

中信建投睿泰灵活配置混合型证券投资基金

2017 年年度报告

2017 年 12 月 31 日

基金管理人:中信建投基金管理有限公司

基金托管人:中国邮政储蓄银行股份有限公司

送出日期:2018 年 03 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2018 年 3 月 26 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。

本报告中财务资料经审计。普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2017 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	11
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
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	16
§6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
§7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	21
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	22
7.4 报表附注	23
§8 投资组合报告	47
8.1 期末基金资产组合情况	47
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	48
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	49
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	52
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	105
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	105
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	105
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	105
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	105
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	105

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	105
8.12 投资组合报告附注.....	105
§9 基金份额持有人信息.....	106
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	107
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	107
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.....	107
§10 开放式基金份额变动.....	108
§11 重大事件揭示.....	108
11.1 基金份额持有人大会决议.....	108
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.....	108
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	108
11.4 基金投资策略的改变.....	108
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	109
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.....	109
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	109
11.8 其他重大事件.....	111
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	113
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.....	113
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	114
§13 备查文件目录.....	114
13.1 备查文件目录.....	114
13.2 存放地点.....	114
13.3 查阅方式.....	114

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中信建投睿泰灵活配置混合型证券投资基金	
基金简称	中信建投睿泰	
基金主代码	003974	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2017年02月14日	
基金管理人	中信建投基金管理有限公司	
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	36,383,006.66份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中信建投睿泰A	中信建投睿泰C
下属分级基金的交易代码	003974	003975
报告期末下属分级基金的份额总额	36,325,637.14份	57,369.52份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过对多种投资策略的有机结合，在有效控制风险的前提下，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×30% + 中证综合债指数收益率×70%
风险收益特征	本基金属于混合型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金，属于证券投资基金中中高预期风险、中高预期收益的品

	种。
--	----

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	中信建投基金管理有限公司	中国邮政储蓄银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	张乐久
	联系电话	010-57760122
	电子邮箱	zhanglj@csc.com.cn
客户服务电话	4009-108-108	95580
传真	010-59100298	010-68858120
注册地址	北京市怀柔区桥梓镇八龙桥雅苑3号楼1室	北京市西城区金融大街 3 号
办公地址	北京市东城区朝内大街2号凯恒中心B座17、19 层	北京市西城区金融大街 3 号 A 座
邮政编码	100010	100808
法定代表人	蒋月勤	李国华

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	基金管理人和基金托管人的办公场所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	中国上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场二座普华永道中心11楼
注册登记机构	中信建投基金管理有限公司	北京市东城区朝阳门内大街2号凯恒中心B座17、19层

§ 3 主要财务指标、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	本期2017年02月14日（基金合同生效日）- 2017年12月31日	
	中信建投睿泰A	中信建投睿泰C
本期已实现收益	-22,996,927.69	-10,270.49
本期利润	-24,094,746.02	-9,862.28
加权平均基金份额本期利润	-0.1436	-0.1238
本期加权平均净值利润率	-15.65%	-13.52%
本期基金份额净值增长率	-13.50%	-13.57%
3.1.2 期末数据和指标	2017年末	
期末可供分配利润	-5,104,655.80	-8,101.68
期末可供分配基金份额利润	-0.1405	-0.1412
期末基金资产净值	31,421,584.71	49,584.16
期末基金份额净值	0.8650	0.8643
3.1.3 累计期末指标	2017年末	
基金份额累计净值增长率	-13.50%	-13.57%

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。

4、本基金合同自2017年2月14日起生效，无上年可比期间数据。

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

中信建投睿泰A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-6.01%	0.78%	1.20%	0.25%	-7.21%	0.53%
过去六个月	-3.10%	0.78%	3.06%	0.21%	-6.16%	0.57%
自基金合同生效起至今	-13.50%	0.84%	5.63%	0.20%	-19.13%	0.64%

中信建投睿泰C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-6.02%	0.78%	1.20%	0.25%	-7.22%	0.53%
过去六个月	-3.14%	0.78%	3.06%	0.21%	-6.20%	0.57%
自基金合同生效起至今	-13.57%	0.84%	5.63%	0.20%	-19.20%	0.64%

注：本基金合同生效日为 2017 年 2 月 14 日，至本报告期末未满一年。

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

中信建投睿泰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

(2017年02月14日-2017年12月31日)



中信建投睿泰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02月14日-2017年12月31日)

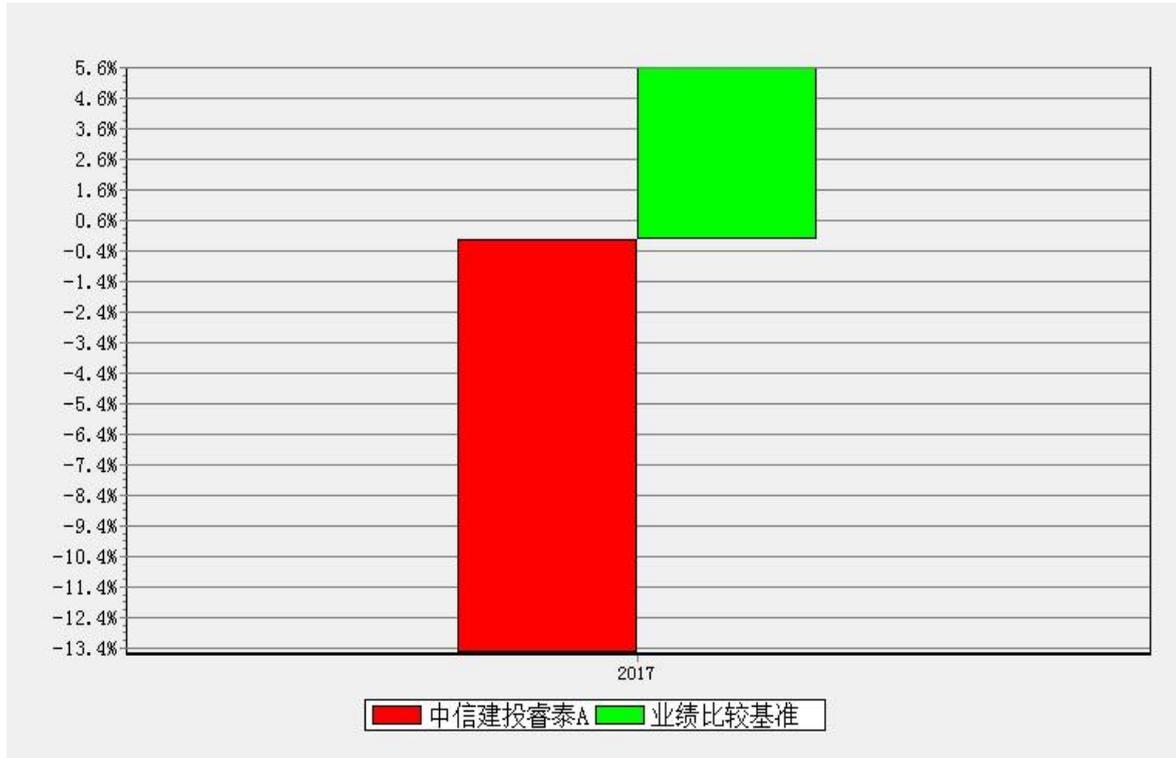


注：1、图 1 为中信建投睿泰 A 基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图，绘图日期为 2017 年 2 月 14 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日；

2、图 2 为中信建投睿泰 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 2 月 14 日（基金合同生效日）至 2017 年 12 月 31 日；
 3、本基金合同自 2017 年 2 月 14 日起生效，至本报告期末未满一年。

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





3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自成立以来未实施利润分配。

§ 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于2013年9月9日在北京正式注册成立，主要经营基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务。公司子公司元达信资本管理（北京）有限公司于2015年6月8日成立。依托强大的股东背景，经过4年的基础建设及资源、业务、经验的积累，公司业务呈现发展趋势。公司秉承“忠于信，健于投”的经营理念，追求以稳健的投资及良好的收益，回馈客户的信任，公司投资业绩稳健，以良好的投资回报实现了投资人资产的保值增值。公司机构客户资源丰富，涵盖商业银行、证券公司、信托公司、保险公司、财务公司、私募基金等；深度开展各类客户的拓展维护，与大型商业银行及农村商业银行均开展不同程度的合作。公司构建了涵盖风险收益高中低各类产品在内的产品体系，公募基金涵盖混合型、债券型、货币型等多种产品类型；专户产品在量化投资、资产证券化等多个领域均取得了良好的业绩；同时公司积极践行“金融服务实体经济的本质要求”，与相关政府部门、金融机构共同开

发国企改革基金、市值管理基金、产业基金等创新业务，通过产品创新和业务创新为国家经济政策的调整和实体经济的发展贡献应有之力。

公司积极践行社会责任，在各项工作中均以保护投资者、合作伙伴利益为基础；在 2016-2017 年连续两年获得怀柔区“年度经济发展贡献奖”。同时，公司在固定收益等专业领域业绩卓著，荣获全国银行间同业拆借中心“2017 年度银行间本币市场交易 300 强”、中央国债登记结算有限责任公司“2017 年度中债优秀成员”、深圳证券交易所“2017 年度优秀债券交易商”、上海证券交易所“2016 年度优秀债券交易商”、“2017 年度优秀债券交易商”、中金所“2014 年度国债期货优秀市场拓展团队”、“2015 年度国债期货优秀市场拓展团队”荣誉称号。

2018 年，公司将努力提升投研实力，加快产品创新，加大与机构客户合作，增强核心竞争力，实现管理规模平稳增长，将公司打造成为国内有特色的基金管理公司。

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		
周户	本基金的 基金经理	2017-02- 14	-	9 年	中国籍，1982 年 2 月生，南开大学经济学硕士。曾任苏州博思堂经纪顾问有限公司市场分析师、渤海证券股份有限公司研究员、广发证券股份有限公司研究员、国金通用基金管理有限公司研究员、国金证券股份有限公司研究员。2014 年 6 月至今任职于中信建投基金管理有限公司投资研究部，现担任中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金、中信建投睿泰灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
王晓贞	本基金的 基金经理	2017-05- 18	-	6 年	中国籍，1982 年 11 月生，山东大学理学硕士。曾在中航证券有限公司从事投资、研究工作。现任本公司产品与金融工程部

					基金经理，担任中信建投睿泰灵活配置混合型证券投资基金、中信建投睿泰灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	---

注：1、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行业协会《证券业从业人员资格管理办法》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》、《证券投资基金销售管理办法》、《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，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

2017年，全球经济同步改善，美国、欧洲经济复苏预期不断加强；国内经济缓步提升，波动性依然较小，出口和工业增加值回升，景气指数改善，投资和消费呈放缓态势。基于对宏观经济的乐观判断，整个2017年本基金主要以配置股票为主。选股主要采用自下而上的定量分析方法，进行分散化投资。

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泰A基金份额净值为0.8650元；本报告期内，基金份额净值增长率为-13.5%，同期业绩比较基准收益率为5.63%；截至报告期末中信建投睿泰C基金份额净值为0.8643元；本报告期内，基金份额净值增长率为-13.57%，同期业绩比较基准收益率为5.63%。

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2018年，国内经济仍有可能处于窄幅波动阶段，PPI有望回落，CPI有望回升，制造业投资复苏的强度和基建、房地产等投资回落的幅度之间的对冲程度有待观察，外需平稳，因此宏观经济环境总体较为平稳。政策面，金融监管政策进入落地实施阶段，其影响有待观察；财政政策仍有可能偏积极，货币政策维持稳健偏紧。总体来讲，宏观经济环境较为平稳，局部领域有望进入成长回升期，PPI向CPI传导的效应、制造业复苏的强度、金融监管政策落地执行的影响等，为未来经济增长增添不确定性。

展望2018年，平稳的宏观环境将为权益市场奠定较好的基础，然而，政策监管的高压和流动性偏紧状态将抑制估值水平的提升，投资性机会更多以结构性为主，本基金将继续保持较高的股票投资比例，选股采用分散化投资策略，从市场的微观结构出发，完全定量分析构建股票投资组合。

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，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，对基金的宣传推介、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

本基金遵循下列报表附注所述的估值政策和估值原则对基金持有的资产和负债进行估值。

为确保估值政策和估值原则的合理合法性，公司成立估值委员会和风险内控小组。公司分管运营领导任估值委员会负责人，委员包括督察长、投资研究部、特定资产管理部、稽控合规部、运营管理部的主要负责人，主要负责投资品种估值政策的制定和公允价值的计算，并在定期报告中计算公允价值对基金资产净值及当期损益的影响。

在严格遵循公平、合理原则下，公司制订了健全、有效的估值政策流程：

1. 运营管理部基金会计每天按照相关政策对基金资产和负债进行估值并计算基金净值，公司与中央国债登记结算有限责任公司签署了《中债收益率曲线和中债估值最终用户服务协议》，并依据其提供的中债收益率曲线及估值价格对公司旗下基金持有的银行间固定收益品种进行估值（适用于非货币基金）或影子定价（适用于货币基金和理财类基金）；公司与中证指数有限公司签署了《债券估值数据服务协议》，并依据其提供的估值价格对公司旗下基金持有的交易所固定收益品种进行估值。

2. 由估值委员会确认基金持有的投资品种是否采用估值方法确定公允价值，若确定用估值方法计算公允价值，则在参考基金业协会的意见或第三方意见后确定估值方法；

3. 由估值委员会计算该投资品种的公允价值，并将计算结果提交公司管理层；

4. 公司管理层审批后，该估值方法方可实施。

为了确保旗下基金持有投资品种进行估值时估值政策和程序的一贯性，风险内控小组应定期对估值政策、程序及估值方法进行考核，并建立风险防控标准。在考虑投资策略的情况下，公司旗下的不同基金持有的同一证券的估值政策、程序及相关的方法应保持一致。除非产生需要更新估值政策或程序的情形，已确定的估值政策和程序应当持续适用。

估值委员会应互相协助定期对估值政策和程序进行评价，在发生了影响估值政策和程序的有效性及适用性的情况后应及时修订估值方法，以保证其持续适用。估值政策和程序的修订建议由估值委员会提议，并提交公司管理层，待管理层审批后方可实施。公司旗下基金在采用新投资策略或投资新品种时，应由估值委员会对现有估值政策和程序的适用性做出评价。

在采用估值政策和程序时，估值委员会应当审查并充分考虑参与估值流程各部门及人员的经验、专业胜任能力和独立性，通过参考行业协会估值意见、参考托管行及其他独立第三方机构估值数据等一种或多种方式的有效结合，减少或避免估值偏差的发生。

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

本基金本报告期内未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

2017年，基金托管人在中信建投睿泰灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同、托管协议，尽职尽责地履行了托管人应尽的义务，不存在任何损害基金持有人利益的行为。

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

2017年，中信建投基金管理有限公司在中信建投睿泰灵活配置混合型证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上，托管人未发现损害基金持有人利益的行为。

本报告期内本基金未进行收益分配。

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

2017年，由中信建投基金管理有限公司编制并经托管人复核审查的有关中信建投睿泰灵活配置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	带强调事项段的无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2018)第20304号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	中信建投睿泰灵活配置混合型证券投资基金 全体基金份额持有人
审计意见	我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中

	<p>国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了中信建投睿泰基金2017年12月31日的财务状况以及2017年2月14日(基金合同生效日)至2017年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<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。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。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于中信建投睿泰基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	<p>我们提醒财务报表使用者关注,如财务报表附注“7.4.2会计报表的编制基础”所述,中信建投睿泰基金的基金管理人中信建投基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)拟在资产负债表日后清算中信建投睿泰基金的剩余资产。因此,上述中信建投睿泰基金的财务报表以清算基础编制。该事项不影响已发表的审计意见。</p>
其他事项	-
其他信息	-
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,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。在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估中信建投睿泰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,除非基金管理人管理层计划清算中信建投睿泰基金、终止运营或别无其他现实的选</p>

	<p>择，参见财务报表附注 7.4.2 有关以清算基础编制财务报表的说明。基金管理人治理层负责监督中信建投睿泰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。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：（一）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。（二）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。（三）评价基金管理人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。（四）对基金管理人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，就可能对中信建投睿泰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。（五）评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反</p>

	映相关交易和事项。我们与基金管理人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。
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	-
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场二座普华永道中心11楼
审计报告日期	2018-03-26

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：中信建投睿泰灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2017年12月31日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2017年12月31日
资 产：		
银行存款	7.4.7.1	3,346,112.41
结算备付金		1,828,567.67
存出保证金		93,970.39
交易性金融资产	7.4.7.2	26,797,519.20
其中：股票投资		26,797,519.20
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		-
应收利息	7.4.7.5	2,140.31

应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		32,068,309.98
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017年12月31日
负 债:		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		26,893.30
应付托管费		4,482.22
应付销售服务费		4.30
应付交易费用	7.4.7.7	415,761.29
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	150,000.00
负债合计		597,141.11
所有者权益:		
实收基金	7.4.7.9	36,383,006.66
未分配利润	7.4.7.10	-4,911,837.79
所有者权益合计		31,471,168.87
负债和所有者权益总计		32,068,309.98

注：1. 报告截止日2017年12月31日，基金份额总额36,383,006.66份。其中A类基金份额净值0.8650元，基金份额总额36,325,637.14份；C类基金份额净值0.8643元，基金份

额总额57,369.52份；

2. 本财务报表的实际编制期间为2017年2月14日(基金合同生效日)至2017年12月31日。

7.2 利润表

会计主体：中信建投睿泰灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017年02月14日（基金合同生效日）至2017年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2017年02月14日(基金合同生效日)至2017年12月31日
一、收入		-19,778,514.47
1. 利息收入		336,856.98
其中：存款利息收入	7.4.7.11	133,645.87
债券利息收入		1,904.89
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		201,306.22
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-19,111,820.88
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-19,649,331.84
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-541.50
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	7.4.7.14	-
股利收益	7.4.7.15	538,052.46
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-1,097,410.12
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	93,859.55
减：二、费用		4,326,093.83
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	812,720.49

2. 托管费	7.4.10.2.2	135,453.36
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	63.87
4. 交易费用	7.4.7.18	3,218,456.11
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 其他费用	7.4.7.19	159,400.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-24,104,608.30
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-24,104,608.30

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中信建投睿泰灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2017年02月14日（基金合同生效日）至2017年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2017年02月14日（基金合同生效日）至2017年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	200,279,994.30	-	200,279,994.30
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-24,104,608.30	-24,104,608.30
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-163,896,987.64	19,192,770.51	-144,704,217.13
其中：1. 基金申购款	197,884.06	-13,643.85	184,240.21
2. 基金赎回款	-164,094,871.70	19,206,414.36	-144,888,457.34
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净	36,383,006.66	-4,911,837.79	31,471,168.87

值)			
----	--	--	--

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：

蒋月勤

高翔

陈莉君

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

中信建投睿泰灵活配置混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2016]第2794号《关于准予中信建投睿泰灵活配置混合型证券投资基金注册的批复》核准,由中信建投基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中信建投睿泰灵活配置混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,业经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(2017)第058号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《中信建投睿泰灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2017年2月14日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为200,279,994.30份基金份额,其中认购资金利息折合11,224.20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,基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司(以下简称“邮储银行”)。

根据《中信建投睿泰灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和《中信建投睿泰灵活配置混合型证券投资基金招募说明书》并报中国证监会备案,本基金根据认购/申购费用、销售服务费用收取方式的不同,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,但不再从本类别基金资产中计提销售服务费的一类基金份额,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不收取认购/申购费用的一类基金份额,称为C类基金份额。本基金A类基金份额和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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中信建投睿泰灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、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、地方政府债、企业债、公司债、中期票据、短期融资券、超级短期融资券、次级债券、可转换债券、分离交易可转债、可交换债券及其他中国证监会允许投资的债券)、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)、货币市场工具(包括同业存单)、

权证、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(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人将在履行适当程序后,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%;持有全部权证的市值不得超过基金资产净值的3%;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,基金管理人将在履行适当程序后,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*30%+中证综合债指数收益率*70%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《中信建投睿泰灵活配置混合型证券投资基金 基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

据《中信建投睿泰灵活配置混合型证券投资基金基金合同》以及基金管理人中信建投基金管理有限公司于2018年3月24日发布的《中信建投睿泰灵活配置混合型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》,本基金于2018年3月24日进入财产清算期,详情参见附注7.4.8.2资产负债表日后事项,因此本基金财务报表以清算基础编制。于2017年12月31日,所有资产以可收回金额和账面价值孰低计量,负债以预计需要清偿的金额计量,其中本基金持有的交易性金融资产的可收回金额为其公允价值减去处置费用后的净额与预计未来现金流量的现值两者之间的较高者。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2017年2月14日(基金合同生效日)至2017年12月31日止期间 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 2017年12月31日的财务状况以及 2017年2月14日(基金合同生效日)至2017年12月31日止期间的经营成果和基金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

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2017年2月14日(基金合同生效日)至2017年12月31日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产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资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和资产支持证券投资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。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

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及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产和其他各类应付款项。

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

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的已宣告但尚未发放的现金股利、债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

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

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的

合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和资产支持证券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

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

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占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认列，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

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

其他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

本基金同一基金份额类别内的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

(2)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中央国债登记结算有限责任公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

2、本基金各项资产的可收回金额为资产的公允价值减去处置费用后的净额与资产预计未来现金流量的现值两者之间的较高者。

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

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日
活期存款	3,346,112.41

定期存款	-
其中：存款期限1-3个月	-
其他存款	-
合计	3,346,112.41

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末2017年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	27,894,929.32	26,797,519.20	-1,097,410.12
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	27,894,929.32	26,797,519.20	-1,097,410.12

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

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 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2017年12月31日
应收活期存款利息	1,188.70
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	905.08
应收债券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
其他	46.53
合计	2,140.31

7.4.7.6 其他资产

无余额。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日
交易所市场应付交易费用	415,761.29
银行间市场应付交易费用	-
合计	415,761.29

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提费用	150,000.00
合计	150,000.00

7.4.7.9 实收基金

7.4.7.9.1 中信建投睿泰A

金额单位：人民币元

项目 (中信建投睿泰A)	本期2017年02月14日（基金合同生效日）至2017年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	200,185,264.34	200,185,264.34
本期申购	132,095.88	132,095.88
本期赎回（以“-”号填列）	-163,991,723.08	-163,991,723.08
本期末	36,325,637.14	36,325,637.14

7.4.7.9.2 中信建投睿泰C

金额单位：人民币元

项目 (中信建投睿泰C)	本期2017年02月14日（基金合同生效日）至2017年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	94,729.96	94,729.96
本期申购	65,788.18	65,788.18
本期赎回（以“-”号填列）	-103,148.62	-103,148.62
本期末	57,369.52	57,369.52

注：1. 本基金自2017年1月16日至2017年2月10日止期间公开发售，共募集有效净认购资金200,268,770.10元。根据《中信建投睿泰灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入11,224.20元在本基金成立后，折算为11,224.20份基金份额，划入基金份额持有人账户；

2. 根据《中信建投睿泰灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的相关规定，本基金于2017年2月14日（基金合同生效日）至2017年4月9日止期间暂不向投资人开放基金交易。

7.4.7.10 未分配利润

7.4.7.10.1 中信建投睿泰A

单位：人民币元

项目 (中信建投睿泰A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-22,996,927.69	-1,097,818.33	-24,094,746.02
本期基金份额交易产生的变动数	17,892,271.89	1,298,421.70	19,190,693.59
其中：基金申购款	-4,680.73	-3,272.34	-7,953.07
基金赎回款	17,896,952.62	1,301,694.04	19,198,646.66
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-5,104,655.80	200,603.37	-4,904,052.43

7.4.7.10.2 中信建投睿泰C

单位：人民币元

项目 (中信建投睿泰C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-10,270.49	408.21	-9,862.28
本期基金份额交易产生的变动数	2,168.81	-91.89	2,076.92
其中：基金申购款	-4,392.63	-1,298.15	-5,690.78
基金赎回款	6,561.44	1,206.26	7,767.70
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-8,101.68	316.32	-7,785.36

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2017年02月14日（基金合同生效日）至2017年12月31日
活期存款利息收入	100,670.28
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	31,184.37
其他	1,791.22
合计	133,645.87

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年02月14日（基金合同生效日）至2017年12月31日
卖出股票成交总额	1,424,762,176.06
减：卖出股票成本总额	1,444,411,507.90
买卖股票差价收入	-19,649,331.84

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年02月14日（基金合同生效日）至2017年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	1,826,987.86
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	1,801,390.00
减：应收利息总额	26,139.36
买卖债券差价收入	-541.50

7.4.7.14 衍生工具收益

无。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年02月14日（基金合同生效日）至2017年12月31日
----	--

	日
股票投资产生的股利收益	538,052.46
基金投资产生的股利收益	-
合计	538,052.46

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2017年02月14日（基金合同生效日）至2017年12月31日
1. 交易性金融资产	-1,097,410.12
——股票投资	-1,097,410.12
——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	-
——权证投资	-
3. 其他	-
合计	-1,097,410.12

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年02月14日（基金合同生效日）至2017年12月31日
基金赎回费收入	93,859.55
合计	93,859.55

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%。

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年02月14日（基金合同生效日）至2017年12月31日
交易所市场交易费用	3,218,456.11
银行间市场交易费用	-
合计	3,218,456.11

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年02月14日（基金合同生效日）至2017年12月31日
信息披露费	100,000.00
审计费用	50,000.00
帐户维护费	9,000.00
其他费用	400.00
合计	159,400.00

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

根据《中信建投睿泰灵活配置混合型证券投资基金基金合同》以及基金管理中信建投基金管理有限公司于2018年3月24日发布的《中信建投睿泰灵活配置混合型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》，截至2018年3月23日日终，本基金已出现连续60个工作日基金资产净值低于5000万，触发基金合同终止条款，本基金最后运作日为2018年3月23日。基金管理人中信建投基金管理有限公司将自2018年3月24日起根据相关法律法规、基金合同等规定履行基金财产清算程序。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中信建投基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中国邮政储蓄银行股份有限公司(“邮储银行”)	基金的托管人
中信建投证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金代销机构
航天科技财务有限责任公司	基金管理人的股东
江苏广传广播传媒有限公司	基金管理人的股东

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（基金合同生效日） 2017年02月14日至2017年12月31日	
	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	705,393,586.01	24.38%

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期（基金合同生效日） 2017年02月14日至2017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	374,775.73	24.38%	-	-

注：上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。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。

7.4.10.1.4 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年02月14日（基金合同生效日）至2017年12月31日	
	成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例
中信建投证券股份有限公司	1,801,390.00	50.01%

7.4.10.1.5 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年02月14日（基金合同生效日）至2017年12月31日	
	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	1,402,000,000.00	100.00%

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 2017年02月14日（基金合同生效日）至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	812,720.49
其中：支付销售机构的客户维护费	228.04

注：支付基金管理人 中信建投基金管理有限公司 的管理人报酬按前一日基金资产净值0.60%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值 × 0.60% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年02月14日（基金合同生效日）至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	135,453.36

注：支付基金托管人 邮储银行 的托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

$$\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}。$$

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 2017年02月14日至2017年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中信建投睿泰A	中信建投睿泰C	合计
中信建投基金管理有限公司	-	3.85	3.85
中信建投证券股份有限公司	-	22.90	22.90
合计	-	26.75	26.75

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0.10%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：

$$\text{C类基金日销售服务费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% / \text{当年天数}$$

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 2017年02月14日（基金合同生效日）至2017年12月 31日

	期末余额	当期利息收入
中国邮政储蓄银行股份有限公司	3,346,112.41	100,670.28

注：本基金的银行存款由基金托管人 邮储银行 保管，按银行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—非货币市场基金

无。

7.4.12 期末（2017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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600057	象屿股份	2017-12-28	2018-01-08	配股限售	6.10	8.09	12,750	77,775.00	103,147.50	-

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
3000	金通	2017	重大	15.1	2018	15.3	81,200	1,36	1,23	-

91	灵	-09-21	事项停牌	7	-01-08	8		0,627.44	1,804.00	
600734	实达集团	2017-12-20	重大事项停牌	9.40	-	-	46,800	518,593.65	439,920.00	-
300216	千山药机	2017-12-25	重大事项停牌	15.95	2018-01-18	14.36	15,300	311,789.62	244,035.00	-
600686	金龙汽车	2017-12-28	重大事项停牌	13.03	2018-01-10	13.03	18,600	238,798.86	242,358.00	-
300362	天翔环境	2017-12-28	重大事项停牌	12.92	2018-01-05	13.50	18,700	273,971.70	241,604.00	-
300730	科创信息	2017-12-25	重大事项停牌	41.55	2018-01-02	45.71	821	6,863.56	34,112.55	-

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、稽控合规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，由稽控合规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。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行邮储银行，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均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于2017年12月31日，本基金未持有债券投资。

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可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场上出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

于2017年12月31日，除附注7.4.12中列示的卖出回购金融资产款余额将在1个月内到期且计息(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(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即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》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的 10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的 15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的 30%。

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。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

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

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。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产如下表所示：

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2017年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,346,112.41	-	-	-	3,346,112.41
结算备付金	1,828,567.67	-	-	-	1,828,567.67
存出保证金	93,970.39	-	-	-	93,970.39
交易性金融资产	-	-	-	26,797,519.20	26,797,519.20
应收利息	-	-	-	2,140.31	2,140.31
资产总计	5,268,650.47	-	-	26,799,659.51	32,068,309.98
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	26,893.30	26,893.30
应付托管费	-	-	-	4,482.22	4,482.22
应付销售服务费	-	-	-	4.30	4.30
应付交易费用	-	-	-	415,761.29	415,761.29
其他负债	-	-	-	150,000.00	150,000.00
负债总计	-	-	-	597,141.11	597,141.11
利率敏感度缺口	5,268,650.47	-	-	26,202,518.40	31,471,168.87

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2017年12月31日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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。

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

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

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 2017年12月31日	
	公允价值	占基金资产 净值比例(%)
交易性金融资产-股票投资	26,797,519.20	85.15
交易性金融资产-基金投资	-	-
交易性金融资产-债券投资	-	-

交易性金融资产-贵金属投资	-	-
衍生金融资产-权证投资	-	-
其他	-	-
合计	26,797,519.20	85.15

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 2017年12月31日
	业绩比较基准上升5%	2,253,731.71
	业绩比较基准下降5%	-2,253,731.71

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 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。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2017年12月31日，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中属于第一层次的余额为24,260,538.15元，属于第二层次的余额为2,536,981.05元，无属于第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

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

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2017年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 增值税

根据财政部、国家税务总局于2016年12月21日颁布的财税[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：(1) 金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益)，不征收增值税；(2) 纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；(3) 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。上述政策自2016年5月1日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于2017年1月10日颁布的财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及2017年6月30日颁布的财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。上述税收政策对本基金截至2017年12月31日止的财务状况和经营成果无影响。

(3) 除公允价值和增值税外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	26,797,519.20	83.56
	其中：股票	26,797,519.20	83.56
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-

4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	5,174,680.08	16.14
8	其他各项资产	96,110.70	0.30
9	合计	32,068,309.98	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	-	-
B	采矿业	245,026.00	0.78
C	制造业	15,161,097.15	48.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,191,259.00	3.79
E	建筑业	749,183.00	2.38
F	批发和零售业	1,915,422.00	6.09
G	交通运输、仓储和邮政业	1,209,553.00	3.84
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,214,738.55	3.86
J	金融业	486,410.00	1.55
K	房地产业	1,433,419.00	4.55
L	租赁和商务服务业	753,828.50	2.40
M	科学研究和技术服务业	731,858.00	2.33
N	水利、环境和公共设施管理业	249,795.00	0.79
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	256,944.00	0.82
Q	卫生和社会工作	239,525.00	0.76
R	文化、体育和娱乐业	959,461.00	3.05

S	综合	-	-
	合计	26,797,519.20	85.15

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	占基金资产净值比例(%)
1	300091	金通灵	81,200	1,231,804.00	3.91
2	600057	象屿股份	63,750	515,737.50	1.64
3	600318	新力金融	38,300	486,410.00	1.55
4	600580	卧龙电气	57,400	459,774.00	1.46
5	600734	实达集团	46,800	439,920.00	1.40
6	002892	科力尔	11,000	406,010.00	1.29
7	300396	迪瑞医疗	6,200	270,320.00	0.86
8	600661	新南洋	10,100	256,944.00	0.82
9	300398	飞凯材料	12,100	255,915.00	0.81
10	300237	美晨生态	15,300	255,051.00	0.81
11	000612	焦作万方	27,000	253,800.00	0.81
12	000498	山东路桥	37,900	253,172.00	0.80
13	603818	曲美家居	17,300	251,888.00	0.80
14	603018	中设集团	8,800	251,680.00	0.80
15	002768	国恩股份	8,800	250,536.00	0.80
16	600381	青海春天	23,600	250,396.00	0.80
17	600058	五矿发展	20,700	250,056.00	0.79
18	300388	国祯环保	10,500	249,795.00	0.79
19	002727	一心堂	12,400	249,240.00	0.79
20	603885	吉祥航空	16,300	249,227.00	0.79
21	300320	海达股份	19,300	248,970.00	0.79

22	600531	豫光金铅	38,400	248,832.00	0.79
23	601137	博威合金	21,600	248,832.00	0.79
24	002564	天沃科技	30,300	248,460.00	0.79
25	000657	中钨高新	20,000	248,400.00	0.79
26	600096	云天化	34,600	247,736.00	0.79
27	603599	广信股份	12,600	246,204.00	0.78
28	601368	绿城水务	27,100	246,068.00	0.78
29	002311	海大集团	10,500	245,700.00	0.78
30	603883	老百姓	3,900	245,661.00	0.78
31	600322	天房发展	38,300	245,503.00	0.78
32	600897	厦门空港	10,900	245,032.00	0.78
33	600508	上海能源	20,200	245,026.00	0.78
34	002283	天润曲轴	42,800	244,816.00	0.78
35	600708	光明地产	35,700	244,545.00	0.78
36	600586	金晶科技	53,700	244,335.00	0.78
37	000418	小天鹅A	3,600	244,260.00	0.78
38	600429	三元股份	38,100	244,221.00	0.78
39	300216	千山药机	15,300	244,035.00	0.78
40	002614	蒙发利	12,600	243,810.00	0.77
41	603698	航天工程	12,200	243,634.00	0.77
42	600509	天富能源	35,500	243,530.00	0.77
43	601058	赛轮金宇	67,400	243,314.00	0.77
44	002180	艾派克	8,900	243,059.00	0.77
45	600551	时代出版	20,700	243,018.00	0.77
46	000055	方大集团	40,100	243,006.00	0.77
47	000099	中信海直	26,900	242,638.00	0.77
48	002203	海亮股份	31,100	242,580.00	0.77
49	600686	金龙汽车	18,600	242,358.00	0.77
50	600129	太极集团	14,800	241,980.00	0.77
51	002766	索菱股份	17,100	241,965.00	0.77
52	600764	中国海防	8,700	241,947.00	0.77

53	600590	泰豪科技	22,600	241,820.00	0.77
54	300362	天翔环境	18,700	241,604.00	0.77
55	000791	甘肃电投	30,100	241,101.00	0.77
56	000090	天健集团	24,000	240,960.00	0.77
57	300393	中来股份	6,900	240,810.00	0.77
58	300365	恒华科技	7,600	240,540.00	0.76
59	002617	露笑科技	14,700	240,492.00	0.76
60	600195	中牧股份	12,200	240,462.00	0.76
61	000042	中洲控股	14,800	240,204.00	0.76
62	000719	大地传媒	26,500	240,090.00	0.76
63	600825	新华传媒	38,900	240,013.00	0.76
64	002121	科陆电子	26,800	239,860.00	0.76
65	603718	海利生物	21,700	239,568.00	0.76
66	600896	览海投资	33,500	239,525.00	0.76
67	300309	吉艾科技	11,200	239,344.00	0.76
68	300174	元力股份	8,200	239,276.00	0.76
69	300184	力源信息	21,100	239,274.00	0.76
70	600738	兰州民百	30,300	239,067.00	0.76
71	300118	东方日升	19,700	238,961.00	0.76
72	000407	胜利股份	31,000	238,390.00	0.76
73	300439	美康生物	12,500	238,375.00	0.76
74	000861	海印股份	79,100	238,091.00	0.76
75	002488	金固股份	19,900	238,004.00	0.76
76	300311	任子行	17,000	238,000.00	0.76
77	300451	创业软件	11,000	237,820.00	0.76
78	300232	洲明科技	16,600	237,380.00	0.75
79	300447	全信股份	12,600	237,258.00	0.75
80	600892	大晟文化	25,300	237,061.00	0.75
81	600376	首开股份	25,500	236,895.00	0.75
82	300131	英唐智控	34,500	236,670.00	0.75
83	000828	东莞控股	21,300	236,643.00	0.75

84	600629	华建集团	15,400	236,544.00	0.75
85	000607	华媒控股	39,000	236,340.00	0.75
86	600035	楚天高速	45,300	236,013.00	0.75
87	600693	东百集团	22,900	234,954.00	0.75
88	300219	鸿利智汇	20,900	234,707.00	0.75
89	000534	万泽股份	17,000	234,600.00	0.75
90	300176	鸿特精密	1,800	234,180.00	0.74
91	002515	金字火腿	28,300	234,041.00	0.74
92	300358	楚天科技	19,800	233,838.00	0.74
93	300114	中航电测	22,700	232,675.00	0.74
94	000070	特发信息	24,900	232,566.00	0.74
95	600736	苏州高新	39,200	231,672.00	0.74
96	002164	宁波东力	27,000	231,660.00	0.74
97	000639	西王食品	12,100	229,900.00	0.73
98	300031	宝通科技	15,300	227,205.00	0.72
99	600552	凯盛科技	30,600	225,522.00	0.72
100	600452	涪陵电力	6,500	222,170.00	0.71
101	600211	西藏药业	6,600	221,430.00	0.70
102	603108	润达医疗	18,000	220,500.00	0.70
103	002915	中欣氟材	1,085	38,181.15	0.12
104	300730	科创信息	821	34,112.55	0.11

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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	300451	创业软件	6,806,888.67	21.63
2	601368	绿城水务	6,801,219.66	21.61
3	603018	中设集团	5,802,506.89	18.44
4	600713	南京医药	5,499,068.84	17.47

5	600452	涪陵电力	5,362,688.04	17.04
6	603788	宁波高发	5,202,814.27	16.53
7	000070	特发信息	5,190,951.50	16.49
8	603005	晶方科技	5,120,189.40	16.27
9	600475	华光股份	5,071,053.59	16.11
10	600035	楚天高速	4,932,602.64	15.67
11	300230	永利股份	4,867,940.62	15.47
12	600229	城市传媒	4,769,491.29	15.16
13	600736	苏州高新	4,698,259.42	14.93
14	002516	旷达科技	4,690,525.97	14.90
15	600586	金晶科技	4,577,141.47	14.54
16	600695	绿庭投资	4,571,347.34	14.53
17	000055	方大集团	4,564,909.80	14.51
18	600734	实达集团	4,501,323.59	14.30
19	600217	中再资环	4,359,099.00	13.85
20	300324	旋极信息	4,262,766.35	13.54
21	603306	华懋科技	4,215,550.10	13.39
22	600381	青海春天	4,099,963.94	13.03
23	300219	鸿利智汇	4,091,879.04	13.00
24	300031	宝通科技	4,083,505.00	12.98
25	603698	航天工程	4,064,535.48	12.92
26	300184	力源信息	4,047,615.00	12.86
27	603108	润达医疗	4,025,152.13	12.79
28	002425	凯撒文化	4,021,524.81	12.78
29	002564	天沃科技	4,019,619.00	12.77
30	002063	远光软件	4,013,589.76	12.75
31	300174	元力股份	3,981,608.14	12.65
32	601677	明泰铝业	3,966,241.61	12.60
33	601137	博威合金	3,951,799.00	12.56
34	600850	华东电脑	3,930,362.61	12.49
35	600628	新世界	3,912,669.00	12.43

36	603686	龙马环卫	3,772,425.94	11.99
37	002540	亚太科技	3,738,766.04	11.88
38	600180	瑞茂通	3,657,731.07	11.62
39	600896	览海投资	3,644,871.30	11.58
40	300320	海达股份	3,643,339.89	11.58
41	002518	科士达	3,623,785.76	11.51
42	002100	天康生物	3,599,900.10	11.44
43	600845	宝信软件	3,575,286.59	11.36
44	600285	羚锐制药	3,527,117.50	11.21
45	002706	良信电器	3,468,260.79	11.02
46	000498	山东路桥	3,458,650.71	10.99
47	300406	九强生物	3,457,206.06	10.99
48	600512	腾达建设	3,447,304.31	10.95
49	603025	大豪科技	3,402,026.04	10.81
50	300439	美康生物	3,398,091.00	10.80
51	002766	索菱股份	3,357,333.22	10.67
52	300176	鸿特精密	3,340,630.00	10.61
53	300292	吴通控股	3,340,048.00	10.61
54	300282	汇冠股份	3,329,811.09	10.58
55	600195	中牧股份	3,322,006.00	10.56
56	300483	沃施股份	3,318,261.89	10.54
57	002006	精功科技	3,315,184.73	10.53
58	002515	金字火腿	3,288,365.44	10.45
59	300365	恒华科技	3,199,244.42	10.17
60	000612	焦作万方	3,194,723.42	10.15
61	000657	中钨高新	3,150,127.74	10.01
62	300112	万讯自控	3,128,507.41	9.94
63	000929	兰州黄河	3,117,583.03	9.91
64	002493	荣盛石化	3,112,549.54	9.89
65	600530	交大昂立	3,105,448.36	9.87
66	300046	台基股份	3,104,219.40	9.86

67	002581	未名医药	3,094,655.80	9.83
68	000628	高新发展	3,083,130.27	9.80
69	300114	中航电测	3,081,715.05	9.79
70	603520	司太立	3,071,013.54	9.76
71	300284	苏交科	3,063,923.28	9.74
72	300393	中来股份	3,041,987.00	9.67
73	000068	华控赛格	3,024,360.29	9.61
74	603609	禾丰牧业	3,024,297.00	9.61
75	002062	宏润建设	2,996,647.15	9.52
76	300091	金通灵	2,994,874.44	9.52
77	300337	银邦股份	2,992,398.60	9.51
78	600529	山东药玻	2,962,231.90	9.41
79	600293	三峡新材	2,947,926.00	9.37
80	000676	智度股份	2,918,527.24	9.27
81	300158	振东制药	2,908,745.99	9.24
82	002595	豪迈科技	2,896,930.62	9.21
83	600067	冠城大通	2,889,925.76	9.18
84	002712	思美传媒	2,858,846.50	9.08
85	600618	氯碱化工	2,855,600.62	9.07
86	600132	重庆啤酒	2,848,107.20	9.05
87	002534	杭锅股份	2,832,181.01	9.00
88	000791	甘肃电投	2,814,048.00	8.94
89	002073	软控股份	2,811,567.43	8.93
90	600211	西藏药业	2,810,151.64	8.93
91	000517	荣安地产	2,803,903.00	8.91
92	002064	华峰氨纶	2,803,020.01	8.91
93	600129	太极集团	2,782,453.00	8.84
94	600825	新华传媒	2,777,920.58	8.83
95	002527	新时达	2,775,703.72	8.82
96	000420	吉林化纤	2,773,256.00	8.81
97	600070	浙江富润	2,762,468.80	8.78

98	300216	千山药机	2,747,096.00	8.73
99	300426	唐德影视	2,725,077.00	8.66
100	000042	中洲控股	2,724,211.00	8.66
101	002206	海利得	2,721,206.00	8.65
102	002343	慈文传媒	2,718,883.00	8.64
103	600351	亚宝药业	2,713,593.82	8.62
104	600724	宁波富达	2,713,344.99	8.62
105	600617	国新能源	2,712,783.20	8.62
106	600483	福能股份	2,709,660.00	8.61
107	002462	嘉事堂	2,709,204.00	8.61
108	002763	汇洁股份	2,706,943.60	8.60
109	000925	众合科技	2,706,785.00	8.60
110	603883	老百姓	2,704,648.00	8.59
111	600620	天宸股份	2,702,429.74	8.59
112	000096	广聚能源	2,699,323.40	8.58
113	002326	永太科技	2,696,690.40	8.57
114	601226	华电重工	2,693,276.50	8.56
115	000090	天健集团	2,693,026.46	8.56
116	002188	巴士在线	2,686,505.02	8.54
117	603718	海利生物	2,681,775.80	8.52
118	300237	美晨生态	2,666,271.57	8.47
119	600738	兰州民百	2,660,896.84	8.46
120	000552	靖远煤电	2,654,047.44	8.43
121	600073	上海梅林	2,653,249.79	8.43
122	600693	东百集团	2,650,808.96	8.42
123	600246	万通地产	2,649,776.78	8.42
124	300362	天翔环境	2,637,611.17	8.38
125	300204	舒泰神	2,629,211.02	8.35
126	000667	美好置业	2,627,025.00	8.35
127	600757	长江传媒	2,625,836.48	8.34
128	002275	桂林三金	2,625,826.00	8.34

129	600292	远达环保	2,618,878.30	8.32
130	600280	中央商场	2,616,452.00	8.31
131	300339	润和软件	2,614,204.00	8.31
132	600619	海立股份	2,610,947.35	8.30
133	600765	中航重机	2,610,824.00	8.30
134	600393	粤泰股份	2,609,872.00	8.29
135	300255	常山药业	2,606,884.40	8.28
136	000518	四环生物	2,603,868.25	8.27
137	300039	上海凯宝	2,602,918.73	8.27
138	600722	金牛化工	2,602,870.10	8.27
139	300143	星河生物	2,602,340.34	8.27
140	603869	北部湾旅	2,597,774.69	8.25
141	002737	葵花药业	2,589,492.19	8.23
142	600346	恒力股份	2,584,937.76	8.21
143	300300	汉鼎宇佑	2,584,546.64	8.21
144	300258	精锻科技	2,581,144.00	8.20
145	600658	电子城	2,579,141.00	8.20
146	000626	如意集团	2,573,364.84	8.18
147	002707	众信旅游	2,559,758.00	8.13
148	300061	康耐特	2,558,529.85	8.13
149	603989	艾华集团	2,557,078.00	8.13
150	603368	柳州医药	2,547,597.08	8.10
151	601700	风范股份	2,545,467.50	8.09
152	600345	长江通信	2,542,605.85	8.08
153	600622	光大嘉宝	2,538,873.90	8.07
154	601311	骆驼股份	2,536,719.08	8.06
155	600094	大名城	2,529,340.00	8.04
156	600689	上海三毛	2,527,053.94	8.03
157	002258	利尔化学	2,524,416.00	8.02
158	002683	宏大爆破	2,524,181.50	8.02
159	300338	开元股份	2,521,989.00	8.01

160	000756	新华制药	2,518,101.92	8.00
161	002514	宝馨科技	2,507,545.54	7.97
162	300220	金运激光	2,502,375.88	7.95
163	002498	汉缆股份	2,500,477.00	7.95
164	300384	三联虹普	2,500,121.14	7.94
165	002482	广田集团	2,498,622.00	7.94
166	300464	星徽精密	2,489,626.62	7.91
167	300119	瑞普生物	2,487,328.46	7.90
168	600650	锦江投资	2,485,435.85	7.90
169	002144	宏达高科	2,477,051.97	7.87
170	603959	百利科技	2,474,367.40	7.86
171	601866	中远海发	2,472,797.00	7.86
172	300262	巴安水务	2,472,548.50	7.86
173	601158	重庆水务	2,472,439.00	7.86
174	002436	兴森科技	2,471,329.00	7.85
175	002031	巨轮智能	2,466,816.07	7.84
176	600184	光电股份	2,459,694.74	7.82
177	300071	华谊嘉信	2,458,220.98	7.81
178	002088	鲁阳节能	2,454,179.10	7.80
179	002315	焦点科技	2,445,745.88	7.77
180	002656	摩登大道	2,436,143.10	7.74
181	601328	交通银行	2,429,563.00	7.72
182	300470	日机密封	2,426,303.69	7.71
183	600602	云赛智联	2,425,111.24	7.71
184	601398	工商银行	2,424,535.48	7.70
185	601988	中国银行	2,421,522.00	7.69
186	002171	楚江新材	2,421,194.66	7.69
187	601288	农业银行	2,421,088.00	7.69
188	600016	民生银行	2,419,550.41	7.69
189	601166	兴业银行	2,416,419.00	7.68
190	600958	东方证券	2,415,414.00	7.68

191	601579	会稽山	2,413,561.93	7.67
192	603818	曲美家居	2,411,227.30	7.66
193	002320	海峡股份	2,402,424.35	7.63
194	603567	珍宝岛	2,399,917.40	7.63
195	002745	木林森	2,398,288.27	7.62
196	002360	同德化工	2,335,325.13	7.42
197	600892	大晟文化	2,332,249.88	7.41
198	600193	创兴资源	2,326,270.78	7.39
199	300388	国祯环保	2,317,729.50	7.36
200	002615	哈尔斯	2,310,228.46	7.34
201	603166	福达股份	2,299,668.00	7.31
202	603568	伟明环保	2,278,686.31	7.24
203	603808	歌力思	2,276,492.70	7.23
204	601318	中国平安	2,258,927.90	7.18
205	600000	浦发银行	2,254,607.00	7.16
206	600837	海通证券	2,244,281.80	7.13
207	600491	龙元建设	2,230,625.00	7.09
208	600981	汇鸿集团	2,209,492.00	7.02
209	000426	兴业矿业	2,195,650.98	6.98
210	002689	远大智能	2,188,838.80	6.96
211	002721	金一文化	2,185,798.79	6.95
212	002036	联创电子	2,183,458.12	6.94
213	300444	双杰电气	2,173,492.50	6.91
214	002402	和而泰	2,130,195.00	6.77
215	300342	天银机电	2,124,298.25	6.75
216	002477	雏鹰农牧	2,100,639.00	6.67
217	002753	永东股份	2,097,784.18	6.67
218	300297	蓝盾股份	2,082,895.00	6.62
219	600105	永鼎股份	2,080,111.00	6.61
220	000739	普洛药业	2,075,956.14	6.60
221	300424	航新科技	2,072,922.00	6.59

222	002416	爱施德	2,070,372.91	6.58
223	300484	蓝海华腾	2,063,710.40	6.56
224	002124	天邦股份	2,061,990.60	6.55
225	002059	云南旅游	2,059,062.02	6.54
226	600429	三元股份	2,050,019.00	6.51
227	002203	海亮股份	2,049,510.74	6.51
228	002531	天顺风能	2,044,959.74	6.50
229	600641	万业企业	2,038,202.86	6.48
230	600551	时代出版	2,038,087.80	6.48
231	300232	洲明科技	2,024,518.37	6.43
232	600764	中国海防	2,010,474.00	6.39
233	300131	英唐智控	1,997,817.96	6.35
234	002554	惠博普	1,993,521.00	6.33
235	002617	露笑科技	1,991,029.98	6.33
236	002727	一心堂	1,989,312.00	6.32
237	600708	光明地产	1,970,799.14	6.26
238	300366	创意信息	1,965,595.00	6.25
239	300299	富春通信	1,922,021.33	6.11
240	002283	天润曲轴	1,899,133.79	6.03
241	601169	北京银行	1,833,442.00	5.83
242	600103	青山纸业	1,817,245.00	5.77
243	002715	登云股份	1,783,974.79	5.67
244	300132	青松股份	1,780,095.70	5.66
245	600683	京投发展	1,778,747.25	5.65
246	600857	宁波中百	1,774,359.00	5.64
247	002357	富临运业	1,764,577.07	5.61
248	002350	北京科锐	1,742,495.20	5.54
249	600444	国机通用	1,737,066.56	5.52
250	002613	北玻股份	1,719,582.00	5.46
251	300341	麦迪电气	1,719,183.07	5.46
252	600133	东湖高新	1,704,491.00	5.42

253	300260	新莱应材	1,698,401.14	5.40
254	600405	动力源	1,696,779.20	5.39
255	000985	大庆华科	1,695,554.94	5.39
256	300272	开能环保	1,690,849.92	5.37
257	000695	滨海能源	1,690,498.39	5.37
258	600593	大连圣亚	1,684,746.16	5.35
259	002781	奇信股份	1,683,534.02	5.35
260	300321	同大股份	1,682,295.28	5.35
261	300360	炬华科技	1,681,005.29	5.34
262	300054	鼎龙股份	1,679,867.68	5.34
263	600051	宁波联合	1,676,519.00	5.33
264	002337	赛象科技	1,675,686.83	5.32
265	600615	丰华股份	1,675,620.05	5.32
266	002598	山东章鼓	1,673,652.74	5.32
267	300013	新宁物流	1,672,480.84	5.31
268	600419	天润乳业	1,672,374.54	5.31
269	300210	森远股份	1,670,654.02	5.31
270	300414	中光防雷	1,669,151.42	5.30
271	002356	赫美集团	1,669,004.62	5.30
272	002755	东方新星	1,668,555.28	5.30
273	601313	江南嘉捷	1,668,535.69	5.30
274	300249	依米康	1,668,477.37	5.30
275	603017	中衡设计	1,667,906.00	5.30
276	603117	万林股份	1,667,704.93	5.30
277	002090	金智科技	1,667,672.85	5.30
278	300472	新元科技	1,666,651.67	5.30
279	300305	裕兴股份	1,666,262.10	5.29
280	300211	亿通科技	1,666,082.08	5.29
281	300416	苏试试验	1,665,937.02	5.29
282	002295	精艺股份	1,665,585.29	5.29
283	300344	太空板业	1,664,763.00	5.29

284	300049	福瑞股份	1,664,371.06	5.29
285	300370	安控科技	1,663,942.77	5.29
286	300092	科新机电	1,663,648.03	5.29
287	600605	汇通能源	1,661,792.58	5.28
288	002338	奥普光电	1,661,402.90	5.28
289	300407	凯发电气	1,661,190.23	5.28
290	300089	文化长城	1,660,513.05	5.28
291	300435	中泰股份	1,658,993.39	5.27
292	600671	天目药业	1,658,950.00	5.27
293	300385	雪浪环境	1,658,834.00	5.27
294	002627	宜昌交运	1,658,469.45	5.27
295	002523	天桥起重	1,658,330.59	5.27
296	600846	同济科技	1,658,302.24	5.27
297	603066	音飞储存	1,658,089.00	5.27
298	300425	环能科技	1,657,786.21	5.27
299	000530	大冷股份	1,657,705.06	5.27
300	002438	江苏神通	1,657,696.32	5.27
301	002529	海源机械	1,657,089.99	5.27
302	002609	捷顺科技	1,656,908.96	5.26
303	600744	华银电力	1,656,355.80	5.26
304	300357	我武生物	1,655,852.97	5.26
305	300495	美尚生态	1,655,735.00	5.26
306	601518	吉林高速	1,655,655.00	5.26
307	300448	浩云科技	1,655,208.31	5.26
308	600746	江苏索普	1,654,727.00	5.26
309	600354	敦煌种业	1,654,398.00	5.26
310	002771	真视通	1,653,729.69	5.25
311	300290	荣科科技	1,653,137.29	5.25
312	002313	日海通讯	1,652,731.59	5.25
313	300457	赢合科技	1,652,601.66	5.25
314	300449	汉邦高科	1,652,081.00	5.25

315	600371	万向德农	1,652,042.91	5.25
316	600985	雷鸣科化	1,651,165.01	5.25
317	600389	江山股份	1,650,339.57	5.24
318	002150	通润装备	1,650,016.00	5.24
319	600156	华升股份	1,649,168.14	5.24
320	600882	广泽股份	1,648,636.50	5.24
321	300283	温州宏丰	1,648,457.80	5.24
322	300246	宝莱特	1,648,389.08	5.24
323	002015	霞客环保	1,648,198.56	5.24
324	600961	株冶集团	1,647,799.49	5.24
325	300069	金利华电	1,647,516.66	5.24
326	600121	*ST郑煤	1,646,633.32	5.23
327	300286	安科瑞	1,646,166.80	5.23
328	002084	海鸥卫浴	1,645,915.24	5.23
329	600455	博通股份	1,644,535.30	5.23
330	603006	联明股份	1,644,312.00	5.22
331	300117	嘉寓股份	1,643,898.00	5.22
332	300350	华鹏飞	1,643,817.04	5.22
333	000920	南方汇通	1,643,815.25	5.22
334	002026	山东威达	1,643,397.17	5.22
335	002674	兴业科技	1,642,916.58	5.22
336	002037	久联发展	1,642,547.99	5.22
337	600753	东方银星	1,641,888.40	5.22
338	002669	康达新材	1,641,638.57	5.22
339	600973	宝胜股份	1,641,503.00	5.22
340	002119	康强电子	1,640,965.02	5.21
341	603023	威帝股份	1,640,428.00	5.21
342	000004	国农科技	1,639,424.41	5.21
343	002411	必康股份	1,638,523.85	5.21
344	603158	腾龙股份	1,636,957.00	5.20
345	000023	深天地 A	1,635,721.15	5.20

346	600766	园城黄金	1,635,716.00	5.20
347	600644	乐山电力	1,634,551.31	5.19
348	603518	维格娜丝	1,634,255.63	5.19
349	002442	龙星化工	1,634,012.99	5.19
350	300468	四方精创	1,633,886.70	5.19
351	600378	天科股份	1,633,625.80	5.19
352	600727	鲁北化工	1,632,998.12	5.19
353	300045	华力创通	1,632,984.89	5.19
354	600083	博信股份	1,632,894.06	5.19
355	002387	黑牛食品	1,631,909.31	5.19
356	600493	凤竹纺织	1,631,784.53	5.19
357	600785	新华百货	1,627,601.50	5.17
358	300264	佳创视讯	1,626,534.96	5.17
359	600983	惠而浦	1,625,889.43	5.17
360	603600	永艺股份	1,625,148.93	5.16
361	600322	天房发展	1,624,718.00	5.16
362	300387	富邦股份	1,624,185.04	5.16
363	300108	双龙股份	1,623,715.75	5.16
364	300480	光力科技	1,623,462.44	5.16
365	300394	天孚通信	1,623,193.55	5.16
366	002629	仁智油服	1,621,425.00	5.15
367	300067	安诺其	1,620,868.37	5.15
368	600468	百利电气	1,620,641.00	5.15
369	000779	三毛派神	1,620,327.00	5.15
370	002625	光启技术	1,615,202.20	5.13
371	300121	阳谷华泰	1,612,780.47	5.12
372	002559	亚威股份	1,605,346.76	5.10
373	000759	中百集团	1,602,153.00	5.09
374	600509	天富能源	1,598,023.00	5.08
375	000639	西王食品	1,578,887.00	5.02
376	601599	鹿港文化	1,560,143.34	4.96

377	600552	凯盛科技	1,538,892.00	4.89
378	603223	恒通股份	1,534,023.72	4.87
379	002798	帝王洁具	1,524,500.00	4.84
380	600661	新南洋	1,517,169.00	4.82
381	000707	双环科技	1,505,980.50	4.79
382	002768	国恩股份	1,504,761.69	4.78
383	002488	金固股份	1,497,412.00	4.76
384	600979	广安爱众	1,497,389.00	4.76
385	600302	标准股份	1,493,966.59	4.75
386	603519	立霸股份	1,493,889.39	4.75
387	002496	辉丰股份	1,490,732.00	4.74
388	600629	华建集团	1,490,293.98	4.74
389	300277	海联讯	1,487,915.88	4.73
390	300179	四方达	1,487,769.03	4.73
391	600982	宁波热电	1,485,864.07	4.72
392	600461	洪城水业	1,485,467.02	4.72
393	603936	博敏电子	1,483,675.00	4.71
394	002201	九鼎新材	1,483,515.98	4.71
395	000829	天音控股	1,481,777.00	4.71
396	002548	金新农	1,479,859.82	4.70
397	002435	长江润发	1,479,329.87	4.70
398	000692	惠天热电	1,478,268.88	4.70
399	300056	三维丝	1,475,059.52	4.69
400	603789	星光农机	1,472,976.58	4.68
401	002397	梦洁股份	1,472,417.40	4.68
402	000861	海印股份	1,472,049.00	4.68
403	300452	山河药辅	1,471,132.33	4.67
404	002160	常铝股份	1,470,037.51	4.67
405	002757	南兴装备	1,469,917.60	4.67
406	603012	创力集团	1,468,574.00	4.67
407	601058	赛轮金宇	1,467,859.97	4.66

408	300389	艾比森	1,466,606.00	4.66
409	002541	鸿路钢构	1,466,441.00	4.66
410	300074	华平股份	1,465,290.00	4.66
411	600096	云天化	1,465,244.00	4.66
412	300358	楚天科技	1,464,108.65	4.65
413	002267	陕天然气	1,461,457.00	4.64
414	300390	天华超净	1,461,144.00	4.64
415	300309	吉艾科技	1,459,002.28	4.64
416	000690	宝新能源	1,458,737.54	4.64
417	000421	南京公用	1,455,980.34	4.63
418	002164	宁波东力	1,455,063.03	4.62
419	603399	吉翔股份	1,453,193.55	4.62
420	002208	合肥城建	1,452,684.66	4.62
421	000589	黔轮胎 A	1,452,491.69	4.62
422	600327	大东方	1,449,054.07	4.60
423	002533	金杯电工	1,448,685.51	4.60
424	600077	宋都股份	1,448,478.76	4.60
425	000570	苏常柴 A	1,447,601.43	4.60
426	600531	豫光金铅	1,447,481.00	4.60
427	002626	金达威	1,447,342.00	4.60
428	600269	赣粤高速	1,445,375.83	4.59
429	600396	金山股份	1,443,843.85	4.59
430	600573	惠泉啤酒	1,440,824.00	4.58
431	300032	金龙机电	1,440,554.00	4.58
432	600897	厦门空港	1,439,950.53	4.58
433	300441	鲍斯股份	1,438,328.20	4.57
434	002519	银河电子	1,438,298.55	4.57
435	002099	海翔药业	1,438,176.28	4.57
436	600052	浙江广厦	1,437,867.23	4.57
437	600810	神马股份	1,436,747.93	4.57
438	000886	海南高速	1,436,643.00	4.56

439	300398	飞凯材料	1,434,017.50	4.56
440	002180	艾派克	1,433,887.00	4.56
441	603599	广信股份	1,433,858.82	4.56
442	002111	威海广泰	1,432,714.00	4.55
443	002660	茂硕电源	1,432,236.45	4.55
444	600476	湘邮科技	1,431,082.90	4.55
445	300040	九洲电气	1,430,460.95	4.55
446	600128	弘业股份	1,429,967.93	4.54
447	300479	神思电子	1,429,707.01	4.54
448	600248	延长化建	1,429,686.60	4.54
449	300082	奥克股份	1,424,955.81	4.53
450	600960	渤海活塞	1,423,213.00	4.52
451	002654	万润科技	1,419,505.00	4.51
452	600637	东方明珠	1,418,299.38	4.51
453	000951	中国重汽	1,416,022.00	4.50
454	002311	海大集团	1,415,364.00	4.50
455	300097	智云股份	1,409,262.30	4.48
456	002611	东方精工	1,408,733.00	4.48
457	601601	中国太保	1,406,892.00	4.47
458	603996	中新科技	1,406,088.51	4.47
459	600828	茂业商业	1,405,886.30	4.47
460	000838	财信发展	1,402,455.50	4.46
461	000058	深赛格	1,400,246.00	4.45
462	603997	继峰股份	1,399,969.00	4.45
463	002614	蒙发利	1,399,229.00	4.45
464	002568	百润股份	1,399,173.00	4.45
465	300386	飞天诚信	1,399,151.00	4.45
466	600818	中路股份	1,396,305.00	4.44
467	002335	科华恒盛	1,392,956.45	4.43
468	603885	吉祥航空	1,392,128.00	4.42
469	601028	玉龙股份	1,390,353.00	4.42

470	002418	康盛股份	1,390,271.97	4.42
471	000959	首钢股份	1,389,942.24	4.42
472	000631	顺发恒业	1,389,235.00	4.41
473	603338	浙江鼎力	1,389,188.00	4.41
474	600536	中国软件	1,389,092.00	4.41
475	300178	腾邦国际	1,388,630.09	4.41
476	600679	上海凤凰	1,388,539.82	4.41
477	603456	九洲药业	1,385,975.00	4.40
478	000796	凯撒旅游	1,385,190.87	4.40
479	002279	久其软件	1,383,063.02	4.39
480	300298	三诺生物	1,382,824.60	4.39
481	300369	绿盟科技	1,382,206.00	4.39
482	000923	河北宣工	1,381,592.00	4.39
483	002370	亚太药业	1,381,299.00	4.39
484	600236	桂冠电力	1,380,769.00	4.39
485	002472	双环传动	1,380,730.18	4.39
486	002130	沃尔核材	1,380,184.00	4.39
487	000536	华映科技	1,379,865.76	4.38
488	600126	杭钢股份	1,379,166.00	4.38
489	600309	万华化学	1,378,270.00	4.38
490	600428	中远海特	1,378,268.00	4.38
491	000603	盛达矿业	1,377,375.00	4.38
492	600651	飞乐音响	1,377,005.00	4.38
493	600596	新安股份	1,376,466.00	4.37
494	601107	四川成渝	1,375,974.59	4.37
495	002742	三圣特材	1,375,771.00	4.37
496	002120	新海股份	1,375,635.52	4.37
497	600917	重庆燃气	1,374,163.82	4.37
498	600240	华业资本	1,373,833.00	4.37
499	002705	新宝股份	1,373,367.00	4.36
500	000703	恒逸石化	1,373,156.11	4.36

501	300307	慈星股份	1,372,871.00	4.36
502	000060	中金岭南	1,372,751.00	4.36
503	002769	普路通	1,372,279.01	4.36
504	601567	三星医疗	1,370,767.00	4.36
505	600609	金杯汽车	1,370,636.98	4.36
506	600366	宁波韵升	1,370,388.20	4.35
507	600110	诺德股份	1,368,738.00	4.35
508	002543	万和电气	1,367,581.32	4.35
509	000016	深康佳 A	1,366,861.00	4.34
510	600577	精达股份	1,366,055.00	4.34
511	002770	科迪乳业	1,366,043.00	4.34
512	600783	鲁信创投	1,365,813.92	4.34
513	300136	信维通信	1,365,625.00	4.34
514	300037	新宙邦	1,365,333.00	4.34
515	603169	兰石重装	1,364,805.67	4.34
516	600676	交运股份	1,364,453.40	4.34
517	000429	粤高速 A	1,363,181.00	4.33
518	600888	新疆众和	1,362,775.00	4.33
519	600790	轻纺城	1,360,178.99	4.32
520	600519	贵州茅台	1,359,394.00	4.32
521	600190	锦州港	1,359,266.00	4.32
522	002724	海洋王	1,358,614.50	4.32
523	002318	久立特材	1,358,603.00	4.32
524	600117	西宁特钢	1,357,982.00	4.32
525	601799	星宇股份	1,357,358.00	4.31
526	600310	桂东电力	1,354,779.00	4.30
527	002216	三全食品	1,354,453.00	4.30
528	000672	上峰水泥	1,354,330.00	4.30
529	603008	喜临门	1,353,914.52	4.30
530	300285	国瓷材料	1,353,363.37	4.30
531	002577	雷柏科技	1,351,584.00	4.29

532	601088	中国神华	1,351,390.00	4.29
533	300506	名家汇	1,349,897.64	4.29
534	002089	新海宜	1,349,878.00	4.29
535	002451	摩恩电气	1,349,111.00	4.29
536	002035	华帝股份	1,348,838.00	4.29
537	300467	迅游科技	1,347,949.00	4.28
538	300233	金城医药	1,346,354.77	4.28
539	600780	通宝能源	1,345,723.00	4.28
540	600745	闻泰科技	1,345,032.00	4.27
541	002272	川润股份	1,344,922.33	4.27
542	002434	万里扬	1,344,083.00	4.27
543	600308	华泰股份	1,343,588.34	4.27
544	600612	老凤祥	1,343,419.02	4.27
545	002050	三花股份	1,340,702.00	4.26
546	600300	维维股份	1,338,803.72	4.25
547	600410	华胜天成	1,336,876.00	4.25
548	601015	陕西黑猫	1,335,816.00	4.24
549	002468	艾迪西	1,333,181.17	4.24
550	600874	创业环保	1,330,059.00	4.23
551	002309	中利科技	1,328,290.00	4.22
552	601900	南方传媒	1,328,100.62	4.22
553	000620	新华联	1,327,847.00	4.22
554	600819	耀皮玻璃	1,327,700.00	4.22
555	002329	皇氏集团	1,327,668.21	4.22
556	002245	澳洋顺昌	1,326,542.62	4.22
557	000150	宜华健康	1,324,946.67	4.21
558	601588	北辰实业	1,324,367.00	4.21
559	002726	龙大肉食	1,322,640.56	4.20
560	600439	瑞贝卡	1,322,215.20	4.20
561	002365	永安药业	1,321,959.00	4.20
562	600687	刚泰控股	1,321,700.41	4.20

563	002630	华西能源	1,321,688.42	4.20
564	000584	友利控股	1,320,430.00	4.20
565	600831	广电网络	1,317,015.00	4.18
566	300194	福安药业	1,315,831.00	4.18
567	601113	华鼎股份	1,313,819.00	4.17
568	603579	荣泰健康	1,312,379.00	4.17
569	603986	兆易创新	1,310,438.00	4.16
570	603678	火炬电子	1,305,826.00	4.15
571	300363	博腾股份	1,304,676.37	4.15
572	300115	长盈精密	1,299,689.70	4.13
573	002491	通鼎互联	1,298,705.71	4.13
574	603198	迎驾贡酒	1,297,255.00	4.12
575	601010	文峰股份	1,292,493.67	4.11
576	002677	浙江美大	1,288,912.80	4.10
577	601388	怡球资源	1,288,583.73	4.09
578	002011	盾安环境	1,288,054.36	4.09
579	601127	小康股份	1,284,671.00	4.08
580	300529	健帆生物	1,280,355.00	4.07
581	002698	博实股份	1,275,457.48	4.05
582	600748	上实发展	1,274,983.34	4.05
583	002261	拓维信息	1,274,135.53	4.05
584	002221	东华能源	1,273,776.03	4.05
585	300196	长海股份	1,272,686.00	4.04
586	600460	士兰微	1,272,377.00	4.04
587	603188	亚邦股份	1,272,157.00	4.04
588	000031	中粮地产	1,271,939.12	4.04
589	002118	紫鑫药业	1,271,368.86	4.04
590	600227	赤天化	1,270,277.00	4.04
591	002366	台海核电	1,267,615.06	4.03
592	600175	美都能源	1,267,406.40	4.03
593	600611	大众交通	1,266,041.08	4.02

594	002093	国脉科技	1,264,983.00	4.02
595	601636	旗滨集团	1,263,393.00	4.01
596	600395	盘江股份	1,263,338.99	4.01
597	600220	江苏阳光	1,262,587.16	4.01
598	300287	飞利信	1,259,518.15	4.00
599	002029	七匹狼	1,259,192.33	4.00
600	002665	首航节能	1,258,757.00	4.00
601	300326	凯利泰	1,258,727.24	4.00
602	002481	双塔食品	1,258,053.00	4.00
603	000006	深振业 A	1,256,882.00	3.99
604	600862	中航高科	1,256,565.00	3.99
605	300353	东土科技	1,254,792.00	3.99
606	600289	ST信通	1,254,357.44	3.99
607	002680	长生生物	1,252,765.00	3.98
608	002238	天威视讯	1,252,378.68	3.98
609	300567	精测电子	1,251,993.00	3.98
610	600433	冠豪高新	1,251,925.22	3.98
611	002368	太极股份	1,251,870.00	3.98
612	002752	昇兴股份	1,250,289.80	3.97
613	002773	康弘药业	1,250,159.00	3.97
614	600477	杭萧钢构	1,248,880.00	3.97
615	600019	宝钢股份	1,248,459.12	3.97
616	002463	沪电股份	1,248,333.00	3.97
617	000815	美利云	1,248,119.00	3.97
618	300428	四通新材	1,248,108.00	3.97
619	600550	保变电气	1,247,864.00	3.97
620	002324	普利特	1,247,244.00	3.96
621	601139	深圳燃气	1,247,168.00	3.96
622	300101	振芯科技	1,247,004.60	3.96
623	002152	广电运通	1,246,455.34	3.96
624	001696	宗申动力	1,246,414.00	3.96

625	300034	钢研高纳	1,246,408.00	3.96
626	601021	春秋航空	1,245,386.00	3.96
627	600201	生物股份	1,245,035.00	3.96
628	300098	高新兴	1,244,970.73	3.96
629	300266	兴源环境	1,243,429.00	3.95
630	000810	创维数字	1,243,227.00	3.95
631	601515	东风股份	1,242,305.00	3.95
632	601006	大秦铁路	1,241,710.00	3.95
633	600572	康恩贝	1,240,726.00	3.94
634	601965	中国汽研	1,239,978.50	3.94
635	603003	龙宇燃油	1,239,256.00	3.94
636	000813	天山纺织	1,238,065.50	3.93
637	300053	欧比特	1,236,506.00	3.93
638	300377	赢时胜	1,236,341.00	3.93
639	002551	尚荣医疗	1,236,196.00	3.93
640	600233	圆通速递	1,236,165.00	3.93
641	002135	东南网架	1,235,804.00	3.93
642	603601	再升科技	1,235,691.00	3.93
643	600987	航民股份	1,235,642.26	3.93
644	002018	华信国际	1,234,677.00	3.92
645	002367	康力电梯	1,234,573.00	3.92
646	600208	新潮中宝	1,234,533.00	3.92
647	002293	罗莱生活	1,234,308.50	3.92
648	600242	中昌数据	1,233,680.00	3.92
649	600226	瀚叶股份	1,233,531.00	3.92
650	600829	人民同泰	1,232,775.00	3.92
651	002247	帝龙新材	1,231,683.56	3.91
652	002430	杭氧股份	1,231,095.10	3.91
653	002308	威创股份	1,230,047.00	3.91
654	000818	方大化工	1,229,791.00	3.91
655	002589	瑞康医药	1,228,560.55	3.90

656	600756	浪潮软件	1,228,383.00	3.90
657	000788	北大医药	1,228,321.00	3.90
658	600776	东方通信	1,227,917.00	3.90
659	601899	紫金矿业	1,227,876.00	3.90
660	000591	太阳能	1,226,173.20	3.90
661	000965	天保基建	1,226,148.00	3.90
662	002484	江海股份	1,226,016.18	3.90
663	600182	S佳通	1,225,269.00	3.89
664	600705	中航资本	1,224,665.00	3.89
665	002392	北京利尔	1,224,459.00	3.89
666	000797	中国武夷	1,224,103.60	3.89
667	002032	苏泊尔	1,223,193.00	3.89
668	002582	好想你	1,222,779.00	3.89
669	600093	易见股份	1,222,766.00	3.89
670	600681	百川能源	1,222,538.00	3.88
671	000564	西安民生	1,221,882.00	3.88
672	002651	利君股份	1,221,227.94	3.88
673	300482	万孚生物	1,220,594.00	3.88
674	002181	粤传媒	1,216,710.02	3.87
675	603799	华友钴业	1,216,353.00	3.86
676	600053	九鼎投资	1,215,550.77	3.86
677	000514	渝开发	1,215,534.88	3.86
678	600007	中国国贸	1,215,010.18	3.86
679	600576	祥源文化	1,214,601.00	3.86
680	600261	阳光照明	1,213,496.00	3.86
681	600503	华丽家族	1,212,323.00	3.85
682	603239	浙江仙通	1,211,748.50	3.85
683	603355	莱克电气	1,211,524.84	3.85
684	600486	扬农化工	1,210,361.00	3.85
685	000601	韶能股份	1,209,483.00	3.84
686	603861	白云电器	1,207,789.00	3.84

687	000976	春晖股份	1,207,404.00	3.84
688	600986	科达股份	1,207,340.00	3.84
689	601188	龙江交通	1,205,856.54	3.83
690	600597	光明乳业	1,204,710.82	3.83
691	002047	宝鹰股份	1,201,446.00	3.82
692	300072	三聚环保	1,199,981.00	3.81
693	002558	世纪游轮	1,198,830.00	3.81
694	600763	通策医疗	1,196,026.00	3.80
695	603979	金诚信	1,194,614.10	3.80
696	600284	浦东建设	1,191,204.28	3.79
697	300316	晶盛机电	1,190,922.00	3.78
698	603618	杭电股份	1,190,731.16	3.78
699	300190	维尔利	1,183,955.00	3.76
700	600326	西藏天路	1,183,380.54	3.76
701	600758	红阳能源	1,180,970.60	3.75
702	603669	灵康药业	1,179,962.20	3.75
703	300036	超图软件	1,179,813.00	3.75
704	600167	联美控股	1,178,243.55	3.74
705	603556	海兴电力	1,176,859.00	3.74
706	600331	宏达股份	1,175,392.00	3.73
707	300207	欣旺达	1,174,019.79	3.73
708	603806	福斯特	1,173,055.00	3.73
709	002636	金安国纪	1,172,556.01	3.73
710	300317	珈伟股份	1,169,032.00	3.71
711	600770	综艺股份	1,160,656.00	3.69
712	300008	天海防务	1,160,183.50	3.69
713	300187	永清环保	1,158,463.00	3.68
714	603393	新天然气	1,157,979.00	3.68
715	002094	青岛金王	1,157,421.00	3.68
716	603118	共进股份	1,153,876.20	3.67
717	002354	天神娱乐	1,149,412.88	3.65

718	603508	思维列控	1,148,025.22	3.65
719	300410	正业科技	1,141,212.53	3.63
720	002618	丹邦科技	1,139,051.51	3.62
721	603358	华达科技	1,135,407.00	3.61
722	603058	永吉股份	1,125,114.00	3.58
723	002791	坚朗五金	1,116,934.50	3.55
724	002175	东方网络	1,106,838.00	3.52
725	300279	和晶科技	1,105,757.93	3.51
726	601985	中国核电	993,412.00	3.16
727	603308	应流股份	974,260.29	3.10
728	601020	华钰矿业	970,245.38	3.08
729	600501	航天晨光	968,597.00	3.08
730	601003	柳钢股份	966,480.00	3.07
731	601199	江南水务	961,283.00	3.05
732	002148	北纬通信	959,134.50	3.05
733	603528	多伦科技	953,782.00	3.03
734	600415	小商品城	950,485.00	3.02
735	002452	长高集团	926,670.60	2.94
736	002750	龙津药业	871,052.62	2.77
737	002738	中矿资源	867,312.00	2.76
738	300409	道氏技术	867,251.56	2.76
739	002471	中超控股	860,949.00	2.74
740	000919	金陵药业	852,158.00	2.71
741	603901	永创智能	851,088.00	2.70
742	300328	宜安科技	849,334.45	2.70
743	002502	骅威文化	848,988.52	2.70
744	002593	日上集团	848,735.00	2.70
745	002296	辉煌科技	847,346.00	2.69
746	002214	大立科技	847,036.75	2.69
747	002327	富安娜	846,811.02	2.69
748	002218	拓日新能	846,701.00	2.69

749	300125	易世达	846,221.85	2.69
750	000065	北方国际	846,091.00	2.69
751	600223	鲁商置业	845,508.18	2.69
752	000008	神州高铁	845,142.00	2.69
753	002772	众兴菌业	845,132.61	2.69
754	002612	朗姿股份	845,034.05	2.69
755	002731	萃华珠宝	844,920.16	2.68
756	601101	昊华能源	843,864.04	2.68
757	600792	云煤能源	843,522.00	2.68
758	300475	聚隆科技	843,457.58	2.68
759	002718	友邦吊顶	843,069.00	2.68
760	000735	罗牛山	842,708.00	2.68
761	002323	雅百特	842,302.00	2.68
762	000537	广宇发展	841,924.00	2.68
763	300456	耐威科技	840,974.62	2.67
764	600191	华资实业	840,953.34	2.67
765	603611	诺力股份	840,725.00	2.67
766	002428	云南锗业	840,712.86	2.67
767	300094	国联水产	839,136.00	2.67
768	002265	西仪股份	839,087.24	2.67
769	603778	乾景园林	838,571.16	2.66
770	002101	广东鸿图	837,301.00	2.66
771	600883	博闻科技	837,151.62	2.66
772	002528	英飞拓	836,616.41	2.66
773	600213	亚星客车	836,423.95	2.66
774	603969	银龙股份	835,273.00	2.65
775	002631	德尔未来	835,130.00	2.65
776	300252	金信诺	834,500.00	2.65
777	300438	鹏辉能源	833,919.00	2.65
778	000061	农产品	833,679.00	2.65
779	000666	经纬纺机	832,942.00	2.65

780	002195	二三四五	832,438.26	2.65
781	603968	醋化股份	831,842.42	2.64
782	000520	长航凤凰	831,774.59	2.64
783	000949	新乡化纤	831,617.00	2.64
784	603131	上海沪工	830,754.15	2.64
785	600281	太化股份	830,373.77	2.64
786	002479	富春环保	827,996.00	2.63
787	002097	山河智能	827,898.50	2.63
788	000688	建新矿业	825,946.68	2.62
789	000553	沙隆达 A	825,590.00	2.62
790	300419	浩丰科技	825,376.98	2.62
791	002713	东易日盛	821,444.91	2.61
792	000987	越秀金控	819,782.92	2.60
793	002474	榕基软件	817,115.00	2.60
794	601801	皖新传媒	813,537.21	2.59
795	002220	天宝股份	775,217.88	2.46
796	600057	象屿股份	744,336.00	2.37
797	000418	小天鹅 A	689,041.00	2.19
798	300311	任子行	678,564.00	2.16
799	000534	万泽股份	673,733.99	2.14
800	300396	迪瑞医疗	671,303.00	2.13
801	300118	东方日升	669,847.56	2.13
802	000719	大地传媒	669,609.00	2.13
803	002121	科陆电子	667,480.00	2.12
804	000828	东莞控股	665,972.00	2.12
805	300447	全信股份	665,703.30	2.12
806	000607	华媒控股	665,246.00	2.11
807	600686	金龙汽车	665,042.00	2.11
808	000099	中信海直	664,267.00	2.11
809	600580	卧龙电气	663,766.52	2.11
810	600376	首开股份	663,466.00	2.11

811	600590	泰豪科技	662,741.00	2.11
812	600058	五矿发展	662,444.00	2.10
813	600508	上海能源	660,585.50	2.10
814	000407	胜利股份	652,576.00	2.07
815	600318	新力金融	651,355.60	2.07

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	601368	绿城水务	6,307,457.04	20.04
2	300451	创业软件	6,092,285.52	19.36
3	603018	中设集团	5,696,596.93	18.10
4	600713	南京医药	5,331,009.14	16.94
5	000070	特发信息	5,327,152.94	16.93
6	603005	晶方科技	5,194,406.50	16.51
7	603788	宁波高发	5,069,884.19	16.11
8	600452	涪陵电力	5,066,273.38	16.10
9	600475	华光股份	4,997,590.00	15.88
10	002516	旷达科技	4,958,736.40	15.76
11	600035	楚天高速	4,605,610.64	14.63
12	300230	永利股份	4,591,208.80	14.59
13	600736	苏州高新	4,526,322.40	14.38
14	600229	城市传媒	4,482,885.51	14.24
15	600586	金晶科技	4,405,499.12	14.00
16	600695	绿庭投资	4,363,577.69	13.87
17	603306	华懋科技	4,284,840.00	13.62
18	000055	方大集团	4,265,212.99	13.55
19	600850	华东电脑	4,108,278.95	13.05
20	002425	凯撒文化	4,057,376.87	12.89
21	600180	瑞茂通	3,990,549.90	12.68

22	601677	明泰铝业	3,950,716.31	12.55
23	600628	新世界	3,948,798.84	12.55
24	600217	中再资环	3,914,001.00	12.44
25	603698	航天工程	3,899,516.20	12.39
26	300324	旋极信息	3,887,326.24	12.35
27	601137	博威合金	3,871,079.00	12.30
28	300219	鸿利智汇	3,857,211.08	12.26
29	300184	力源信息	3,835,189.52	12.19
30	300176	鸿特精密	3,785,122.00	12.03
31	002063	远光软件	3,779,672.91	12.01
32	600381	青海春天	3,717,056.73	11.81
33	603686	龙马环卫	3,714,960.12	11.80
34	300031	宝通科技	3,713,022.30	11.80
35	300406	九强生物	3,669,394.10	11.66
36	002564	天沃科技	3,667,978.93	11.66
37	300174	元力股份	3,654,663.77	11.61
38	002100	天康生物	3,650,990.00	11.60
39	603108	润达医疗	3,636,770.76	11.56
40	600845	宝信软件	3,618,575.49	11.50
41	002518	科士达	3,565,289.08	11.33
42	600285	羚锐制药	3,529,647.15	11.22
43	002540	亚太科技	3,490,395.15	11.09
44	002706	良信电器	3,411,654.24	10.84
45	600734	实达集团	3,406,284.51	10.82
46	600512	腾达建设	3,405,708.00	10.82
47	002766	索菱股份	3,383,153.94	10.75
48	300292	吴通控股	3,374,417.00	10.72
49	603025	大豪科技	3,372,171.82	10.72
50	300439	美康生物	3,278,847.00	10.42
51	002493	荣盛石化	3,215,130.56	10.22
52	002515	金字火腿	3,199,355.45	10.17

53	600896	览海投资	3,193,117.00	10.15
54	300320	海达股份	3,167,891.20	10.07
55	000612	焦作万方	3,138,496.27	9.97
56	600195	中牧股份	3,121,274.91	9.92
57	000498	山东路桥	3,085,266.21	9.80
58	002581	未名医药	3,033,685.51	9.64
59	600618	氯碱化工	3,023,820.20	9.61
60	002062	宏润建设	3,016,239.13	9.58
61	300046	台基股份	3,007,863.93	9.56
62	300282	汇冠股份	3,007,726.39	9.56
63	000068	华控赛格	3,007,400.00	9.56
64	002006	精功科技	2,992,224.14	9.51
65	600293	三峡新材	2,981,749.36	9.47
66	300337	银邦股份	2,970,013.96	9.44
67	300112	万讯自控	2,944,612.47	9.36
68	600622	光大嘉宝	2,921,968.10	9.28
69	300284	苏交科	2,917,099.00	9.27
70	600529	山东药玻	2,914,524.19	9.26
71	300483	沃施股份	2,914,146.00	9.26
72	000628	高新发展	2,912,374.84	9.25
73	002534	杭锅股份	2,908,306.03	9.24
74	600530	交大昂立	2,907,475.31	9.24
75	000929	兰州黄河	2,906,794.32	9.24
76	300365	恒华科技	2,877,538.33	9.14
77	600650	锦江投资	2,869,062.05	9.12
78	600067	冠城大通	2,856,909.00	9.08
79	000676	智度股份	2,851,694.54	9.06
80	600346	恒力股份	2,837,097.01	9.01
81	603609	禾丰牧业	2,818,764.86	8.96
82	603520	司太立	2,760,920.00	8.77
83	002707	众信旅游	2,749,441.82	8.74

84	600280	中央商场	2,747,648.24	8.73
85	600619	海立股份	2,744,979.00	8.72
86	000096	广聚能源	2,739,725.92	8.71
87	600292	远达环保	2,737,352.87	8.70
88	601226	华电重工	2,736,468.16	8.70
89	000756	新华制药	2,727,229.00	8.67
90	002326	永太科技	2,726,350.68	8.66
91	002745	木林森	2,725,405.75	8.66
92	000518	四环生物	2,717,284.42	8.63
93	002275	桂林三金	2,715,511.00	8.63
94	002064	华峰氨纶	2,712,193.48	8.62
95	300426	唐德影视	2,712,091.50	8.62
96	002343	慈文传媒	2,703,639.00	8.59
97	002527	新时达	2,701,927.50	8.59
98	002737	葵花药业	2,699,253.27	8.58
99	000626	如意集团	2,697,291.96	8.57
100	000517	荣安地产	2,697,169.23	8.57
101	002171	楚江新材	2,695,688.00	8.57
102	600070	浙江富润	2,694,926.95	8.56
103	000420	吉林化纤	2,682,579.60	8.52
104	601866	中远海发	2,680,772.00	8.52
105	002656	摩登大道	2,677,878.72	8.51
106	601700	风范股份	2,671,657.00	8.49
107	000657	中钨高新	2,664,764.01	8.47
108	002073	软控股份	2,664,649.66	8.47
109	002258	利尔化学	2,642,797.00	8.40
110	002320	海峡股份	2,634,577.87	8.37
111	600724	宁波富达	2,634,225.00	8.37
112	300204	舒泰神	2,627,280.26	8.35
113	300061	康耐特	2,623,482.00	8.34
114	603869	北部湾旅	2,623,320.00	8.34

115	600351	亚宝药业	2,622,116.00	8.33
116	600483	福能股份	2,621,192.67	8.33
117	603989	艾华集团	2,616,044.68	8.31
118	300158	振东制药	2,615,624.78	8.31
119	600617	国新能源	2,615,506.51	8.31
120	002595	豪迈科技	2,615,363.15	8.31
121	002763	汇洁股份	2,614,236.25	8.31
122	000925	众合科技	2,614,009.00	8.31
123	002206	海利得	2,606,137.50	8.28
124	601311	骆驼股份	2,602,824.00	8.27
125	300393	中来股份	2,601,805.00	8.27
126	002482	广田集团	2,595,203.60	8.25
127	002683	宏大爆破	2,583,919.71	8.21
128	002462	嘉事堂	2,582,531.00	8.21
129	600658	电子城	2,582,109.98	8.20
130	300143	星河生物	2,577,915.99	8.19
131	300114	中航电测	2,575,748.34	8.18
132	600620	天宸股份	2,569,182.91	8.16
133	600073	上海梅林	2,568,952.02	8.16
134	600602	云赛智联	2,567,419.84	8.16
135	600132	重庆啤酒	2,561,580.18	8.14
136	002712	思美传媒	2,560,300.12	8.14
137	002315	焦点科技	2,559,003.88	8.13
138	600393	粤泰股份	2,547,013.00	8.09
139	603166	福达股份	2,543,518.12	8.08
140	300300	汉鼎宇佑	2,543,493.00	8.08
141	300039	上海凯宝	2,541,387.00	8.08
142	600765	中航重机	2,539,884.00	8.07
143	600825	新华传媒	2,539,688.00	8.07
144	600184	光电股份	2,536,288.82	8.06
145	603368	柳州医药	2,528,561.00	8.03

146	600757	长江传媒	2,520,495.81	8.01
147	000667	美好置业	2,499,653.00	7.94
148	300384	三联虹普	2,495,411.62	7.93
149	300258	精锻科技	2,493,401.50	7.92
150	300338	开元股份	2,490,086.00	7.91
151	300262	巴安水务	2,486,988.50	7.90
152	603567	珍宝岛	2,484,963.75	7.90
153	300339	润和软件	2,479,741.36	7.88
154	600129	太极集团	2,477,869.00	7.87
155	300255	常山药业	2,477,774.00	7.87
156	000552	靖远煤电	2,471,448.00	7.85
157	000042	中洲控股	2,462,511.00	7.82
158	000791	甘肃电投	2,450,380.00	7.79
159	002031	巨轮智能	2,447,126.20	7.78
160	600246	万通地产	2,444,248.71	7.77
161	603883	老百姓	2,443,383.10	7.76
162	601398	工商银行	2,439,081.00	7.75
163	000090	天健集团	2,438,639.80	7.75
164	601288	农业银行	2,435,325.00	7.74
165	600094	大名城	2,433,190.00	7.73
166	002188	巴士在线	2,431,578.60	7.73
167	601158	重庆水务	2,418,042.00	7.68
168	002436	兴森科技	2,414,876.00	7.67
169	002498	汉缆股份	2,408,764.00	7.65
170	601988	中国银行	2,390,556.00	7.60
171	601328	交通银行	2,382,201.00	7.57
172	600211	西藏药业	2,375,710.70	7.55
173	601166	兴业银行	2,373,746.68	7.54
174	300119	瑞普生物	2,366,070.16	7.52
175	300237	美晨生态	2,365,731.29	7.52
176	300216	千山药机	2,360,721.00	7.50

177	300444	双杰电气	2,350,530.60	7.47
178	603808	歌力思	2,347,577.36	7.46
179	002514	宝馨科技	2,344,781.38	7.45
180	002615	哈尔斯	2,336,314.28	7.42
181	603568	伟明环保	2,332,561.36	7.41
182	600958	东方证券	2,326,354.00	7.39
183	600722	金牛化工	2,321,489.00	7.38
184	002036	联创电子	2,312,488.00	7.35
185	601318	中国平安	2,310,343.91	7.34
186	600693	东百集团	2,309,199.00	7.34
187	600016	民生银行	2,308,502.00	7.34
188	300362	天翔环境	2,302,066.00	7.31
189	600193	创兴资源	2,293,656.00	7.29
190	600738	兰州民百	2,291,742.42	7.28
191	600345	长江通信	2,278,607.07	7.24
192	603718	海利生物	2,266,195.00	7.20
193	603959	百利科技	2,258,339.00	7.18
194	300470	日机密封	2,244,743.46	7.13
195	300071	华谊嘉信	2,242,483.52	7.13
196	300117	嘉寓股份	2,235,605.00	7.10
197	002402	和而泰	2,212,536.00	7.03
198	002088	鲁阳节能	2,210,967.00	7.03
199	600491	龙元建设	2,209,087.78	7.02
200	600837	海通证券	2,208,818.38	7.02
201	002360	同德化工	2,204,658.50	7.01
202	300220	金运激光	2,202,323.00	7.00
203	300464	星徽精密	2,194,757.16	6.97
204	002689	远大智能	2,192,323.00	6.97
205	600000	浦发银行	2,188,033.68	6.95
206	601579	会稽山	2,181,521.29	6.93
207	600689	上海三毛	2,143,969.00	6.81

208	002144	宏达高科	2,132,099.12	6.77
209	000426	兴业矿业	2,131,406.00	6.77
210	002721	金一文化	2,121,032.00	6.74
211	600981	汇鸿集团	2,118,288.00	6.73
212	002477	雏鹰农牧	2,102,064.00	6.68
213	600641	万业企业	2,101,738.00	6.68
214	002124	天邦股份	2,089,484.00	6.64
215	300388	国祯环保	2,067,569.00	6.57
216	603818	曲美家居	2,058,543.06	6.54
217	300297	蓝盾股份	2,050,756.16	6.52
218	600744	华银电力	2,036,198.00	6.47
219	300424	航新科技	2,021,884.13	6.42
220	002531	天顺风能	2,012,824.00	6.40
221	600985	雷鸣科化	2,005,312.40	6.37
222	002416	爱施德	2,003,187.83	6.37
223	300484	蓝海华腾	1,995,621.05	6.34
224	600874	创业环保	1,952,990.00	6.21
225	300342	天银机电	1,937,806.08	6.16
226	002625	光启技术	1,933,482.00	6.14
227	002059	云南旅游	1,922,787.51	6.11
228	000739	普洛药业	1,908,165.46	6.06
229	600105	永鼎股份	1,888,708.80	6.00
230	002617	露笑科技	1,873,582.00	5.95
231	002669	康达新材	1,870,533.23	5.94
232	300366	创意信息	1,843,704.00	5.86
233	603600	永艺股份	1,821,914.00	5.79
234	600133	东湖高新	1,812,717.00	5.76
235	002727	一心堂	1,809,640.71	5.75
236	600429	三元股份	1,806,718.00	5.74
237	300232	洲明科技	1,789,105.00	5.68
238	300299	富春通信	1,788,143.00	5.68

239	002554	惠博普	1,788,009.00	5.68
240	000530	大冷股份	1,782,620.00	5.66
241	600892	大晟文化	1,781,921.99	5.66
242	300249	依米康	1,773,953.56	5.64
243	002781	奇信股份	1,772,704.00	5.63
244	600551	时代出版	1,772,546.79	5.63
245	600103	青山纸业	1,765,806.00	5.61
246	300131	英唐智控	1,764,526.88	5.61
247	603006	黎明股份	1,764,111.00	5.61
248	300407	凯发电气	1,763,078.00	5.60
249	300091	金通灵	1,761,962.00	5.60
250	300357	我武生物	1,752,988.84	5.57
251	002203	海亮股份	1,752,914.00	5.57
252	300344	太空板业	1,750,121.45	5.56
253	600644	乐山电力	1,738,601.00	5.52
254	600468	百利电气	1,736,218.50	5.52
255	600727	鲁北化工	1,727,078.54	5.49
256	002753	永东股份	1,721,425.02	5.47
257	603518	维格娜丝	1,704,160.92	5.41
258	002523	天桥起重	1,696,022.78	5.39
259	600708	光明地产	1,695,847.70	5.39
260	600419	天润乳业	1,695,506.68	5.39
261	002411	必康股份	1,694,946.52	5.39
262	600651	飞乐音响	1,681,363.00	5.34
263	002356	赫美集团	1,680,123.00	5.34
264	600973	宝胜股份	1,673,686.20	5.32
265	002119	康强电子	1,658,501.93	5.27
266	601169	北京银行	1,650,411.00	5.24
267	600983	惠而浦	1,648,961.00	5.24
268	002283	天润曲轴	1,647,474.00	5.23
269	002313	日海通讯	1,644,500.07	5.23

270	603861	白云电器	1,643,799.00	5.22
271	002015	霞客环保	1,642,739.80	5.22
272	002771	真视通	1,634,108.00	5.19
273	600764	中国海防	1,633,454.96	5.19
274	603158	腾龙股份	1,633,272.37	5.19
275	002387	黑牛食品	1,632,476.00	5.19
276	601518	吉林高速	1,629,660.13	5.18
277	300457	赢合科技	1,626,525.00	5.17
278	603023	威帝股份	1,623,833.50	5.16
279	002609	捷顺科技	1,620,219.20	5.15
280	600455	博通股份	1,617,672.72	5.14
281	600882	广泽股份	1,615,402.31	5.13
282	002438	江苏神通	1,610,899.38	5.12
283	002089	新海宜	1,610,776.00	5.12
284	002442	龙星化工	1,607,809.13	5.11
285	300425	环能科技	1,600,131.00	5.08
286	002026	山东威达	1,597,419.68	5.08
287	002120	新海股份	1,596,120.60	5.07
288	600683	京投发展	1,595,869.15	5.07
289	600354	敦煌种业	1,592,864.58	5.06
290	601313	江南嘉捷	1,592,687.57	5.06
291	603338	浙江鼎力	1,591,634.00	5.06
292	300495	美尚生态	1,590,754.50	5.05
293	300069	金利华电	1,586,538.55	5.04
294	300136	信维通信	1,586,040.36	5.04
295	300441	鲍斯股份	1,585,560.10	5.04
296	002090	金智科技	1,577,519.00	5.01
297	600766	园城黄金	1,577,090.57	5.01
298	300054	鼎龙股份	1,576,606.00	5.01
299	600476	湘邮科技	1,573,912.00	5.00
300	002150	通润装备	1,573,695.39	5.00

301	600846	同济科技	1,572,593.00	5.00
302	002674	兴业科技	1,569,336.46	4.99
303	601601	中国太保	1,569,309.00	4.99
304	300211	亿通科技	1,567,703.28	4.98
305	002084	海鸥卫浴	1,563,561.56	4.97
306	600410	华胜天成	1,561,506.00	4.96
307	600389	江山股份	1,559,081.42	4.95
308	002755	东方新星	1,555,766.12	4.94
309	600961	株冶集团	1,555,076.92	4.94
310	000692	惠天热电	1,549,543.19	4.92
311	002629	仁智油服	1,547,012.97	4.92
312	300506	名家汇	1,547,002.00	4.92
313	300210	森远股份	1,545,648.79	4.91
314	300385	雪浪环境	1,543,515.00	4.90
315	600745	闻泰科技	1,542,128.00	4.90
316	600493	凤竹纺织	1,538,937.86	4.89
317	000759	中百集团	1,536,178.91	4.88
318	300467	迅游科技	1,534,985.00	4.88
319	300013	新宁物流	1,534,755.06	4.88
320	000016	深康佳A	1,533,763.00	4.87
321	300283	温州宏丰	1,533,416.92	4.87
322	300468	四方精创	1,533,018.02	4.87
323	300370	安控科技	1,532,480.00	4.87
324	600785	新华百货	1,528,201.56	4.86
325	603017	中衡设计	1,527,617.00	4.85
326	300045	华力创通	1,527,008.27	4.85
327	002451	摩恩电气	1,523,689.00	4.84
328	300285	国瓷材料	1,522,952.00	4.84
329	300416	苏试试验	1,521,765.00	4.84
330	600121	*ST郑煤	1,519,427.00	4.83
331	300341	麦迪电气	1,518,208.45	4.82

332	603799	华友钴业	1,518,199.00	4.82
333	002047	宝鹰股份	1,517,862.00	4.82
334	000672	上峰水泥	1,513,959.56	4.81
335	300290	荣科科技	1,511,929.00	4.80
336	002435	长江润发	1,510,655.76	4.80
337	300067	安诺其	1,507,779.47	4.79
338	002742	三圣特材	1,507,305.00	4.79
339	002613	北玻股份	1,507,297.00	4.79
340	002011	盾安环境	1,506,070.00	4.79
341	002050	三花股份	1,506,045.48	4.79
342	600818	中路股份	1,504,610.00	4.78
343	603678	火炬电子	1,503,134.00	4.78
344	600753	东方银星	1,502,880.20	4.78
345	300360	炬华科技	1,501,913.19	4.77
346	600605	汇通能源	1,501,850.82	4.77
347	002418	康盛股份	1,498,998.80	4.76
348	002543	万和电气	1,498,759.00	4.76
349	601388	怡球资源	1,498,444.20	4.76
350	002338	奥普光电	1,498,082.65	4.76
351	002529	海源机械	1,497,234.00	4.76
352	601015	陕西黑猫	1,495,272.00	4.75
353	300272	开能环保	1,492,193.57	4.74
354	002295	精艺股份	1,491,696.32	4.74
355	300386	飞天诚信	1,490,011.00	4.73
356	600746	江苏索普	1,489,658.38	4.73
357	000703	恒逸石化	1,487,781.32	4.73
358	300092	科新机电	1,487,283.00	4.73
359	600960	渤海活塞	1,486,601.00	4.72
360	300108	双龙股份	1,486,095.20	4.72
361	002337	赛象科技	1,483,798.24	4.71
362	002548	金新农	1,477,824.67	4.70

363	300472	新元科技	1,473,189.00	4.68
364	002715	登云股份	1,472,183.33	4.68
365	300049	福瑞股份	1,470,585.87	4.67
366	300132	青松股份	1,470,086.73	4.67
367	002350	北京科锐	1,470,067.01	4.67
368	000796	凯撒旅游	1,467,662.00	4.66
369	300179	四方达	1,466,160.09	4.66
370	000920	南方汇通	1,465,933.00	4.66
371	300089	文化长城	1,464,016.00	4.65
372	601799	星宇股份	1,463,685.00	4.65
373	300414	中光防雷	1,462,030.13	4.65
374	600671	天目药业	1,460,232.00	4.64
375	002598	山东章鼓	1,459,069.11	4.64
376	300394	天孚通信	1,457,987.17	4.63
377	000023	深天地 A	1,456,626.05	4.63
378	600857	宁波中百	1,455,670.34	4.63
379	002357	富临运业	1,455,230.38	4.62
380	002798	帝王洁具	1,453,186.60	4.62
381	000985	大庆华科	1,451,983.68	4.61
382	002468	艾迪西	1,446,088.21	4.59
383	300350	华鹏飞	1,442,015.05	4.58
384	002757	南兴装备	1,441,648.66	4.58
385	300121	阳谷华泰	1,440,680.00	4.58
386	601028	玉龙股份	1,440,422.00	4.58
387	600477	杭萧钢构	1,437,450.99	4.57
388	603997	继峰股份	1,437,174.50	4.57
389	002726	龙大肉食	1,436,773.00	4.57
390	600405	动力源	1,434,414.89	4.56
391	600378	天科股份	1,432,598.35	4.55
392	600300	维维股份	1,429,522.00	4.54
393	600461	洪城水业	1,429,020.55	4.54

394	002541	鸿路钢构	1,426,604.40	4.53
395	002267	陕天然气	1,423,787.13	4.52
396	603618	杭电股份	1,423,682.00	4.52
397	603399	吉翔股份	1,422,473.98	4.52
398	300479	神思电子	1,420,862.00	4.51
399	600503	华丽家族	1,420,135.00	4.51
400	600676	交运股份	1,419,985.00	4.51
401	300246	宝莱特	1,419,536.00	4.51
402	603117	万林股份	1,419,442.00	4.51
403	000695	滨海能源	1,418,796.99	4.51
404	002365	永安药业	1,418,603.00	4.51
405	000631	顺发恒业	1,417,849.00	4.51
406	002627	宜昌交运	1,416,088.32	4.50
407	601599	鹿港文化	1,415,673.00	4.50
408	300286	安科瑞	1,415,538.00	4.50
409	002651	利君股份	1,415,431.00	4.50
410	300037	新宙邦	1,414,822.06	4.50
411	600019	宝钢股份	1,414,284.26	4.49
412	600758	红阳能源	1,413,645.00	4.49
413	600987	航民股份	1,413,381.20	4.49
414	002611	东方精工	1,413,031.60	4.49
415	600982	宁波热电	1,412,419.07	4.49
416	002559	亚威股份	1,412,217.35	4.49
417	300082	奥克股份	1,411,002.77	4.48
418	002577	雷柏科技	1,409,489.00	4.48
419	601127	小康股份	1,404,973.00	4.46
420	000838	财信发展	1,404,483.00	4.46
421	002037	久联发展	1,404,170.37	4.46
422	000150	宜华健康	1,403,560.33	4.46
423	600326	西藏天路	1,400,957.20	4.45
424	600302	标准股份	1,400,470.97	4.45

425	300097	智云股份	1,400,355.72	4.45
426	002329	皇氏集团	1,400,332.00	4.45
427	000779	三毛派神	1,398,677.26	4.44
428	603936	博敏电子	1,398,406.55	4.44
429	600444	国机通用	1,398,311.03	4.44
430	002430	杭氧股份	1,393,376.00	4.43
431	002680	长生生物	1,393,205.00	4.43
432	600167	联美控股	1,392,720.37	4.43
433	600083	博信股份	1,392,456.66	4.42
434	002636	金安国纪	1,391,763.00	4.42
435	300482	万孚生物	1,391,623.18	4.42
436	600439	瑞贝卡	1,391,484.00	4.42
437	000536	华映科技	1,391,344.85	4.42
438	600269	赣粤高速	1,389,396.00	4.41
439	600819	耀皮玻璃	1,387,411.84	4.41
440	000923	河北宣工	1,387,351.34	4.41
441	600661	新南洋	1,383,472.00	4.40
442	300316	晶盛机电	1,383,197.00	4.40
443	600309	万华化学	1,382,850.00	4.39
444	600612	老凤祥	1,382,375.00	4.39
445	002216	三全食品	1,381,711.00	4.39
446	002245	澳洋顺昌	1,381,073.00	4.39
447	000707	双环科技	1,380,596.12	4.39
448	300260	新莱应材	1,379,075.00	4.38
449	600051	宁波联合	1,377,736.30	4.38
450	600248	延长化建	1,377,580.10	4.38
451	600396	金山股份	1,376,442.83	4.37
452	300307	慈星股份	1,372,316.00	4.36
453	300277	海联讯	1,372,118.46	4.36
454	600783	鲁信创投	1,371,515.37	4.36
455	300326	凯利泰	1,371,082.77	4.36

456	601567	三星医疗	1,370,884.38	4.36
457	000797	中国武夷	1,370,740.00	4.36
458	000690	宝新能源	1,370,542.00	4.35
459	603806	福斯特	1,370,247.00	4.35
460	300305	裕兴股份	1,369,896.54	4.35
461	600327	大东方	1,369,642.10	4.35
462	300449	汉邦高科	1,369,250.00	4.35
463	002496	辉丰股份	1,368,610.10	4.35
464	600917	重庆燃气	1,368,472.00	4.35
465	600615	丰华股份	1,368,450.52	4.35
466	300435	中泰股份	1,367,166.00	4.34
467	603456	九洲药业	1,366,694.00	4.34
468	000589	黔轮胎 A	1,366,118.33	4.34
469	300279	和晶科技	1,366,092.31	4.34
470	000829	天音控股	1,365,520.00	4.34
471	603996	中新科技	1,364,984.00	4.34
472	000951	中国重汽	1,364,959.00	4.34
473	300074	华平股份	1,364,570.00	4.34
474	002130	沃尔核材	1,364,224.00	4.33
475	603008	喜临门	1,364,132.00	4.33
476	600593	大连圣亚	1,364,119.00	4.33
477	601107	四川成渝	1,361,469.00	4.33
478	000584	友利控股	1,361,076.00	4.32
479	600460	士兰微	1,359,373.00	4.32
480	300390	天华超净	1,358,792.89	4.32
481	600227	赤天化	1,357,488.99	4.31
482	002519	银河电子	1,357,311.32	4.31
483	300098	高新兴	1,357,141.78	4.31
484	000959	首钢股份	1,356,777.10	4.31
485	600371	万向德农	1,356,324.62	4.31
486	601636	旗滨集团	1,354,727.15	4.30

487	600486	扬农化工	1,354,309.80	4.30
488	600366	宁波韵升	1,353,790.00	4.30
489	002035	华帝股份	1,353,632.00	4.30
490	600679	上海凤凰	1,352,604.98	4.30
491	600637	东方明珠	1,351,700.74	4.30
492	600828	茂业商业	1,350,245.00	4.29
493	002472	双环传动	1,349,413.00	4.29
494	300101	振芯科技	1,349,202.00	4.29
495	603519	立霸股份	1,347,018.00	4.28
496	603789	星光农机	1,346,427.84	4.28
497	600577	精达股份	1,346,397.56	4.28
498	002752	昇兴股份	1,346,060.70	4.28
499	601021	春秋航空	1,345,959.00	4.28
500	300264	佳创视讯	1,345,769.13	4.28
501	002397	梦洁股份	1,343,784.94	4.27
502	600810	神马股份	1,342,254.04	4.27
503	600110	诺德股份	1,341,570.00	4.26
504	000421	南京公用	1,339,939.86	4.26
505	600790	轻纺城	1,338,989.00	4.25
506	002768	国恩股份	1,338,933.31	4.25
507	603012	创力集团	1,336,059.46	4.25
508	600331	宏达股份	1,334,742.00	4.24
509	603169	兰石重装	1,334,180.60	4.24
510	600576	祥源文化	1,333,481.00	4.24
511	600126	杭钢股份	1,333,337.47	4.24
512	002309	中利科技	1,332,533.00	4.23
513	601900	南方传媒	1,330,430.00	4.23
514	002677	浙江美大	1,329,808.00	4.23
515	600236	桂冠电力	1,329,471.00	4.22
516	300448	浩云科技	1,329,464.00	4.22
517	600190	锦州港	1,329,352.00	4.22

518	000886	海南高速	1,328,900.18	4.22
519	002392	北京利尔	1,328,646.00	4.22
520	600182	S佳通	1,328,359.00	4.22
521	000815	美利云	1,328,174.00	4.22
522	300115	长盈精密	1,328,118.21	4.22
523	300040	九洲电气	1,325,656.98	4.21
524	300317	珈伟股份	1,325,342.60	4.21
525	000429	粤高速 A	1,324,928.26	4.21
526	002370	亚太药业	1,324,074.00	4.21
527	002366	台海核电	1,323,660.00	4.21
528	300321	同大股份	1,323,446.92	4.21
529	600052	浙江广厦	1,323,047.57	4.20
530	600156	华升股份	1,322,569.00	4.20
531	002582	好想你	1,322,275.46	4.20
532	000601	韶能股份	1,322,116.00	4.20
533	300452	山河药辅	1,320,894.00	4.20
534	300233	金城医药	1,320,667.90	4.20
535	002160	常铝股份	1,319,451.13	4.19
536	300032	金龙机电	1,318,272.81	4.19
537	601088	中国神华	1,318,164.00	4.19
538	002558	世纪游轮	1,318,079.37	4.19
539	600687	刚泰控股	1,317,866.90	4.19
540	002111	威海广泰	1,317,487.28	4.19
541	300036	超图软件	1,316,671.00	4.18
542	002308	威创股份	1,314,290.00	4.18
543	603223	恒通股份	1,313,404.24	4.17
544	002660	茂硕电源	1,311,827.34	4.17
545	600053	九鼎投资	1,310,676.00	4.16
546	600519	贵州茅台	1,309,874.00	4.16
547	002773	康弘药业	1,309,655.50	4.16
548	300387	富邦股份	1,306,390.38	4.15

549	002626	金达威	1,305,543.27	4.15
550	002354	天神娱乐	1,304,826.65	4.15
551	600536	中国软件	1,304,751.00	4.15
552	603066	音飞储存	1,303,806.00	4.14
553	600979	广安爱众	1,302,864.00	4.14
554	601010	文峰股份	1,302,235.00	4.14
555	600428	中远海特	1,302,120.86	4.14
556	000570	苏常柴 A	1,300,236.46	4.13
557	600077	宋都股份	1,298,845.44	4.13
558	002099	海翔药业	1,298,692.99	4.13
559	002705	新宝股份	1,295,889.00	4.12
560	601006	大秦铁路	1,295,721.00	4.12
561	300298	三诺生物	1,294,879.00	4.11
562	600763	通策医疗	1,293,060.15	4.11
563	600780	通宝能源	1,291,052.00	4.10
564	002335	科华恒盛	1,290,984.00	4.10
565	300053	欧比特	1,290,685.00	4.10
566	600128	弘业股份	1,290,494.23	4.10
567	600573	惠泉啤酒	1,288,296.45	4.09
568	002630	华西能源	1,287,178.60	4.09
569	002238	天威视讯	1,286,735.55	4.09
570	600831	广电网络	1,286,320.82	4.09
571	002201	九鼎新材	1,284,187.00	4.08
572	600862	中航高科	1,284,100.33	4.08
573	000514	渝开发	1,282,897.00	4.08
574	002533	金杯电工	1,281,077.41	4.07
575	603003	龙宇燃油	1,280,632.00	4.07
576	000058	深赛格	1,280,429.00	4.07
577	002654	万润科技	1,279,878.50	4.07
578	300008	天海防务	1,279,585.50	4.07
579	600888	新疆众和	1,279,560.29	4.07

580	601188	龙江交通	1,278,684.00	4.06
581	300178	腾邦国际	1,278,480.25	4.06
582	002261	拓维信息	1,278,447.02	4.06
583	002208	合肥城建	1,275,721.78	4.05
584	600572	康恩贝	1,275,582.67	4.05
585	600509	天富能源	1,275,037.00	4.05
586	600681	百川能源	1,275,004.41	4.05
587	300369	绿盟科技	1,273,611.02	4.05
588	601899	紫金矿业	1,273,506.00	4.05
589	601588	北辰实业	1,272,735.99	4.04
590	600322	天房发展	1,272,558.83	4.04
591	300194	福安药业	1,272,040.00	4.04
592	600284	浦东建设	1,269,842.00	4.03
593	002318	久立特材	1,269,451.00	4.03
594	002324	普利特	1,268,793.00	4.03
595	000006	深振业 A	1,268,589.00	4.03
596	002724	海洋王	1,268,246.00	4.03
597	002463	沪电股份	1,266,828.00	4.03
598	002181	粤传媒	1,265,835.34	4.02
599	001696	宗申动力	1,265,287.13	4.02
600	002311	海大集团	1,265,019.37	4.02
601	600233	圆通速递	1,264,023.00	4.02
602	600395	盘江股份	1,264,011.00	4.02
603	601139	深圳燃气	1,263,923.00	4.02
604	000620	新华联	1,263,742.00	4.02
605	603188	亚邦股份	1,263,486.85	4.01
606	002698	博实股份	1,261,013.03	4.01
607	002029	七匹狼	1,255,690.87	3.99
608	000639	西王食品	1,254,741.00	3.99
609	000564	西安民生	1,254,278.00	3.99
610	300287	飞利信	1,253,522.39	3.98

611	000603	盛达矿业	1,253,245.00	3.98
612	603058	永吉股份	1,253,053.00	3.98
613	002221	东华能源	1,247,984.82	3.97
614	600201	生物股份	1,247,140.00	3.96
615	002589	瑞康医药	1,246,685.00	3.96
616	002093	国脉科技	1,246,276.32	3.96
617	002488	金固股份	1,243,939.00	3.95
618	002665	首航节能	1,243,031.00	3.95
619	600597	光明乳业	1,241,393.74	3.94
620	601515	东风股份	1,241,205.00	3.94
621	600705	中航资本	1,241,121.00	3.94
622	600093	易见股份	1,238,588.00	3.94
623	000591	太阳能	1,237,524.00	3.93
624	002618	丹邦科技	1,236,900.00	3.93
625	000060	中金岭南	1,236,355.00	3.93
626	600748	上实发展	1,235,979.12	3.93
627	300480	光力科技	1,235,760.04	3.93
628	002118	紫鑫药业	1,234,999.63	3.92
629	300389	艾比森	1,234,966.65	3.92
630	002018	华信国际	1,234,426.00	3.92
631	601113	华鼎股份	1,231,263.86	3.91
632	002568	百润股份	1,230,709.00	3.91
633	600433	冠豪高新	1,230,350.53	3.91
634	600308	华泰股份	1,229,940.00	3.91
635	300207	欣旺达	1,229,213.00	3.91
636	603669	灵康药业	1,228,393.95	3.90
637	002481	双塔食品	1,228,020.00	3.90
638	600609	金杯汽车	1,227,166.35	3.90
639	600226	瀚叶股份	1,224,234.50	3.89
640	601965	中国汽研	1,223,741.00	3.89
641	603885	吉祥航空	1,223,722.00	3.89

642	600240	华业资本	1,222,725.00	3.89
643	600611	大众交通	1,222,173.44	3.88
644	002367	康力电梯	1,221,887.66	3.88
645	600220	江苏阳光	1,221,651.83	3.88
646	002152	广电运通	1,221,598.50	3.88
647	603979	金诚信	1,221,487.40	3.88
648	600208	新湖中宝	1,221,074.80	3.88
649	600829	人民同泰	1,220,617.35	3.88
650	002434	万里扬	1,218,867.00	3.87
651	600289	ST信通	1,217,243.62	3.87
652	002279	久其软件	1,213,445.41	3.86
653	000031	中粮地产	1,212,825.41	3.85
654	000976	春晖股份	1,211,527.00	3.85
655	600310	桂东电力	1,210,662.43	3.85
656	002770	科迪乳业	1,210,472.72	3.85
657	000810	创维数字	1,209,859.75	3.84
658	300353	东土科技	1,209,837.00	3.84
659	002484	江海股份	1,206,432.66	3.83
660	603556	海兴电力	1,198,890.00	3.81
661	600007	中国国贸	1,197,213.34	3.80
662	002293	罗莱生活	1,196,667.50	3.80
663	002491	通鼎互联	1,196,580.42	3.80
664	300266	兴源环境	1,196,505.40	3.80
665	600242	中昌数据	1,193,482.00	3.79
666	600770	综艺股份	1,192,237.33	3.79
667	600175	美都能源	1,191,873.23	3.79
668	603355	莱克电气	1,190,416.40	3.78
669	002094	青岛金王	1,189,918.00	3.78
670	300072	三聚环保	1,188,455.00	3.78
671	603599	广信股份	1,188,390.86	3.78
672	002368	太极股份	1,186,433.75	3.77

673	002614	蒙发利	1,186,342.77	3.77
674	600596	新安股份	1,184,600.00	3.76
675	300190	维尔利	1,184,249.00	3.76
676	002272	川润股份	1,182,233.96	3.76
677	603601	再升科技	1,181,589.41	3.75
678	601058	赛轮金宇	1,181,167.00	3.75
679	300056	三维丝	1,181,003.00	3.75
680	002769	普路通	1,178,374.00	3.74
681	603393	新天然气	1,176,646.00	3.74
682	000813	天山纺织	1,176,269.86	3.74
683	300410	正业科技	1,176,236.00	3.74
684	002032	苏泊尔	1,174,977.38	3.73
685	603198	迎驾贡酒	1,174,242.82	3.73
686	000818	方大化工	1,171,610.20	3.72
687	603579	荣泰健康	1,171,460.00	3.72
688	300187	永清环保	1,165,594.00	3.70
689	600776	东方通信	1,162,831.00	3.69
690	600552	凯盛科技	1,162,626.00	3.69
691	600261	阳光照明	1,160,656.00	3.69
692	600986	科达股份	1,158,671.76	3.68
693	000788	北大医药	1,155,580.00	3.67
694	300363	博腾股份	1,155,026.50	3.67
695	603508	思维列控	1,150,998.00	3.66
696	603358	华达科技	1,150,678.00	3.66
697	300034	钢研高纳	1,150,443.76	3.66
698	603986	兆易创新	1,148,679.00	3.65
699	300309	吉艾科技	1,146,825.00	3.64
700	603118	共进股份	1,145,692.80	3.64
701	300529	健帆生物	1,143,713.00	3.63
702	600897	厦门空港	1,134,360.28	3.60
703	000004	国农科技	1,133,245.00	3.60

704	002164	宁波东力	1,130,604.00	3.59
705	300398	飞凯材料	1,123,436.00	3.57
706	002247	帝龙新材	1,118,880.00	3.56
707	300567	精测电子	1,118,347.00	3.55
708	600117	西宁特钢	1,111,196.22	3.53
709	600629	华建集团	1,111,073.40	3.53
710	002551	尚荣医疗	1,106,161.52	3.51
711	002180	艾派克	1,101,392.00	3.50
712	603239	浙江仙通	1,098,983.00	3.49
713	600756	浪潮软件	1,098,012.97	3.49
714	600096	云天化	1,097,059.00	3.49
715	000861	海印股份	1,096,160.00	3.48
716	300358	楚天科技	1,095,305.80	3.48
717	600531	豫光金铅	1,094,639.16	3.48
718	002791	坚朗五金	1,094,009.00	3.48
719	002135	东南网架	1,074,310.00	3.41
720	300377	赢时胜	1,059,477.50	3.37
721	000965	天保基建	1,054,286.98	3.35
722	300196	长海股份	1,041,654.00	3.31
723	600550	保变电气	1,032,597.00	3.28
724	002148	北纬通信	1,027,618.00	3.27
725	601985	中国核电	1,016,311.00	3.23
726	300428	四通新材	998,613.00	3.17
727	300409	道氏技术	997,560.00	3.17
728	600415	小商品城	946,794.72	3.01
729	002175	东方网络	935,555.47	2.97
730	601003	柳钢股份	931,121.00	2.96
731	601199	江南水务	923,351.00	2.93
732	600213	亚星客车	918,383.00	2.92
733	002452	长高集团	915,607.00	2.91
734	603528	多伦科技	910,889.00	2.89

735	603611	诺力股份	896,862.22	2.85
736	603901	永创智能	891,688.00	2.83
737	000553	沙隆达 A	885,115.00	2.81
738	300252	金信诺	878,050.00	2.79
739	002327	富安娜	876,287.00	2.78
740	002738	中矿资源	872,909.00	2.77
741	002502	骅威文化	872,508.96	2.77
742	002471	中超控股	868,942.00	2.76
743	300328	宜安科技	866,509.00	2.75
744	002612	朗姿股份	866,236.01	2.75
745	603778	乾景园林	865,656.66	2.75
746	300475	聚隆科技	865,275.88	2.75
747	300125	易世达	861,403.80	2.74
748	002593	日上集团	860,480.66	2.73
749	002218	拓日新能	856,823.90	2.72
750	002296	辉煌科技	856,086.47	2.72
751	603308	应流股份	853,528.00	2.71
752	002713	东易日盛	852,725.00	2.71
753	603131	上海沪工	852,547.00	2.71
754	002718	友邦吊顶	851,534.74	2.71
755	000537	广宇发展	848,615.00	2.70
756	002750	龙津药业	847,983.00	2.69
757	000919	金陵药业	846,446.00	2.69
758	002772	众兴菌业	845,863.28	2.69
759	600223	鲁商置业	845,862.91	2.69
760	601101	昊华能源	844,836.80	2.68
761	002731	萃华珠宝	841,875.33	2.68
762	000008	神州高铁	839,550.00	2.67
763	603969	银龙股份	838,444.70	2.66
764	603968	醋化股份	827,738.00	2.63
765	600501	航天晨光	823,218.12	2.62

766	000735	罗牛山	822,732.84	2.61
767	002214	大立科技	822,726.00	2.61
768	601801	皖新传媒	821,194.53	2.61
769	000061	农产品	819,331.53	2.60
770	000666	经纬纺机	817,079.04	2.60
771	601020	华钰矿业	812,037.38	2.58
772	002195	二三四五	807,534.00	2.57
773	600191	华资实业	806,900.40	2.56
774	600792	云煤能源	804,055.35	2.55
775	300419	浩丰科技	798,731.05	2.54
776	600883	博闻科技	792,607.00	2.52
777	000949	新乡化纤	789,605.00	2.51
778	000987	越秀金控	789,548.80	2.51
779	002097	山河智能	783,678.00	2.49
780	002428	云南锗业	782,402.00	2.49
781	002101	广东鸿图	780,391.65	2.48
782	600281	太化股份	779,932.00	2.48
783	300438	鹏辉能源	773,667.00	2.46
784	000520	长航凤凰	768,181.99	2.44
785	000688	建新矿业	765,990.00	2.43
786	002474	榕基软件	763,414.55	2.43
787	002528	英飞拓	757,232.55	2.41
788	000065	北方国际	756,066.40	2.40
789	002479	富春环保	754,426.00	2.40
790	002323	雅百特	735,431.00	2.34
791	002265	西仪股份	732,960.00	2.33
792	300094	国联水产	722,842.80	2.30
793	002220	天宝股份	721,884.65	2.29
794	300456	耐威科技	713,717.00	2.27
795	002631	德尔未来	692,722.00	2.20

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	1,474,030,052.22
卖出股票收入（成交）总额	1,424,762,176.06

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无余额。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

无余额。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无余额。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无余额。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无余额。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

无余额。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

无。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现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	93,970.39
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,140.31
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	96,110.70

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无余额。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	300091	金通灵	1,231,804.00	3.91	重大事项停牌
2	600734	实达集团	439,920.00	1.40	重大事项停牌
3	600057	象屿股份	103,147.50	0.33	配股限售

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
中信建投睿泰A	174	208,768.03	35,987,463.96	99.07%	338,173.18	0.93%
中信建投睿泰C	87	659.42	-	-	57,369.52	100.00%
合计	258	141,019.41	35,987,463.96	98.91%	395,542.70	1.09%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	中信建投睿泰A	12,765.12	0.04%
	中信建投睿泰C	2,201.75	3.84%
	合计	14,966.87	0.04%

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、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	中信建投睿泰A	0~10
	中信建投睿泰C	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	中信建投睿泰A	0~10
	中信建投睿泰C	0

	合计	0~10
--	----	------

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

	中信建投睿泰A	中信建投睿泰C
基金合同生效日(2017年02月14日)基金份额总额	200,185,264.34	94,729.96
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	132,095.88	65,788.18
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	163,991,723.08	103,148.62
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	36,325,637.14	57,369.52

§ 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

2017年5月18日，增聘王晓贞为本基金的基金经理；

2017年7月12日，基金管理人聘任张乐久为基金管理人督察长，周建萍离任基金管理人督察长；

2017年7月14日，基金管理人聘任周建萍为基金管理人副总经理。

报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

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

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

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

因基金管理人未有效执行风险管控机制，报告期内收到中国证券监督管理委员会北京监管局下发的（以下简称“北京证监局”）《关于对中信建投基金管理有限公司采取责令改正行政监管措施的决定》（[2017]33号）及对相关责任人采取监管谈话的行政监管措施；北京证监局下发的《关于对中信建投基金管理有限公司采取责令改正行政监管措施的决定》（[2017]36号），要求基金管理人限期进行整改；北京证监局下发的《关于对中信建投基金管理有限公司采取责令改正并暂停办理相关业务措施的决定》

（[2017]79号），对基金管理人采取责令改正并限期暂停特定客户资产管理计划备案的行政监管措施。

基金管理人高度重视整改工作，及时制定了整改方案并落实，按时向北京证监局报送了整改报告。截至报告期末，基金管理人已完成全部的整改工作。

报告期内托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员未受到任何稽查或处罚。

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	
国金证券	1	628,772,183.62	21.73%	334,066.69	21.73%	-
银河证券	1	329,143,939.39	11.38%	174,875.80	11.38%	-
方正证券	1	721,657,619.80	24.95%	383,418.30	24.95%	-
兴业证券	1	508,027,421.04	17.56%	269,913.23	17.56%	-
中信建投证券	2	705,393,586.01	24.38%	374,775.73	24.38%	-

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

（1）公司选择财务状况良好、经营行为规范、研究实力较强的证券公司，向其租用交

易单元。

(2) 证券公司的选择由公司投资研究部负责人根据证券公司的投资研究服务质量及评估结果作出交易单元租用或撤销的相关决定。经公司分管领导同意后，方可办理相关的租用事宜。投资研究部应定期向公司总经理、市场部、特定资产管理部、稽控合规部负责人等组成的办公会议汇报选择证券公司的相关依据。

(3) 评估实行评分制，具体如下：

分配权重（100分）=基础服务（45%）+特别服务（45%）+销售服务（10%）。

打分由投资研究部负责人和研究员共同完成。

基础服务包括：报告、电话沟通、路演、联合调研服务等；

特别服务包括：深度推荐公司、单独调研、带上市公司上门路演、约见专家、委托课题、人员培养、重大投资机会等；

销售服务包括：日常沟通、重点推荐的沟通、研究投资工作的支持和配合。

2、根据以上标准进行考察后，基金管理人确定券商，与被选择的券商签订交易单元租用协议，并通知基金托管人。

3、投资研究部每月完成对各往来证券公司的研究服务评估，评估结果作为调整确定个别证券公司的交易金额及比率限制的参考。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
国金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	1,800,848.50	49.99%	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	1,801,390.00	50.01%	1,402,000.00	100.00%	-	-	-	-

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	中信建投睿泰灵活配置混合型证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2017-02-15
2	关于中信建投睿泰灵活配置混合型证券投资基金基金合同生效公告的更正公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2017-02-15
3	中信建投睿泰灵活配置混合型证券投资基金开放日常申购、赎回业务公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2017-04-10
4	关于中信建投睿泰灵活配置混合型证券投资基金基金资产净值及基金份额净值的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2017-04-10
5	中信建投睿泰灵活配置混合型证券投资基金关于增聘基金经理的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2017-05-20
6	关于公司副董事长兼任子公司执行董事的公告	管理人网站	2017-06-29
7	中信建投基金管理有限公司关于旗下开放式证券投资基金2017年半年度最后一个市场交易日基金资产净值、基金份额净值和基金份额累计净值的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2017-07-01
8	中信建投基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2017-07-14
9	中信建投基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2017-07-15
10	中信建投睿泰灵活配置混合型证券投资基金2017年第2	中国证监会指定报刊及管理人网站	2017-07-21

	季度报告		
11	中信建投睿泰灵活配置混合型证券投资基金2017年半年度报告	管理人网站	2017-08-29
12	中信建投睿泰灵活配置混合型证券投资基金2017年半年度报告摘要	中国证监会指定报刊及管理人网站	2017-08-29
13	中信建投睿泰灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）（2017年第2号）	管理人网站	2017-09-28
14	中信建投睿泰灵活配置混合型证券投资基金招募说明书（更新）摘要（2017年第2号）	中国证监会指定报刊及管理人网站	2017-09-28
15	中信建投基金增加喜鹊财富基金销售有限公司为多只基金的销售机构的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2017-10-20
16	中信建投基金增加天津万家财富资产管理有限公司为多只基金的销售机构的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2017-10-20
17	中信建投基金增加乾道金融信息服务（北京）有限公司为多只基金的销售机构的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2017-10-20
18	中信建投睿泰灵活配置混合型证券投资基金2017年第3季度报告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2017-10-26
19	中信建投基金增加长城证券股份有限公司为多只基金的销售机构的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2017-11-13
20	中信建投基金管理有限公司关于旗下基金持有的“中国铝业”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2017-11-16

21	中信建投基金增加深圳前海汇联基金销售有限公司为多只基金的销售机构的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2017-11-24
22	中信建投基金增加深圳市新兰德证券投资咨询有限公司为多只基金的销售机构的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2017-11-24
23	中信建投基金管理有限公司关于旗下基金持有的“金通灵”股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2017-12-06
24	中信建投基金管理有限公司关于旗下基金持有的“光环新网”股票估值方法调整的公告	中国证监会指定报刊及管理人网站	2017-12-29

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20170612~ 20171115	38,799,880.00	-	38,799,880.00	-	0.00%
	2	20170213~ 20171117	53,000,600.00	-	53,000,600.00	-	0.00%
	3	20171208~ 20171221	16,998,200.00	-	16,998,200.00	-	0.00%
	4	20171208~ 20171231	14,992,651.98	-	-	14,992,651.98	41.21%
	5	20171120~	20,994,811.98	-	-	20,994,811.98	57.70%

		20171231				
产品特有风险						
<p>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。</p>						

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，无影响投资者决策的其他重要信息。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录.

- 1、中国证监会准予基金注册的文件；
- 2、《中信建投睿泰灵活配置混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《中信建投睿泰灵活配置混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 5、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、基金托管人办公场所。

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
二〇一八年三月三十日