00	0.02
848	300911	亿田智能	100	4,246.00	0.02
849	603228	景旺电子	100	4,184.00	0.02
850	301042	安联锐视	100	4,114.00	0.01
851	000963	华东医药	100	4,036.00	0.01
852	002988	豪美新材	100	3,800.00	0.01
853	605088	冠盛股份	100	3,792.00	0.01
854	002384	东山精密	100	3,777.00	0.01
855	603737	三棵树	100	3,685.00	0.01
856	688596	正帆科技	100	3,392.00	0.01
857	688339	亿华通	100	2,135.00	0.01

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入 金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	603601	再升科技	527,149.00	1.92
2	003031	中瓷电子	493,892.00	1.80
3	603508	思维列控	476,406.00	1.73
4	603309	维力医疗	469,412.00	1.71
5	600268	国电南自	456,914.40	1.66
6	601609	金田股份	450,015.00	1.64
7	600020	中原高速	447,022.00	1.63
8	603043	广州酒家	405,963.00	1.48
9	688201	信安世纪	405,510.26	1.48
10	002454	松芝股份	400,767.00	1.46
11	002777	久远银海	370,494.00	1.35
12	002012	凯恩股份	357,325.00	1.30
13	300976	达瑞电子	354,391.00	1.29
14	603187	海容冷链	354,098.00	1.29
15	600757	长江传媒	352,013.00	1.28
16	000751	锌业股份	349,231.00	1.27
17	600990	四创电子	348,073.00	1.27
18	300389	艾比森	338,473.00	1.23
19	601098	中南传媒	333,530.00	1.21
20	300743	天地数码	331,879.00	1.21

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出 金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	603508	思维列控	537,467.00	1.96
2	603601	再升科技	459,468.40	1.67
3	600268	国电南自	453,893.40	1.65
4	003031	中瓷电子	452,926.60	1.65
5	601609	金田股份	442,949.00	1.61
6	603043	广州酒家	426,567.00	1.55
7	002777	久远银海	426,144.00	1.55
8	688201	信安世纪	420,759.25	1.53
9	603699	纽威股份	409,042.00	1.49
10	603309	维力医疗	403,314.00	1.47
11	600990	四创电子	390,651.00	1.42
12	601098	中南传媒	389,205.00	1.42

13	601886	江河集团	386,000.00	1.40
14	688007	光峰科技	384,906.74	1.40
15	600020	中原高速	376,402.00	1.37
16	002461	珠江啤酒	369,178.00	1.34
17	300743	天地数码	358,915.00	1.31
18	300976	达瑞电子	345,611.20	1.26
19	300134	大富科技	331,774.00	1.21
20	002818	富森美	331,201.00	1.20

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	217,294,827.57
卖出股票收入（成交）总额	222,754,244.48

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无余额。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

无余额。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无余额。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无余额。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无余额。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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，广州达意隆包装机械股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到广州市黄埔区云埔街道办事处处罚。

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。

7.12.2 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。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	301,891.20
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	120,196.93
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	422,088.13

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无余额。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无余额。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
中信建投睿利 A	413	33,587.53	10,299,137.13	74.2460%	3,572,510.78	25.7540%
中信建投睿利 C	612	12,691.35	3,209,625.25	41.3233%	4,557,478.86	58.6767%
合计	988	21,901.57	13,508,762.38	62.4286%	8,129,989.64	37.5714%

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。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	中信建投睿利 A	24,244.43	0.1748%
	中信建投睿利 C	0.00	0.0000%
	合计	24,244.43	0.1120%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	中信建投睿利 A	0~10
	中信建投睿利 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	中信建投睿利 A	0~10
	中信建投睿利 C	0
	合计	0~10

8.4 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。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	中信建投睿利 A	中信建投睿利 C
基金合同生效日（2016 年 12 月 07 日）基金份额总额	47,686,882.68	—

本报告期期初基金份额总额	16,578,645.40	8,851,810.38
本报告期基金总申购份额	1,287,194.23	2,119,894.01
减：本报告期基金总赎回份额	3,994,191.72	3,204,600.28
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	13,871,647.91	7,767,104.11

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，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。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务，本报告期内未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，未发生基金管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	------	------	-----------	----

	数量	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	3	440,049,072.05	100.00%	193,393.61	100.00%	-

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

2、本报告期内，本基金办理证券投资委托的证券公司未发生变更。

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。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	关于警惕冒用中信建投基金管理有限公司名义进行诈骗活动的重要通知	规定网站	2025-01-14
2	中信建投基金管理有限公司旗下全部基金 2024 年第 4 季度报告提示性公告	规定报刊	2025-01-22
3	中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金 2024 年第 4 季度报告	规定网站	2025-01-22
4	中信建投基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度）	规定网站	2025-03-31
5	中信建投基金管理有限公司旗下全部基金 2024 年年度报告提示性公告	规定报刊	2025-03-31
6	中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金 2024 年年度报告	规定网站	2025-03-31
7	中信建投基金管理有限公司关	规定网站、规定报刊	2025-04-11

	于运用自有资金投资旗下权益类公募基金的公告		
8	中信建投基金管理有限公司旗下全部基金 2025 年第 1 季度报告提示性公告	规定报刊	2025-04-22
9	中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	规定网站	2025-04-22

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20250418-20250514	4,125,069.78	0.00	0.00	4,125,069.78	19.0633%
	2	20250101-20250630	11,378,337.13	0.00	3,080,000.00	8,298,337.13	38.3494%
产品特有风险							
本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额 20%的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产，有可能对基金净值产生一定的影响，甚至可能引发基金的流动性风险。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，无影响投资者决策的其他重要信息。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

12.3 查阅方式

投资者可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
二〇二五年八月二十九日