

中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金

2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人:中信建投基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

报告送出日期:2026 年 08 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年08月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2026年01月01日起至2026年06月30日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§ 2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	4
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
§ 4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	17
§ 7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	63
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	79
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	80
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	80
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	80
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	80
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	80
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	80
7.12 投资组合报告附注	80

§ 8 基金份额持有人信息	81
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	81
8.2 盈利投资者数量占比	82
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	82
8.4 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	82
8.5 发起式基金发起资金持有份额情况	82
§ 9 开放式基金份额变动	82
§ 10 重大事件揭示	83
10.1 基金份额持有人大会决议	83
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	83
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	83
10.4 基金投资策略的改变	83
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	83
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	83
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	84
10.8 其他重大事件	85
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	86
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	86
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	86
§ 12 备查文件目录	86
12.1 备查文件目录	86
12.2 存放地点	86
12.3 查阅方式	87

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金	
基金简称	中信建投睿利	
基金主代码	003308	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2016 年 12 月 07 日	
基金管理人	中信建投基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	134,838,713.23 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中信建投睿利 A	中信建投睿利 C
下属分级基金的交易代码	003308	004635
报告期末下属分级基金的份 额总额	31,670,714.92 份	103,167,998.31 份

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中信建投基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	朱伟	郭明
	联系电话	010-56950806	010-66105799
	电子邮箱	zhuweibj@csc.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4009-108-108	95588

传真	010-65289868	010-66105798
注册地址	北京市怀柔区桥梓镇八龙桥雅苑 3 号楼 1 室	北京市西城区复兴门内大街 55 号
办公地址	北京市东城区朝阳门内大街 188 号鸿安国际大厦 6、8 层	北京市西城区复兴门内大街 55 号
邮政编码	100010	100140
法定代表人	金强	廖林

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2026 年 01 月 01 日-2026 年 06 月 30 日）	
	中信建投睿利 A	中信建投睿利 C
本期已实现收益	2,695,259.69	8,904,446.18
本期利润	2,749,460.87	10,642,402.97
加权平均基金份额本期利润	0.1619	0.1828
本期加权平均净值利润率	9.03%	10.61%
本期基金份额净值增长率	14.96%	14.73%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2026 年 06 月 30 日）	
期末可供分配利润	26,564,888.44	78,988,196.25
期末可供分配基金份额利润	0.8388	0.7656
期末基金资产净值	58,235,603.36	182,156,194.56
期末基金份额净值	1.8388	1.7656
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2026 年 06 月 30 日）	
基金份额累计净值增长率	117.12%	108.73%

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

2、期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中信建投睿利 A 净值表现

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	11.27%	1.49%	11.25%	0.99%	0.02%	0.50%
过去六个月	14.96%	1.51%	12.94%	1.00%	2.02%	0.51%
过去一年	41.48%	1.25%	29.39%	0.85%	12.09%	0.40%
过去三年	70.05%	1.45%	38.39%	0.83%	31.66%	0.62%
过去五年	34.61%	1.36%	17.44%	0.77%	17.17%	0.59%
过去七年	85.48%	1.22%	43.93%	0.77%	41.55%	0.45%
自基金合同生效起至今	117.12%	1.15%	55.05%	0.75%	62.07%	0.40%

中信建投睿利 C 净值表现

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	11.16%	1.49%	11.25%	0.99%	-0.09%	0.50%
过去六个月	14.73%	1.51%	12.94%	1.00%	1.79%	0.51%
过去一年	40.91%	1.25%	29.39%	0.85%	11.52%	0.40%
过去三年	68.01%	1.45%	38.39%	0.83%	29.62%	0.62%
过去五年	31.94%	1.36%	17.44%	0.77%	14.50%	0.59%
过去七年	80.38%	1.22%	43.93%	0.77%	36.45%	0.45%
自基金合同生效起至今	108.73%	1.18%	56.56%	0.76%	52.17%	0.42%

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

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

中信建投睿利A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2016年12月07日-2026年06月30日)



中信建投睿利C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2017年05月26日-2026年06月30日)



注：1、以上第 1 张图为中信建投睿利 A 基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图，绘图日期为 2016 年 12 月 07 日（基金合同生效日）至 2026 年 06 月 30 日；

2、以上第 2 张图为中信建投睿利 C 基金份额累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图，绘图日期为 2017 年 05 月 26 日（首笔份额登记日）至 2026 年 06 月 30 日；

3、根据基金管理人于 2024 年 06 月 07 日披露的《关于中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金变更业绩比较基准并修订基金合同和托管协议的公告》《中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》，自 2024 年 06 月 07 日起，本基金的业绩比较基准由“60%×沪深 300 指数收益率+40%×中债综合指数收益率”变更为“中证 500 指数收益率×60%+中债综合指数收益率×40%”。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至报告期末，中信建投基金在管公募证券投资基金共 71 只。

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

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经 理（助理）期限		证 券 从 业 年 限	说明
		任职日期	离任 日期		
杨志武	本基金的基金经理、多元资产配置部行政负责人、兼任指数与量化投资部行政负责人	2023-03-17	-	14 年	中国籍，伯明翰大学货币银行与金融学硕士。曾任职于北京首创期货有限责任公司期权及场外衍生品部从事衍生品投资与研究，中国国际期货股份有限公司金融业务部从事衍生品投资与研究，中邮创业基金管理股份有限公司创新业务部从事证券投资研究、权益投资部担任投资经理。2022 年 3 月加入中信建投基金管理有限公司，现任本公司多元资产配置部行政负责人，兼任指数与量化投资部行政负责人、基金经理，担任中信建投稳利混合型证券投资基金、中信建投睿信灵活配置混合型证券投资基金、中信建投睿利灵活配置混

					合型发起式证券投资基金、中信建投量化进取 6 个月持有期混合型证券投资基金、中信建投双鑫债券型证券投资基金、中信建投致远混合型证券投资基金、中信建投上证科创板综合指数增强型证券投资基金、中信建投双和债券型证券投资基金基金经理。
艾翀	本基金的基金经理	2024-02-06	-	9 年	中国籍，美国宾夕法尼亚州立大学数学博士。曾任北京首创期货有限责任公司金融创新部量化策略和期权分析师，北京派朗科技有限公司金融工程部金融工程师，国金基金管理有限公司指数投资部、量化投资三部基金经理助理、基金经理，北京创金启富基金销售有限公司基金投资研究部量化投资主管，恒安标准人寿保险有限公司投资部高级投资经理。2023 年 9 月加入中信建投基金管理有限公司，现任本公司指数与量化投资部基金经理，担任中信建投睿信灵活配置混合型证券投资基金、中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金、中信建投量化进取 6 个月持有期混合型证券投资基金、中信建投量化精选 6 个月持有期混合型证券投资基金、中信建投致远混合型证券投资基金、中信建投上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金经理。

注：1、基金经理/基金经理助理任职日期、离任日期根据基金管理人对外披露的任免日期填写。首任基金经理，任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金运作整体合法合规。本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》《公开募集证券投资基金运作管理办法》《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》《公开募

集证券投资基金销售机构监督管理办法》《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、其他有关法律法规及基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，未发现不同投资组合之间存在非公平交易的情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026 年作为“十五五”规划的开局之年，上半年国内经济整体保持稳健运行态势，但内部结构分化明显，呈现出“外强内弱、供需错位”的显著特征。从经济总量来看，国民经济运行在合理区间内，一季度实现良好开局，二季度增速虽有所回落但仍处于适度水平，整体呈现出温和调整、稳中向好的基本格局。从产业结构来看，服务业继续发挥经济增长的主引擎作用，对经济总量的贡献度进一步提升；工业生产保持韧性，高技术制造业表现尤为突出，成为引领经济转型升级的重要力量。

对外贸易方面，上半年进出口形势表现亮眼，延续了近年来的高增长态势。出口结构持续优化，传统优势品类保持稳定增长的同时，以人工智能相关产品为代表的高技术附加值商品出口增速明显加快。贸易伙伴多元化趋势进一步强化，除传统欧美市场外，一带一路沿线国家和新兴市场份额稳步提升。值得关注的是，部分发达国家出于地缘政治考量推行的贸易限制措施，对部分行业出口造成了一定压力，但整体影响可控。

制造业景气度方面，制造业采购经理指数在上半年持续运行在荣枯线以上，显示实体经济扩张态势稳固。分行业看，高技术制造业景气度持续走强，装备制造业、计算机通信和其他电子设备制造业等细分行业表现突出，反映出产业升级趋势仍在加速。与之形成对比的是，传统制造业和部分周期性行业景气度仍然偏弱，产能调整和结构优化仍需时间。价格指数方面，工业生产者出厂价格指数自去年下半年转负后已连续多月保持正增长，反映出工业领域供需关系有所改善，但居民消费价格指数仍处于温和区间，显示内需修复力度仍需加强。

从需求端看，固定资产投资整体偏弱，主要受房地产开发投资拖累。房地产市场仍处于深度调整期，尽管一线城市局部区域出现了回暖迹象，但整体投资下行压力尚未明显缓解。与之形成对比的是，基础设施投资在财政政策支持下保持稳定增长，高端制造业投资则受到企业盈利改善和产业

升级需求驱动，展现出较好的增长韧性。消费方面，整体呈现温和复苏态势，服务型消费增速明显高于商品消费，文旅、餐饮、体育等接触型消费恢复较快；而商品消费仍然较为疲软，反映出居民消费意愿和消费能力有待进一步提升。

总体而言，上半年国内经济运行的主要矛盾在于：生产端强于需求端，外需强于内需，高技术产业强于传统产业。这种结构性差异既是产业升级过程中的正常现象，也反映出内需修复和房地产市场调整仍是当前需要重点关注的领域。

从国际环境看，美国经济在上半年保持了一定韧性，但增长动力有所减弱。就业市场整体稳定，失业率维持在较低水平，但新增非农就业的波动性有所增加。通胀压力仍然是美联储货币政策面临的主要挑战，核心物价指数的黏性超出市场预期，使得降息预期一再延后。地缘政治方面，中东地区的军事冲突在三月份骤然升级，一度推高国际油价和全球通胀预期，加大了全球经济滞胀风险。好在各方在年中达成停火协议，地缘风险显著缓和，油价也逐步回落至冲突前水平。

美联储货币政策走向是上半年全球资本市场关注的焦点。新任主席上任后首次公开表态偏鹰派，明确传递出对通胀持续的担忧，并暗示未来仍有加息可能。这一表态打乱了市场此前的降息预期，导致全球主要货币汇率波动加大，新兴市场资本外流压力有所上升。与之相对应，日本央行为稳定汇率而加息，进一步加剧了全球流动性趋紧态势。

美国权益市场上半年呈现先抑后扬的走势。一季度受科技股估值回调和地缘政治风险影响，主要指数出现明显调整；进入二季度后，随着冲突缓和和企业盈利表现亮眼，市场迎来修复行情，主要指数纷纷创出历史新高。科技股依然是市场的核心驱动力，人工智能产业链相关公司业绩大幅超出预期，龙头企业股价屡创新高，充分体现了市场对 AI 产业前景的乐观预期。

回顾上半年 A 股市场，整体呈现极致分化的结构性行情，被誉为“科技牛”。从主要指数表现看，宽基指数涨幅温和，但代表新兴产业方向的指数则大幅跑赢，创业板指和科创综指表现抢眼。行业层面，分化极为显著：电子、通信等科技成长板块受到资金追捧，涨幅居前；而商贸零售、农林牧渔、美容护理等传统行业则持续调整，跌幅明显，行业间表现差距超过百倍。个股层面，翻倍股数量大幅增加，主要集中在半导体、电子化学品、光学光电子等与人工智能密切相关的细分领域，反映出市场资金高度集中于科技主线。

债券市场上半年表现稳健，主要国债收益率中枢较年初有所下移，反映出市场对国内流动性保持合理充裕的预期。债券市场的阶段性特征较为明显：一季度走势相对平稳，收益率波动有限；二季度受资金面变化影响有所波动，但整体仍处于低位区间。

报告期内依然坚持价值投资的理念，在复杂的经济环境与宏观事件冲击背景下，利用量化方法对各种风格与行业进行了均衡的配置，充分利用行业和个股的分散度，降低资产组合的波动，力争在行业与风格均衡配置的基础上，追求组合长期相对稳健的回报。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中信建投睿利 A 基金份额净值为 1.8388 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 14.96%，同期业绩比较基准收益率为 12.94%；截至报告期末中信建投睿利 C 基金份额净值为 1.7656 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 14.73%，同期业绩比较基准收益率为 12.94%。

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 2026 年三季度，国内经济基本面有望在政策组合拳的支撑下进一步巩固回升态势。财政政策方面，专项债发行提速、政策性开发性金融工具加快落地，将为基础设施投资和重大项目建设提供充足资金支持，预计基建投资有望企稳回升。货币政策将继续保持灵活适度，流动性有望维持合理充裕，为实体经济提供稳定的融资环境。

产业政策方面，“十五五”规划确定的重大战略项目将进入集中开工期，人工智能、集成电路、新能源等战略性新兴产业将迎来新的发展机遇。高技术制造业和装备制造业景气度有望持续提升，对经济增长的贡献将进一步加大。与此同时，产业升级过程中，传统行业的产能出清和结构优化仍将持续推进，头部企业将在竞争中脱颖而出，行业集中度有望进一步提升。

从需求结构看，随着工业企业盈利持续改善，居民收入有望稳步增长，进而带动消费能力提升和消费意愿增强。服务型消费有望继续保持较快增长，商品消费的修复力度也值得期待。房地产市场方面，政策支持效果将逐步显现，一线城市有望延续企稳态势，部分二线城市或现边际改善，但整体市场信心的恢复仍需时间。

外部环境方面，全球经济仍面临诸多不确定性。主要经济体增长放缓风险仍存，美联储货币政策走向受制于通胀数据仍将保持一定的紧缩倾向，全球流动性环境整体偏紧。地缘政治风险虽有所缓和，但仍存在反复可能。中国面临的外部环境复杂严峻，但我们也应看到积极因素：中国制造业的全产业链优势和完整供应链体系仍然稳固，出口韧性有保障；人口结构变化虽然带来挑战，但也孕育着新的需求增长点；新技术、新产业、新业态、新模式的发展潜力巨大。

证券市场展望方面，我们认为 A 股在三季度有望延续震荡上行态势，结构性机会依然丰富。科技成长板块的高景气行情有望延续，但市场关注的焦点将从“讲故事”逐步转向“看业绩”，真正具备核心竞争力和业绩兑现能力的公司将获得市场青睐。投资者应警惕估值与业绩错配带来的回调风险，注重基本面研究。

投资策略上，我们建议采用“哑铃策略”构建攻守兼备的投资组合。在进攻端，重点聚焦三条主线：一是人工智能算力基础设施及应用相关产业链，包括高端芯片、服务器、数据中心等；二是“人工智能+”与实体经济的深度融合，重点关注工业母机、人形机器人、智能驾驶等细分领域；三是受益于供给侧改革和“反内卷”的周期行业，如有色金属、锂电产业链上游、光伏设备等具备涨价逻辑的板块。在防守端，建议配置银行、电力、非银金融等低估值、高股息的价值品种，作为组合的安全垫，以应对市场可能出现的阶段性调整。

与此同时，我们也需要密切关注以下风险因素：一是海外经济下行超预期可能引发外部需求大幅收缩；二是地缘政治风险出现反复，对全球供应链造成冲击；三是美联储政策若超预期转向紧缩，可能引发全球资产价格剧烈调整；四是国内经济修复不及预期，特别是内需和地产恢复力度低于预期；五是科技板块估值与业绩兑现之间的错配可能引发结构性回调。

总体而言，我们对中长期保持乐观态度。中国经济正在经历深刻的转型升级期，虽然过程不会一帆风顺，但科技创新驱动增长的新动能正在积聚。权益市场的长期配置价值依然突出，结构性机会将持续涌现。我们将继续秉持价值投资理念，结合宏观经济变化和市场风格轮动，动态优化投资组合配置，努力为持有人创造长期稳健回报。同时，我们也将密切追踪宏观政策走向和行业景气度变化，灵活把握市场节奏，在控制风险的前提下，捕捉优质投资机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配，符合相关法律及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

本基金 2025 年 10 月 27 日至 2026 年 2 月 8 日连续六十个工作日以上基金资产净值低于 5000 万元，基金管理人已向中国证监会报送了相关解决方案的报告。2026 年 1 月 21 日至 2026 年 2 月 9 日，本基金的审计费、信息披露费等相关固定费用由基金管理人固有资金承担。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

本报告期内，本基金的管理人——中信建投基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产

净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，本基金托管人未发现损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本基金托管人依法对中信建投基金管理有限公司编制和披露的本基金 2026 年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金

报告截止日：2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	29,027,715.30	5,084,974.02
结算备付金		1,273,838.06	1,376,836.40
存出保证金		2,867,568.00	172,910.40
交易性金融资产	6.4.7.2	209,041,633.94	32,123,963.00
其中：股票投资		209,009,932.67	32,123,963.00
基金投资		-	-
债券投资		31,701.27	-
资产支持证券		-	-
投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		1,990,166.53	832,324.47
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		244,200,921.83	39,591,008.29
负 债 和 净 资 产	附注号	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负 债：			

短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		3,430,654.14	4,153,429.62
应付管理人报酬		238,680.56	39,260.21
应付托管费		39,780.09	6,543.37
应付销售服务费		60,835.95	8,901.87
应付投资顾问费		-	-
应交税费		3,759.41	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	35,413.76	81.36
负债合计		3,809,123.91	4,208,216.43
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	134,838,713.23	22,765,249.63
未分配利润	6.4.7.8	105,553,084.69	12,617,542.23
净资产合计		240,391,797.92	35,382,791.86
负债和净资产总计		244,200,921.83	39,591,008.29

注：报告截止日 2026 年 06 月 30 日，基金份额总额 134,838,713.23 份，其中中信建投睿利 A 类基金份额净值 1.8388 元，基金份额 31,670,714.92 份；中信建投睿利 C 类基金份额净值 1.7656 元，基金份额 103,167,998.31 份。

6.2 利润表

会计主体：中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
一、营业总收入		14,519,005.51	4,713,911.66
1. 利息收入		25,129.48	8,025.64
其中：存款利息收入	6.4.7.9	25,129.48	8,025.64
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		12,150,681.56	3,188,844.65
其中：股票投资收益	6.4.7.10	10,216,672.20	2,869,453.36
基金投资收益		-	-

债券投资收益	6.4.7.11	23,410.58	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.12	720,605.54	115,293.31
股利收益	6.4.7.13	1,189,993.24	204,097.98
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	1,792,157.97	1,513,681.60
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	551,036.50	3,359.77
减：二、营业总支出		1,127,141.67	203,637.43
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	771,918.96	158,687.47
2. 托管费	6.4.10.2.2	128,653.14	26,447.92
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	197,740.95	17,246.04
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.16	-	-
7. 税金及附加		2,521.24	549.09
8. 其他费用	6.4.7.17	26,307.38	706.91
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		13,391,863.84	4,510,274.23
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		13,391,863.84	4,510,274.23
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		13,391,863.84	4,510,274.23

6.3 净资产变动表

会计主体：中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金

本报告期：2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项 目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	22,765,249.63	12,617,542.23	35,382,791.86
二、本期期初净资产	22,765,249.63	12,617,542.23	35,382,791.86
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	112,073,463.60	92,935,542.46	205,009,006.06
（一）、综合收益总额	-	13,391,863.84	13,391,863.84

(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	112,073,463.60	79,543,678.62	191,617,142.22
其中: 1. 基金申购款	229,617,009.02	169,131,187.01	398,748,196.03
2. 基金赎回款	-117,543,545.42	-89,587,508.39	-207,131,053.81
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	134,838,713.23	105,553,084.69	240,391,797.92
项 目	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	25,430,455.78	2,057,750.43	27,488,206.21
二、本期期初净资产	25,430,455.78	2,057,750.43	27,488,206.21
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-3,791,703.76	4,064,787.45	273,083.69
(一)、综合收益总额	-	4,510,274.23	4,510,274.23
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-3,791,703.76	-445,486.78	-4,237,190.54
其中: 1. 基金申购款	3,407,088.24	668,756.47	4,075,844.71
2. 基金赎回款	-7,198,792.00	-1,114,243.25	-8,313,035.25
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	21,638,752.02	6,122,537.88	27,761,289.90

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署:

金强

张欣宇

谭保民

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可(2016)第 1962 号《关于准予中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金注册的批复》的核准,由中信建投基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)验证出具普华永道中天验字(2016)第 1356 号验资报告。经向中国证监会备案,《中信建投睿利灵活配置

混合型发起式证券投资基金基金合同》于 2016 年 12 月 7 日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为 47,686,882.68 份基金份额，其中认购资金利息折合 19,936.07 份基金份额。本基金的基金管理人为中信建投基金管理有限公司，基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

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

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

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

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金 2026 年 06 月 30 日的财务状况以及 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日。

6.4.4.2 记账本位币

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

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

（1）金融资产分类

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

（2）金融负债分类

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

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

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

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

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。

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

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

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

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

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

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

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

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

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意

义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

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

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

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

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

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

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

（4）如有新增事项，按国家最新规定估值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

6.4.4.7 实收基金

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

6.4.4.8 损益平准金

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

（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

（2）交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

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

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

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

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

（5）买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

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

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

6.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

6.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

6.4.4.12 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

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

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

（1）印花税

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

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

（2）增值税

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

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

的利息收入属于金融同业往来利息收入；

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

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

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

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

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

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

（3）企业所得税

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

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

（4）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税〔2008〕132 号《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所

得有关个人所得税政策的通知》的规定，自 2008 年 10 月 9 日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日
活期存款	1,695,413.63
等于：本金	1,694,988.68
加：应计利息	424.95
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限 1 个月以内	-
存款期限 1-3 个月	-
存款期限 3 个月以上	-
其他存款	27,332,301.67
等于：本金	27,330,498.26
加：应计利息	1,803.41
减：坏账准备	-
合计	29,027,715.30

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	205,866,728.53	-	209,009,932.67	3,143,204.14
贵金属投资-金交所	-	-	-	-

黄金合约					
债券	交易所市场	31,700.00	1.27	31,701.27	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	31,700.00	1.27	31,701.27	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		205,898,428.53	1.27	209,041,633.94	3,143,204.14

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	18,965,536.08	-	-	-
一股指期货	18,965,536.08	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	18,965,536.08	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IM2607	中证 1000 股指期货 2607 合约	11	19,117,120.00	151,583.92
合计				151,583.92
减：可抵销期货暂收款				151,583.92
净额				0.00

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

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

6.4.7.5 其他资产

无余额。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	839.87
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	24,261.09
其他应付	10,312.80
合计	35,413.76

6.4.7.7 实收基金

中信建投睿利 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	5,774,345.39	5,774,345.39
本期申购	40,682,479.84	40,682,479.84
本期赎回（以“-”号填列）	-14,786,110.31	-14,786,110.31
本期末	31,670,714.92	31,670,714.92

中信建投睿利 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	16,990,904.24	16,990,904.24
本期申购	188,934,529.18	188,934,529.18
本期赎回（以“-”号填列）	-102,757,435.11	-102,757,435.11
本期末	103,167,998.31	103,167,998.31

注：申购含红利再投、转换入、级别调整入份额；赎回含转换出、级别调整出份额（如适用）。

6.4.7.8 未分配利润

中信建投睿利 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,969,880.00	-508,087.97	3,461,792.03
本期期初	3,969,880.00	-508,087.97	3,461,792.03
本期利润	2,695,259.69	54,201.18	2,749,460.87
本期基金份额交易产生的变动数	21,637,797.07	-1,284,161.53	20,353,635.54
其中：基金申购款	34,483,463.22	-2,061,096.91	32,422,366.31
基金赎回款	-12,845,666.15	776,935.38	-12,068,730.77
本期已分配利润	-	-	-
本期末	28,302,936.76	-1,738,048.32	26,564,888.44

中信建投睿利 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	10,678,425.60	-1,522,675.40	9,155,750.20
本期期初	10,678,425.60	-1,522,675.40	9,155,750.20
本期利润	8,904,446.18	1,737,956.79	10,642,402.97
本期基金份额交易产生的变动数	65,367,713.26	-6,177,670.18	59,190,043.08
其中：基金申购款	146,876,274.67	-10,167,453.97	136,708,820.70
基金赎回款	-81,508,561.41	3,989,783.79	-77,518,777.62
本期已分配利润	-	-	-
本期末	84,950,585.04	-5,962,388.79	78,988,196.25

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	4,129.28
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	15,850.04
结算备付金利息收入	4,813.56
其他	336.60
合计	25,129.48

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	734,149,510.68

减：卖出股票成本总额	722,741,544.64
减：交易费用	1,191,293.84
买卖股票差价收入	10,216,672.20

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
债券投资收益——利息收入	8.30
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	23,402.28
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	23,410.58

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	70,512.13
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	47,100.00
减：应计利息总额	7.03
减：交易费用	2.82
买卖债券差价收入	23,402.28

6.4.7.12 衍生工具收益

6.4.7.12.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.12.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
期货投资	720,605.54

6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	1,189,993.24

其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,189,993.24

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	1,633,333.46
——股票投资	1,633,333.46
——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	162,583.92
——权证投资	-
——期货投资	162,583.92
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	3,759.41
合计	1,792,157.97

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
基金赎回费收入	551,024.40
转换费收入	12.10
合计	551,036.50

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

6.4.7.16 信用减值损失

无。

6.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日
审计费用	2,205.70

信息披露费	22,055.39
证券出借违约金	-
汇划手续费	2,046.29
合计	26,307.38

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无重大资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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

无。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
中信建投基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
中信建投证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构
中信建投期货有限公司	与基金管理人同一控股股东、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中信建投证券股份有限公司	1,632,061,947.05	100.00%	440,049,072.05	100.00%

6.4.10.1.2 权证交易

无。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
中信建投证券股份有限公司	70,512.13	100.00%	-	-

6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中信建投证券股份有限公司	719,473.77	100.00%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中信建投证券股份有限公司	193,393.61	100.00%	-	-

注：1、上述佣金按本基金的基金管理人与对方协商确定的佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司代收的证管费和经手费的净额列示。

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	771,918.96	158,687.47

其中：应支付销售机构的客户维护费	339,935.93	46,856.82
应支付基金管理人的净管理费	431,983.03	111,830.65

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 1.20% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.20% / 当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	128,653.14	26,447.92

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

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.20% / 当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中信建投睿利 A	中信建投睿利 C	合计
中信建投基金管理有限公司	-	26,956.05	26,956.05
中信建投证券股份有限公司	-	133,638.01	133,638.01
中国工商银行股份有限公司	-	306.28	306.28
合计	-	160,900.34	160,900.34
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中信建投睿利 A	中信建投睿利 C	合计
中信建投基金管理有限公司	-	6,784.88	6,784.88
中信建投证券股份有限公司	-	8,619.97	8,619.97
中国工商银行股份有限公司	-	129.10	129.10
合计	-	15,533.95	15,533.95

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

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

中信建投睿利 A

份额单位：份

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
基金合同生效日（2016 年 12 月 07 日）持有的基金份额	10,000,800.00	10,000,800.00
报告期初持有的基金份额	-	2,000,800.00
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	2,000,800.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	14.4237%

中信建投睿利 C

份额单位：份

项目	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
报告期初持有的基金份额	-	2,124,269.78
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	-	2,124,269.78
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	27.3496%

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026 年 01 月 01 日至 2026 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入

中国工商银行股份有限公司	1,695,413.63	4,129.28	1,168,624.24	797.95
中信建投证券股份有限公司	27,312,178.07	15,825.06	1,591,099.09	2,700.31

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

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金固定费用为其他费用项目中“审计费用”等费用。自 2026 年 1 月 21 日起至 2026 年 2 月 9 日，本基金的固定费用由本基金管理人承担，共计人民币 3,013.70 元。

6.4.11 利润分配情况

无。

6.4.12 期末（2026 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	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
688797	臻宝科技	2026 年 06 月 16 日	6 个月	新股流通受限	44.56	468.67	103	4,589.68	48,273.01	-
001399	惠科股份	2026 年 06 月 16 日	6 个月	新股流通受限	10.12	27.73	1,382	13,985.84	38,322.86	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位：张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
127114	宣化转债	2026 年 06 月 26 日	一个月 内(含)	新债未上市	100.00	100.00	197	19,700.00	19,700.43	-
113706	金帝	2026	一个月	新债	100.00	100.01	120	12,000.00	12,000.84	-

	转债	年 06 月 15 日	内(含)	未上 市						
--	----	-------------------	------	---------	--	--	--	--	--	--

- 注：1、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股中需要限售的部分或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。
- 2、基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。
- 3、基金作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。
- 4、基金通过询价转让受让的科创板股份，在受让后 6 个月内不得转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代 码	股 票 名 称	停牌 日期	停 牌 原 因	期末估 值单价	复牌 日期	复牌开 盘单价	数量 (股)	期末成本总 额	期末估值总 额	备 注
688072	拓 荆 科 技	2026- 06-29	重 大 事 项	832.00	2026- 07-13	890.99	200	113,200.00	166,400.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金管理人的风险管理机构由董事会下属的公司风险控制与合规委员会、督察长、公司风险管理委员会、风险管理部以及各个业务部门组成。公司实行全面、系统的风险管理，风险管理覆盖公司所有战略环节、业务环节和操作环节。同时制定了系统化的风险管理程序，对风险管理的整个流程进行评估和改进。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制与合规委员会，负责制定风险

管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面，由风险管理部负责协调与各部门合作完成运作风险管理。

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	31,701.27	-
未评级	-	-
合计	31,701.27	-

注：以上按长期信用评级列示的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

于本期末，除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在一个月以内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（净资产）无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 6.4.12（如有）。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026 年 06 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	29,027,715.30	-	-	-	29,027,715.30
结算备付金	1,273,838.06	-	-	-	1,273,838.06
存出保证金	-	-	-	2,867,568.00	2,867,568.00
交易性金融资产	-	-	31,701.27	209,009,932.67	209,041,633.94
应收申购款	-	-	-	1,990,166.53	1,990,166.53
资产总计	30,301,553.36	-	31,701.27	213,867,667.20	244,200,921.83
负债					
应付赎回款	-	-	-	3,430,654.14	3,430,654.14
应付管理人报酬	-	-	-	238,680.56	238,680.56
应付托管费	-	-	-	39,780.09	39,780.09
应付销售服务费	-	-	-	60,835.95	60,835.95
应交税费	-	-	-	3,759.41	3,759.41
其他负债	-	-	-	35,413.76	35,413.76
负债总计	-	-	-	3,809,123.91	3,809,123.91
利率敏感度缺口	30,301,553.36	-	31,701.27	210,058,543.29	240,391,797.92
上年度末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	5,084,974.02	-	-	-	5,084,974.02

结算备付金	1,376,836.40	-	-	-	1,376,836.40
存出保证金	-	-	-	172,910.40	172,910.40
交易性金融资产	-	-	-	32,123,963.00	32,123,963.00
应收申购款	-	-	-	832,324.47	832,324.47
资产总计	6,461,810.42	-	-	33,129,197.87	39,591,008.29
负债					
应付赎回款	-	-	-	4,153,429.62	4,153,429.62
应付管理人报酬	-	-	-	39,260.21	39,260.21
应付托管费	-	-	-	6,543.37	6,543.37
应付销售服务费	-	-	-	8,901.87	8,901.87
其他负债	-	-	-	81.36	81.36
负债总计	-	-	-	4,208,216.43	4,208,216.43
利率敏感度缺口	6,461,810.42	-	-	28,920,981.44	35,382,791.86

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026 年 06 月 30 日		上年度末 2025 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	209,009,932.67	86.95	32,123,963.00	90.79
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	31,701.27	0.01	—	—
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	209,041,633.94	86.96	32,123,963.00	90.79

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额 (单位：人民币元)	
		本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	16,545,922.85	2,658,204.90
	业绩比较基准下降 5%	-16,545,922.85	-2,658,204.90

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

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

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026 年 06 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	208,756,936.80	32,123,963.00
第二层次	198,101.27	—
第三层次	86,595.87	—
合计	209,041,633.94	32,123,963.00

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

6.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

6.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

6.4.15.3

本财务报表已于 2026 年 8 月 28 日经本基金的基金管理人批准。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	209,009,932.67	85.59
	其中：股票	209,009,932.67	85.59
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	31,701.27	0.01
	其中：债券	31,701.27	0.01
	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	30,301,553.36	12.41

8	其他各项资产	4,857,734.53	1.99
9	合计	244,200,921.83	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	76,208.00	0.03
B	采矿业	5,266,323.00	2.19
C	制造业	171,745,002.07	71.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	944,984.00	0.39
E	建筑业	882,470.00	0.37
F	批发和零售业	5,189,420.00	2.16
G	交通运输、仓储和邮政业	3,494,916.00	1.45
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,925,992.60	4.96
J	金融业	266,780.00	0.11
K	房地产业	380,615.00	0.16
L	租赁和商务服务业	1,512,153.00	0.63
M	科学研究和技术服务业	4,019,474.00	1.67
N	水利、环境和公共设施管理业	2,296,351.00	0.96
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	623,478.00	0.26
Q	卫生和社会工作	52,472.00	0.02
R	文化、体育和娱乐业	279,566.00	0.12
S	综合	53,728.00	0.02
	合计	209,009,932.67	86.95

7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	688002	睿创微纳	11,400	1,763,466.00	0.73
2	300308	中际旭创	1,300	1,651,000.00	0.69
3	688025	杰普特	3,400	1,598,000.00	0.66
4	300475	香农芯创	5,072	1,521,600.00	0.63
5	688519	南亚新材	3,900	1,482,156.00	0.62
6	002182	宝武镁业	93,200	1,451,124.00	0.60

7	603986	兆易创新	1,700	1,385,500.00	0.58
8	688127	蓝特光学	14,100	1,376,160.00	0.57
9	000603	盛达资源	57,100	1,319,010.00	0.55
10	603588	高能环境	68,500	1,315,200.00	0.55
11	300201	海伦哲	60,900	1,283,163.00	0.53
12	300861	美畅股份	50,200	1,264,538.00	0.53
13	603876	鼎胜新材	46,300	1,204,263.00	0.50
14	688390	固德威	10,500	1,139,355.00	0.47
15	000551	创元科技	54,500	1,124,335.00	0.47
16	300054	鼎龙股份	9,900	1,049,103.00	0.44
17	002250	联化科技	76,700	1,048,489.00	0.44
18	002838	道恩股份	32,900	1,007,398.00	0.42
19	688630	芯碁微装	1,800	988,902.00	0.41
20	300842	帝科股份	10,900	971,953.00	0.40
21	002928	华夏航空	137,500	961,125.00	0.40
22	600230	沧州大化	72,900	949,158.00	0.39
23	603530	神马电力	18,600	946,740.00	0.39
24	605196	华通线缆	36,100	942,210.00	0.39
25	002810	山东赫达	37,900	936,130.00	0.39
26	603317	天味食品	71,600	931,516.00	0.39
27	688498	源杰科技	490	924,140.00	0.38
28	688095	福昕软件	15,000	891,450.00	0.37
29	000962	东方钨业	9,600	869,760.00	0.36
30	000801	四川九洲	66,800	864,392.00	0.36
31	300363	博腾股份	52,900	859,096.00	0.36
32	603663	三祥新材	8,900	857,070.00	0.36
33	001309	德明利	900	848,610.00	0.35
34	002986	宇新股份	71,400	844,662.00	0.35
35	300036	超图软件	74,700	841,869.00	0.35
36	688408	中信博	26,100	839,115.00	0.35
37	600595	中孚实业	148,800	836,256.00	0.35
38	603115	海星股份	6,800	832,796.00	0.35
39	605289	罗曼股份	5,600	812,000.00	0.34
40	301217	铜冠铜箔	4,800	792,336.00	0.33
41	600429	三元股份	195,200	788,608.00	0.33
42	002649	博彦科技	94,300	767,602.00	0.32
43	300843	胜蓝股份	4,900	765,625.00	0.32
44	603612	索通发展	42,100	763,273.00	0.32
45	300793	佳禾智能	67,800	762,750.00	0.32
46	002384	东山精密	2,900	760,815.00	0.32
47	600869	远东股份	22,600	756,422.00	0.31
48	688388	嘉元科技	17,100	752,400.00	0.31
49	300953	震裕科技	5,600	748,720.00	0.31

50	688155	先惠技术	9,200	744,188.00	0.31
51	300814	中富电路	3,600	736,200.00	0.31
52	603950	长源东谷	8,700	734,541.00	0.31
53	301536	星宸科技	5,700	733,647.00	0.31
54	688179	阿拉丁	26,400	731,544.00	0.30
55	603067	振华股份	15,800	731,382.00	0.30
56	002947	恒铭达	9,600	730,080.00	0.30
57	688383	新益昌	3,800	714,552.00	0.30
58	603713	密尔克卫	10,000	711,700.00	0.30
59	688257	新锐股份	6,860	699,034.00	0.29
60	000049	德赛电池	29,800	696,426.00	0.29
61	600150	中国船舶	20,600	696,074.00	0.29
62	688049	炬芯科技	14,800	694,268.00	0.29
63	601233	桐昆股份	31,700	686,305.00	0.29
64	300073	当升科技	14,000	672,560.00	0.28
65	002925	盈趣科技	27,200	670,752.00	0.28
66	600399	抚顺特钢	162,300	667,053.00	0.28
67	688186	广大特材	44,000	666,600.00	0.28
68	603638	艾迪精密	28,400	665,980.00	0.28
69	688690	纳微科技	15,100	665,910.00	0.28
70	600961	株冶集团	20,500	663,995.00	0.28
71	002487	大金重工	11,200	649,264.00	0.27
72	601069	西部黄金	29,100	640,200.00	0.27
73	688668	鼎通科技	1,700	634,610.00	0.26
74	002290	禾盛新材	6,900	633,903.00	0.26
75	301093	华兰股份	4,600	623,898.00	0.26
76	600346	恒力石化	34,900	618,079.00	0.26
77	002833	弘亚数控	31,600	609,564.00	0.25
78	002979	雷赛智能	10,900	608,002.00	0.25
79	002466	天齐锂业	9,900	607,068.00	0.25
80	002237	恒邦股份	40,900	600,821.00	0.25
81	002916	深南电路	1,300	595,270.00	0.25
82	688510	航亚科技	24,900	594,612.00	0.25
83	603127	昭衍新药	15,500	592,410.00	0.25
84	603031	安孚科技	11,100	591,075.00	0.25
85	300750	宁德时代	1,500	589,515.00	0.25
86	603931	格林达	9,900	588,060.00	0.24
87	002935	天奥电子	26,700	585,798.00	0.24
88	300684	中石科技	9,600	585,600.00	0.24
89	300492	华图山鼎	17,000	583,950.00	0.24
90	300938	信测标准	11,700	583,596.00	0.24
91	002534	西子洁能	31,400	582,470.00	0.24
92	002913	奥士康	9,100	581,854.00	0.24

93	002791	坚朗五金	44,300	580,330.00	0.24
94	300257	开山股份	20,200	579,336.00	0.24
95	300919	中伟新材	13,200	577,500.00	0.24
96	601020	华钰矿业	23,900	573,361.00	0.24
97	002008	大族激光	3,800	570,418.00	0.24
98	603306	华懋科技	5,500	570,295.00	0.24
99	603799	华友钴业	11,800	569,468.00	0.24
100	600176	中国巨石	7,800	568,464.00	0.24
101	300689	澄天伟业	8,100	568,458.00	0.24
102	688621	阳光诺和	10,300	565,573.00	0.24
103	301086	鸿富瀚	2,700	565,056.00	0.24
104	301308	江波龙	800	563,040.00	0.23
105	605060	联德股份	9,800	556,052.00	0.23
106	603063	禾望电气	10,500	555,345.00	0.23
107	600183	生益科技	3,200	554,880.00	0.23
108	002396	星网锐捷	28,850	553,054.50	0.23
109	688136	科兴制药	26,600	550,886.00	0.23
110	002478	常宝股份	86,600	535,188.00	0.22
111	600129	太极集团	39,200	531,944.00	0.22
112	000975	山金国际	31,000	527,000.00	0.22
113	300277	汽轮科技	34,600	520,384.00	0.22
114	688663	新风光	5,800	513,068.00	0.21
115	300502	新易盛	840	509,880.00	0.21
116	688258	卓易信息	4,300	509,722.00	0.21
117	301358	湖南裕能	6,700	508,329.00	0.21
118	605168	三人行	9,900	501,336.00	0.21
119	688226	威腾电气	11,700	501,111.00	0.21
120	002324	普利特	41,100	496,077.00	0.21
121	300274	阳光电源	3,100	492,962.00	0.21
122	002912	中新赛克	26,700	492,348.00	0.20
123	688776	国光电气	8,000	490,720.00	0.20
124	002969	嘉美包装	34,800	489,984.00	0.20
125	002246	北化股份	26,000	488,800.00	0.20
126	002120	韵达股份	76,600	487,176.00	0.20
127	301345	涛涛车业	2,100	485,100.00	0.20
128	002493	荣盛石化	45,000	483,750.00	0.20
129	603901	永创智能	44,400	482,628.00	0.20
130	000534	万泽股份	17,600	481,536.00	0.20
131	300389	艾比森	37,500	480,750.00	0.20
132	688553	汇宇制药	45,100	479,413.00	0.20
133	002539	云图控股	42,300	478,836.00	0.20
134	002080	中材科技	5,300	477,000.00	0.20
135	600603	广汇物流	109,500	476,325.00	0.20

136	002930	宏川智慧	51,700	475,640.00	0.20
137	002922	伊戈尔	14,500	475,600.00	0.20
138	002768	国恩股份	9,100	473,746.00	0.20
139	600189	泉阳泉	62,900	473,637.00	0.20
140	688001	华兴源创	5,500	471,350.00	0.20
141	600710	苏美达	49,200	470,352.00	0.20
142	301155	海力风电	10,900	467,610.00	0.19
143	300850	新强联	17,400	466,320.00	0.19
144	603583	捷昌驱动	20,300	462,840.00	0.19
145	600903	贵州燃气	69,700	462,808.00	0.19
146	688767	博拓生物	14,200	461,642.00	0.19
147	688059	华锐精密	2,300	459,333.00	0.19
148	600571	信雅达	46,700	455,325.00	0.19
149	300008	天海防务	75,100	455,106.00	0.19
150	688308	欧科亿	2,500	454,525.00	0.19
151	600686	金龙汽车	39,900	450,471.00	0.19
152	605118	力鼎光电	12,900	450,081.00	0.19
153	603507	振江股份	13,600	447,304.00	0.19
154	600962	国投中鲁	14,800	446,516.00	0.19
155	688525	佰维存储	900	445,257.00	0.19
156	688196	卓越新能	12,400	445,160.00	0.19
157	600590	泰豪科技	43,800	442,380.00	0.18
158	002371	北方华创	500	442,280.00	0.18
159	001298	好上好	21,200	439,900.00	0.18
160	688037	芯源微	1,000	439,050.00	0.18
161	002956	西麦食品	21,100	438,036.00	0.18
162	601869	长飞光纤	800	436,720.00	0.18
163	600826	兰生股份	49,500	435,105.00	0.18
164	002221	东华能源	81,300	427,638.00	0.18
165	002558	巨人网络	15,400	424,424.00	0.18
166	002020	京新药业	33,600	419,664.00	0.17
167	688502	茂莱光学	600	416,160.00	0.17
168	601339	百隆东方	60,300	408,231.00	0.17
169	603928	兴业股份	27,560	407,888.00	0.17
170	300857	协创数据	1,200	407,880.00	0.17
171	002827	高争民爆	16,800	405,552.00	0.17
172	002891	中宠股份	15,100	403,472.00	0.17
173	688575	亚辉龙	46,000	402,960.00	0.17
174	002139	拓邦股份	42,300	402,696.00	0.17
175	300811	铂科新材	4,200	398,538.00	0.17
176	688981	中芯国际	2,500	397,050.00	0.17
177	601567	三星电气	26,500	395,910.00	0.16
178	300327	中颖电子	12,200	391,010.00	0.16

179	002079	苏州固锴	25,900	389,277.00	0.16
180	688778	厦钨新能	7,100	386,240.00	0.16
181	301377	鼎泰高科	700	385,630.00	0.16
182	688652	京仪装备	1,900	380,323.00	0.16
183	603380	易德龙	8,400	378,756.00	0.16
184	300855	图南股份	12,100	378,246.00	0.16
185	000633	合金投资	79,400	377,944.00	0.16
186	301219	腾远钴业	6,880	377,024.00	0.16
187	688669	聚石化学	3,500	374,500.00	0.16
188	600366	宁波韵升	25,500	374,340.00	0.16
189	000672	上峰材料	15,800	374,144.00	0.16
190	600547	山东黄金	16,100	371,749.00	0.15
191	300607	拓斯达	9,000	371,070.00	0.15
192	000933	神火股份	17,400	368,880.00	0.15
193	002643	万润股份	17,300	362,435.00	0.15
194	301087	可孚医疗	7,600	362,140.00	0.15
195	688279	峰岬科技	1,600	359,104.00	0.15
196	002541	鸿路钢构	20,700	358,524.00	0.15
197	002043	兔宝宝	31,500	349,020.00	0.15
198	002050	三花智控	7,900	346,257.00	0.14
199	688789	宏华数科	6,500	345,605.00	0.14
200	003010	若羽臣	14,200	345,060.00	0.14
201	002876	三利谱	9,800	345,058.00	0.14
202	603881	数据港	13,800	345,000.00	0.14
203	002150	正泰电源	13,600	343,944.00	0.14
204	002029	七匹狼	44,600	340,744.00	0.14
205	002780	三夫户外	28,000	339,920.00	0.14
206	688018	乐鑫科技	2,600	332,592.00	0.14
207	600409	三友化工	54,200	331,162.00	0.14
208	600882	妙可蓝多	20,700	330,993.00	0.14
209	688235	百济神州	1,300	330,993.00	0.14
210	000061	农产品	59,100	330,960.00	0.14
211	002709	天赐材料	6,400	329,152.00	0.14
212	002511	中顺洁柔	49,400	328,510.00	0.14
213	688012	中微公司	700	327,950.00	0.14
214	002438	江苏神通	21,800	325,474.00	0.14
215	002415	海康威视	9,500	324,900.00	0.14
216	600885	宏发股份	9,400	324,206.00	0.13
217	603297	永新光学	2,200	323,290.00	0.13
218	605599	菜百股份	23,500	321,950.00	0.13
219	300445	康斯特	15,400	320,628.00	0.13
220	603308	应流股份	5,300	320,120.00	0.13
221	003019	宸展光电	9,800	318,990.00	0.13

222	601208	东材科技	4,500	318,555.00	0.13
223	603197	保隆科技	11,400	318,516.00	0.13
224	002204	大连重工	60,100	317,328.00	0.13
225	605222	起帆电缆	13,600	317,152.00	0.13
226	603216	梦天家居	15,300	314,721.00	0.13
227	601699	潞安环能	22,000	314,160.00	0.13
228	600693	东百集团	39,900	312,816.00	0.13
229	688200	华峰测控	592	310,859.20	0.13
230	603279	景津装备	25,900	310,800.00	0.13
231	002301	齐心集团	42,900	310,167.00	0.13
232	601226	华电科工	48,600	309,096.00	0.13
233	300348	长亮科技	35,100	308,880.00	0.13
234	688128	中国电研	13,000	308,620.00	0.13
235	002988	豪美新材	13,900	306,634.00	0.13
236	002045	国光电器	39,000	306,150.00	0.13
237	300127	银河磁体	10,900	304,655.00	0.13
238	688678	福立旺	12,600	304,542.00	0.13
239	603239	浙江仙通	20,500	303,605.00	0.13
240	300539	横河精密	14,900	303,513.00	0.13
241	000905	厦门港务	39,000	302,640.00	0.13
242	605056	咸亨国际	18,900	302,400.00	0.13
243	002134	天津普林	9,900	301,158.00	0.13
244	300357	我武生物	12,800	298,496.00	0.12
245	300926	博俊科技	16,800	298,200.00	0.12
246	001314	亿道信息	4,800	296,640.00	0.12
247	600746	江苏索普	56,700	296,541.00	0.12
248	603489	八方股份	10,600	296,376.00	0.12
249	688041	海光信息	800	296,240.00	0.12
250	688800	瑞可达	3,080	295,587.60	0.12
251	605319	无锡振华	13,000	294,970.00	0.12
252	300219	鸿利智汇	28,200	294,126.00	0.12
253	301026	浩通科技	14,440	291,976.80	0.12
254	002545	东方铁塔	18,000	291,960.00	0.12
255	605286	同力天启	11,400	290,586.00	0.12
256	300037	新宙邦	3,100	287,835.00	0.12
257	000938	紫光股份	9,800	282,828.00	0.12
258	603281	江瀚新材	6,900	280,347.00	0.12
259	002983	芯瑞达	10,000	276,800.00	0.12
260	605016	百龙创园	10,700	276,595.00	0.12
261	600558	大西洋	55,000	271,700.00	0.11
262	300590	移为通信	18,900	271,215.00	0.11
263	300408	三环集团	1,600	267,040.00	0.11
264	300790	宇瞳光学	10,220	266,844.20	0.11

265	605100	华丰股份	6,600	266,772.00	0.11
266	300014	亿纬锂能	4,100	266,623.00	0.11
267	605117	德业股份	2,500	265,450.00	0.11
268	002993	奥海科技	3,700	264,957.00	0.11
269	600352	浙江龙盛	21,700	262,787.00	0.11
270	002284	亚太股份	27,600	261,924.00	0.11
271	688230	芯导科技	3,300	260,073.00	0.11
272	688266	泽璟制药	2,200	256,652.00	0.11
273	301398	星源卓镁	7,300	256,303.00	0.11
274	000100	TCL 科技	43,800	254,916.00	0.11
275	600596	新安股份	15,900	253,764.00	0.11
276	688568	中科星图	6,100	252,967.00	0.11
277	600456	宝钛股份	9,200	251,620.00	0.10
278	301333	诺思格	5,000	250,450.00	0.10
279	002189	中光学	11,200	250,432.00	0.10
280	000807	云铝股份	11,200	247,968.00	0.10
281	688008	澜起科技	800	247,920.00	0.10
282	002812	恩捷股份	3,700	247,567.00	0.10
283	688083	中望软件	3,800	246,050.00	0.10
284	688697	纽威数控	18,060	245,435.40	0.10
285	601579	会稽山	16,700	245,323.00	0.10
286	601595	上海电影	14,600	242,360.00	0.10
287	600426	华鲁恒升	10,000	239,200.00	0.10
288	688472	阿特斯	22,100	239,122.00	0.10
289	600549	厦门钨业	2,800	238,560.00	0.10
290	002600	领益智造	13,700	237,558.00	0.10
291	600325	华发股份	99,900	230,769.00	0.10
292	002402	和而泰	8,900	229,887.00	0.10
293	300409	道氏技术	11,400	227,202.00	0.09
294	002609	捷顺科技	29,800	227,076.00	0.09
295	688456	有研粉材	1,600	223,360.00	0.09
296	600482	中国动力	6,800	223,040.00	0.09
297	300976	达瑞电子	2,800	223,020.00	0.09
298	301556	托普云农	3,800	222,148.00	0.09
299	300666	江丰电子	600	221,160.00	0.09
300	603225	新凤鸣	11,200	220,080.00	0.09
301	000902	新洋丰	19,000	219,640.00	0.09
302	601137	博威合金	9,800	218,834.00	0.09
303	002148	北纬科技	37,600	218,456.00	0.09
304	688536	思瑞浦	600	218,454.00	0.09
305	000795	英洛华	25,100	217,115.00	0.09
306	300775	三角防务	9,800	215,992.00	0.09
307	605189	富春染织	17,900	215,695.00	0.09

308	002832	比音勒芬	10,400	214,656.00	0.09
309	000703	恒逸石化	15,700	213,049.00	0.09
310	301371	敷尔佳	8,100	210,600.00	0.09
311	688786	悦安新材	4,560	210,124.80	0.09
312	300476	胜宏科技	600	207,858.00	0.09
313	001378	德冠新材	11,570	207,218.70	0.09
314	002295	精艺股份	24,400	206,912.00	0.09
315	301329	信音电子	8,500	206,465.00	0.09
316	600499	科达制造	14,900	205,620.00	0.09
317	300822	贝仕达克	17,400	203,580.00	0.08
318	600105	永鼎股份	3,000	202,440.00	0.08
319	601038	一拖股份	19,100	202,269.00	0.08
320	603061	金海通	400	200,888.00	0.08
321	300818	耐普矿机	10,500	198,450.00	0.08
322	688331	荣昌生物	1,500	195,390.00	0.08
323	603032	德新科技	7,200	193,680.00	0.08
324	688559	海目星	2,300	193,016.00	0.08
325	688385	复旦微电	2,700	192,483.00	0.08
326	301608	博实结	3,725	187,218.50	0.08
327	688410	山外山	13,000	186,680.00	0.08
328	002859	洁美科技	1,700	186,167.00	0.08
329	300236	上海新阳	1,400	184,100.00	0.08
330	002463	沪电股份	1,200	183,360.00	0.08
331	300438	鹏辉能源	2,200	182,270.00	0.08
332	688087	英科再生	5,400	180,468.00	0.08
333	601138	工业富联	2,500	180,375.00	0.08
334	301200	大族数控	500	180,325.00	0.08
335	603726	朗迪集团	5,200	178,100.00	0.07
336	688531	日联科技	1,000	177,840.00	0.07
337	300390	天华新能	1,900	177,669.00	0.07
338	300980	祥源新材	6,000	176,460.00	0.07
339	600459	贵研铂业	6,100	176,168.00	0.07
340	688387	信科移动	8,800	174,592.00	0.07
341	600980	北矿科技	9,300	174,375.00	0.07
342	600479	千金药业	18,700	173,910.00	0.07
343	300224	正海磁材	13,000	173,290.00	0.07
344	301662	宏工科技	1,700	172,244.00	0.07
345	002850	科达利	900	170,370.00	0.07
346	002460	赣锋锂业	2,600	170,040.00	0.07
347	002115	三维通信	16,500	169,950.00	0.07
348	688356	键凯科技	2,200	169,576.00	0.07
349	002327	富安娜	28,400	168,696.00	0.07
350	688182	灿勤科技	3,900	167,973.00	0.07

351	688307	中润光学	2,100	167,895.00	0.07
352	300493	润欣科技	11,200	166,992.00	0.07
353	002365	永安药业	16,500	166,980.00	0.07
354	688518	联赢激光	5,400	166,860.00	0.07
355	002322	理工能科	17,200	166,840.00	0.07
356	688072	拓荆科技	200	166,400.00	0.07
357	300743	天地数码	11,400	166,326.00	0.07
358	301031	中熔电气	1,392	166,274.40	0.07
359	001389	广合科技	700	166,075.00	0.07
360	600750	华润江中	7,500	165,525.00	0.07
361	301518	长华化学	6,300	165,060.00	0.07
362	002899	英派斯	7,500	163,500.00	0.07
363	300681	英搏尔	5,700	163,134.00	0.07
364	300963	中洲特材	12,100	162,503.00	0.07
365	603118	共进股份	13,400	162,274.00	0.07
366	603259	药明康德	1,300	161,863.00	0.07
367	688543	国科军工	4,100	161,745.00	0.07
368	688700	东威科技	1,800	160,920.00	0.07
369	000737	北方铜业	12,100	159,962.00	0.07
370	688636	智明达	4,400	159,412.00	0.07
371	300124	汇川技术	2,400	159,192.00	0.07
372	603686	福龙马	12,300	158,916.00	0.07
373	002170	芭田股份	14,600	158,556.00	0.07
374	002985	北摩高科	5,700	157,890.00	0.07
375	603276	恒兴新材	10,200	156,162.00	0.06
376	603826	坤彩科技	6,100	155,916.00	0.06
377	301636	泽润新能	3,700	155,807.00	0.06
378	002407	多氟多	3,100	155,713.00	0.06
379	688660	电气风电	18,000	155,160.00	0.06
380	000970	中科三环	10,200	154,938.00	0.06
381	001368	通达创智	7,500	154,275.00	0.06
382	600071	凤凰光学	9,000	154,170.00	0.06
383	000630	铜陵有色	24,200	153,912.00	0.06
384	000758	中色股份	23,400	153,738.00	0.06
385	300602	飞荣达	3,000	153,600.00	0.06
386	000612	焦作万方	14,500	153,555.00	0.06
387	601212	白银有色	30,200	153,416.00	0.06
388	000063	中兴通讯	4,200	151,998.00	0.06
389	300337	银邦股份	13,000	151,580.00	0.06
390	688077	大地熊	5,700	150,993.00	0.06
391	002851	麦格米特	900	150,462.00	0.06
392	301153	中科江南	9,200	149,868.00	0.06
393	600449	宁夏建材	13,400	149,812.00	0.06

394	600177	雅戈尔	19,800	149,094.00	0.06
395	688787	海天瑞声	1,100	147,895.00	0.06
396	688398	赛特新材	5,700	147,687.00	0.06
397	002378	章源钨业	4,400	147,312.00	0.06
398	300697	电工合金	9,700	146,955.00	0.06
399	600219	南山铝业	36,800	146,832.00	0.06
400	688290	景业智能	2,200	145,992.00	0.06
401	002532	天山铝业	13,600	145,928.00	0.06
402	600353	旭光电子	3,200	145,920.00	0.06
403	002595	豪迈科技	3,125	145,625.00	0.06
404	301257	普蕊斯	3,200	145,216.00	0.06
405	300399	天利科技	7,500	143,100.00	0.06
406	688379	华光新材	1,700	142,851.00	0.06
407	600531	豫光金铅	9,600	141,696.00	0.06
408	301279	金道科技	6,520	141,679.60	0.06
409	300884	狄耐克	14,200	140,864.00	0.06
410	600063	皖维高新	18,500	140,600.00	0.06
411	600276	恒瑞医药	2,700	140,508.00	0.06
412	002737	葵花药业	12,500	140,125.00	0.06
413	300984	金沃股份	2,600	139,698.00	0.06
414	688162	巨一科技	5,900	139,476.00	0.06
415	603696	安记食品	11,900	136,850.00	0.06
416	688396	华润微	1,400	136,570.00	0.06
417	688392	骄成超声	600	136,308.00	0.06
418	301487	盟固利	7,100	135,965.00	0.06
419	002088	鲁阳节能	16,900	135,538.00	0.06
420	002233	塔牌集团	19,300	134,521.00	0.06
421	600989	宝丰能源	6,600	134,178.00	0.06
422	001339	智微智能	1,300	132,964.00	0.06
423	600037	歌华有线	21,200	132,924.00	0.06
424	301396	宏景科技	400	132,640.00	0.06
425	300579	数字认证	6,300	130,410.00	0.05
426	301338	凯格精机	800	130,312.00	0.05
427	002161	远望谷	24,200	130,196.00	0.05
428	688088	虹软科技	3,600	127,980.00	0.05
429	688111	金山办公	600	127,830.00	0.05
430	000725	京东方A	14,700	127,596.00	0.05
431	600320	振华重工	30,700	126,791.00	0.05
432	300638	广和通	6,800	125,868.00	0.05
433	603737	三棵树	5,200	125,320.00	0.05
434	301159	三维天地	4,300	125,130.00	0.05
435	688548	广钢气体	2,400	125,040.00	0.05
436	300432	富临精工	6,200	124,558.00	0.05

437	688248	南网科技	1,800	124,524.00	0.05
438	002340	格林美	18,700	123,607.00	0.05
439	603992	松霖科技	3,800	123,120.00	0.05
440	300774	倍杰特	11,400	122,550.00	0.05
441	002722	物产金轮	10,300	121,437.00	0.05
442	688368	晶丰明源	560	121,251.20	0.05
443	300394	天孚通信	400	121,072.00	0.05
444	600838	上海九百	16,800	120,120.00	0.05
445	000426	兴业银锡	3,600	118,656.00	0.05
446	600519	贵州茅台	100	118,549.00	0.05
447	688190	云路股份	1,300	117,923.00	0.05
448	002518	科士达	2,200	117,898.00	0.05
449	300207	欣旺达	6,200	117,738.00	0.05
450	688221	前沿生物	5,200	116,480.00	0.05
451	688195	腾景科技	600	115,548.00	0.05
452	002074	国轩高科	4,200	115,542.00	0.05
453	002978	安宁股份	4,500	115,335.00	0.05
454	301511	德福科技	800	115,080.00	0.05
455	688109	品茗科技	1,500	113,550.00	0.05
456	920077	吉林碳谷	6,400	113,536.00	0.05
457	600206	有研新材	1,700	113,220.00	0.05
458	603893	瑞芯微	600	113,016.00	0.05
459	002369	卓翼科技	20,800	112,944.00	0.05
460	603659	璞泰来	3,900	112,827.00	0.05
461	688380	中微半导	1,700	112,047.00	0.05
462	603680	今创集团	11,400	111,834.00	0.05
463	301297	富乐德	1,800	110,232.00	0.05
464	300109	新开源	6,760	108,498.00	0.05
465	688486	龙迅股份	1,680	106,814.40	0.04
466	301095	广立微	900	106,245.00	0.04
467	688503	聚和材料	800	106,160.00	0.04
468	301592	六九一二	800	105,880.00	0.04
469	688156	路德科技	3,500	105,875.00	0.04
470	688108	赛诺医疗	5,700	105,621.00	0.04
471	000783	长江证券	10,800	105,300.00	0.04
472	300655	晶瑞电材	4,900	104,958.00	0.04
473	301238	瑞泰新材	4,300	104,920.00	0.04
474	002602	世纪华通	7,400	104,340.00	0.04
475	688586	江航装备	8,900	104,041.00	0.04
476	688106	金宏气体	2,500	103,700.00	0.04
477	688449	联芸科技	1,200	103,572.00	0.04
478	002837	英维克	1,300	103,428.00	0.04
479	300604	长川科技	300	102,426.00	0.04

480	688019	安集科技	300	101,838.00	0.04
481	300450	先导智能	2,500	101,800.00	0.04
482	002886	沃特股份	3,600	101,124.00	0.04
483	603456	九洲药业	7,400	101,084.00	0.04
484	301005	超捷股份	900	100,404.00	0.04
485	688048	长光华芯	200	100,400.00	0.04
486	002929	润建股份	1,500	100,320.00	0.04
487	002225	濮耐股份	21,100	99,803.00	0.04
488	688326	经纬恒润	1,400	99,232.00	0.04
489	301187	欧圣电气	6,900	98,739.00	0.04
490	601678	滨化股份	14,900	98,191.00	0.04
491	688300	联瑞新材	400	97,760.00	0.04
492	301548	崇德科技	1,100	97,647.00	0.04
493	603305	旭升集团	8,000	96,960.00	0.04
494	688073	毕得医药	1,800	96,876.00	0.04
495	688202	美迪西	1,200	96,852.00	0.04
496	000810	创维数字	7,300	96,725.00	0.04
497	600619	海立股份	6,100	96,685.00	0.04
498	301280	珠城科技	1,900	96,083.00	0.04
499	603009	北特科技	2,000	95,940.00	0.04
500	002497	雅化集团	4,700	95,739.00	0.04
501	000811	冰轮环境	1,700	95,574.00	0.04
502	300567	精测电子	300	95,280.00	0.04
503	002138	顺络电子	1,300	95,030.00	0.04
504	688779	五矿新能	11,700	94,887.00	0.04
505	600552	凯盛科技	2,900	94,482.00	0.04
506	300373	扬杰科技	600	94,338.00	0.04
507	301263	泰恩康	4,600	94,254.00	0.04
508	002270	华明装备	5,000	94,250.00	0.04
509	600645	中源协和	5,500	94,105.00	0.04
510	603072	天和磁材	2,400	94,080.00	0.04
511	000935	四川双马	3,600	93,924.00	0.04
512	300562	乐心医疗	6,900	93,219.00	0.04
513	601677	明泰铝业	5,600	92,960.00	0.04
514	000012	南玻A	18,000	92,880.00	0.04
515	002239	奥特佳	37,600	92,872.00	0.04
516	688353	华盛锂电	800	92,856.00	0.04
517	300341	麦克奥迪	7,000	92,750.00	0.04
518	000685	中山公用	8,300	92,628.00	0.04
519	603698	航天工程	2,400	92,544.00	0.04
520	002345	潮宏基	10,000	91,700.00	0.04
521	001337	四川黄金	2,500	91,650.00	0.04
522	000422	湖北宜化	6,500	91,325.00	0.04

523	600315	上海家化	5,400	90,828.00	0.04
524	300702	天宇股份	4,500	90,720.00	0.04
525	600323	瀚蓝环境	3,300	90,618.00	0.04
526	300101	振芯科技	5,600	90,552.00	0.04
527	000973	佛塑科技	6,300	90,405.00	0.04
528	300763	锦浪科技	1,000	90,350.00	0.04
529	001287	中电港	2,900	90,335.00	0.04
530	000035	中国天楹	18,700	90,321.00	0.04
531	000589	贵州轮胎	22,200	90,132.00	0.04
532	002409	雅克科技	400	89,800.00	0.04
533	300323	华灿光电	4,400	89,760.00	0.04
534	688103	国力电子	1,200	89,292.00	0.04
535	300380	安硕信息	2,900	89,233.00	0.04
536	605111	新洁能	900	89,226.00	0.04
537	601211	国泰海通	4,900	89,180.00	0.04
538	301175	中科环保	18,000	89,100.00	0.04
539	301045	天禄科技	1,000	89,080.00	0.04
540	688206	概伦电子	2,000	88,740.00	0.04
541	301500	飞南资源	3,400	88,570.00	0.04
542	688097	博众精工	1,400	88,270.00	0.04
543	601096	宏盛华源	20,300	88,102.00	0.04
544	688479	友车科技	2,300	87,331.00	0.04
545	002911	佛燃能源	9,200	87,308.00	0.04
546	300378	鼎捷数智	2,400	86,640.00	0.04
547	601619	嘉泽新能	20,100	86,430.00	0.04
548	688082	盛美上海	200	86,400.00	0.04
549	002351	漫步者	9,500	86,355.00	0.04
550	600116	三峡水利	15,400	86,240.00	0.04
551	688599	天合光能	6,100	86,132.00	0.04
552	603019	中科曙光	800	85,784.00	0.04
553	603501	豪威集团	900	85,365.00	0.04
554	002185	华天科技	3,800	84,778.00	0.04
555	301290	东星医疗	3,100	84,475.00	0.04
556	603885	吉祥航空	8,200	84,378.00	0.04
557	603969	银龙股份	11,600	84,332.00	0.04
558	301069	凯盛新材	4,200	84,168.00	0.04
559	688689	银河微电	1,300	84,136.00	0.03
560	002156	通富微电	1,100	83,457.00	0.03
561	603933	睿能科技	3,700	83,435.00	0.03
562	002606	大连电瓷	6,200	83,142.00	0.03
563	600114	东睦股份	2,200	83,072.00	0.03
564	300509	新美星	9,900	82,962.00	0.03
565	600388	龙净环保	5,700	82,935.00	0.03

566	300693	盛弘股份	1,700	82,875.00	0.03
567	601777	千里科技	10,100	82,416.00	0.03
568	603200	上海洗霸	1,900	82,384.00	0.03
569	300568	星源材质	4,400	82,368.00	0.03
570	688099	晶晨股份	800	82,320.00	0.03
571	301489	思泉新材	500	82,290.00	0.03
572	301600	慧翰股份	900	82,260.00	0.03
573	601000	唐山港	19,700	81,755.00	0.03
574	002015	协鑫能科	5,000	81,600.00	0.03
575	601958	金钼股份	2,900	81,519.00	0.03
576	002821	凯莱英	500	81,000.00	0.03
577	603052	可川科技	1,000	80,990.00	0.03
578	688550	瑞联新材	1,400	80,990.00	0.03
579	603516	淳中科技	600	80,766.00	0.03
580	300184	力源信息	4,600	80,730.00	0.03
581	600292	电投水电	6,700	80,668.00	0.03
582	601500	通用股份	22,100	80,665.00	0.03
583	002335	科华数据	1,900	80,655.00	0.03
584	603026	石大胜华	900	80,433.00	0.03
585	002326	永太科技	3,400	80,410.00	0.03
586	301315	威士顿	2,100	80,178.00	0.03
587	688138	清溢光电	1,700	79,900.00	0.03
588	300747	锐科激光	1,500	79,635.00	0.03
589	688400	凌云光	1,200	79,440.00	0.03
590	002488	金固股份	8,900	79,299.00	0.03
591	300535	达威股份	5,800	79,054.00	0.03
592	603328	依顿电子	6,300	78,939.00	0.03
593	601061	中信金属	7,300	78,621.00	0.03
594	002820	桂发祥	9,300	78,120.00	0.03
595	002815	崇达技术	4,700	77,973.00	0.03
596	688028	沃尔德	500	77,935.00	0.03
597	002228	合兴包装	26,500	77,910.00	0.03
598	002158	汉钟精机	2,100	77,868.00	0.03
599	002154	报喜鸟	21,800	77,608.00	0.03
600	300284	苏交科	15,500	77,500.00	0.03
601	002882	金龙羽	4,100	77,449.00	0.03
602	001311	多利科技	4,800	77,424.00	0.03
603	000565	渝三峡 A	13,600	77,248.00	0.03
604	603172	万丰股份	4,700	77,221.00	0.03
605	688113	联测科技	2,200	77,220.00	0.03
606	301131	聚赛龙	2,400	77,112.00	0.03
607	300610	晨化股份	7,900	77,025.00	0.03
608	000977	浪潮信息	1,100	77,000.00	0.03

609	300940	南极光	5,100	76,908.00	0.03
610	688252	天德钰	3,200	76,800.00	0.03
611	301626	苏州天脉	200	76,792.00	0.03
612	000657	中钨高新	800	76,576.00	0.03
613	603068	博通集成	1,900	76,437.00	0.03
614	600563	法拉电子	400	76,320.00	0.03
615	600257	大湖股份	17,600	76,208.00	0.03
616	301458	钧崴电子	1,300	75,998.00	0.03
617	300620	光库科技	200	75,640.00	0.03
618	300941	创识科技	5,500	75,515.00	0.03
619	300864	南大环境	3,900	74,802.00	0.03
620	688220	翱捷科技	600	74,592.00	0.03
621	688301	奕瑞科技	600	74,400.00	0.03
622	002338	奥普光电	1,300	74,360.00	0.03
623	600251	冠农股份	8,600	74,304.00	0.03
624	603078	江化微	1,500	74,130.00	0.03
625	603160	汇顶科技	1,200	74,052.00	0.03
626	300821	东岳硅材	3,600	74,016.00	0.03
627	600241	时代万恒	11,400	73,986.00	0.03
628	000988	华工科技	400	73,844.00	0.03
629	002960	青鸟智控	8,700	73,689.00	0.03
630	301510	固高科技	2,300	73,439.00	0.03
631	601225	陕西煤业	3,600	73,260.00	0.03
632	600546	山煤国际	6,700	73,231.00	0.03
633	301021	英诺激光	600	73,140.00	0.03
634	002653	海思科	1,100	72,974.00	0.03
635	688010	福光股份	1,500	72,945.00	0.03
636	300199	翰宇药业	3,300	72,864.00	0.03
637	300575	中旗股份	14,800	72,816.00	0.03
638	600522	中天科技	1,200	72,816.00	0.03
639	603218	日月股份	7,100	72,562.00	0.03
640	601163	三角轮胎	5,700	72,333.00	0.03
641	300033	同花顺	300	72,300.00	0.03
642	600201	生物股份	6,200	72,230.00	0.03
643	003031	中瓷电子	400	72,120.00	0.03
644	000688	国城矿业	2,100	71,883.00	0.03
645	603236	移远通信	1,400	71,638.00	0.03
646	300320	海达股份	7,500	71,550.00	0.03
647	600888	新疆众和	4,500	71,505.00	0.03
648	002216	三全食品	6,200	71,486.00	0.03
649	688016	心脉医疗	800	70,912.00	0.03
650	002203	海亮股份	3,100	70,835.00	0.03
651	300917	特发服务	2,900	70,702.00	0.03

652	688777	中控技术	600	70,500.00	0.03
653	600502	安徽建工	16,200	70,470.00	0.03
654	002475	立讯精密	1,000	70,400.00	0.03
655	000778	新兴铸管	18,900	70,119.00	0.03
656	300049	福瑞医科	1,800	69,984.00	0.03
657	002125	湘潭电化	5,100	69,666.00	0.03
658	300756	金马游乐	2,100	69,405.00	0.03
659	300972	万辰集团	400	69,364.00	0.03
660	002202	金风科技	2,900	69,310.00	0.03
661	301363	美好医疗	3,780	69,287.40	0.03
662	688628	优利德	700	69,258.00	0.03
663	688090	瑞松科技	650	69,192.50	0.03
664	300870	欧陆通	200	69,138.00	0.03
665	300428	立中集团	3,800	69,084.00	0.03
666	002498	汉缆股份	10,100	68,882.00	0.03
667	002276	万马股份	6,800	68,748.00	0.03
668	603993	洛阳钼业	3,900	68,445.00	0.03
669	600988	赤峰黄金	2,600	68,432.00	0.03
670	601021	春秋航空	1,500	68,370.00	0.03
671	002266	浙富控股	13,500	68,310.00	0.03
672	688683	莱尔科技	1,800	68,256.00	0.03
673	601899	紫金矿业	2,700	67,878.00	0.03
674	300748	金力永磁	2,200	67,870.00	0.03
675	601168	西部矿业	2,500	67,850.00	0.03
676	300618	寒锐钴业	1,900	67,830.00	0.03
677	300726	宏达电子	800	67,656.00	0.03
678	300628	亿联网络	2,000	67,640.00	0.03
679	600301	华锡有色	1,100	67,452.00	0.03
680	000967	盈峰环境	6,400	67,392.00	0.03
681	688686	奥普特	400	67,356.00	0.03
682	301121	紫建电子	2,100	67,242.00	0.03
683	002716	湖南白银	8,300	67,147.00	0.03
684	301606	绿联科技	1,100	67,122.00	0.03
685	688667	菱电电控	500	66,825.00	0.03
686	000878	云南铜业	4,200	66,696.00	0.03
687	603808	歌力思	8,800	66,616.00	0.03
688	000831	中国稀土	1,200	66,588.00	0.03
689	300098	高新兴	14,500	66,555.00	0.03
690	002392	北京利尔	8,200	66,174.00	0.03
691	002718	友邦吊顶	600	66,150.00	0.03
692	688023	安恒信息	1,800	66,096.00	0.03
693	688218	江苏北人	1,200	65,952.00	0.03
694	300951	博硕科技	1,300	65,650.00	0.03

695	688350	富淼科技	1,900	65,607.00	0.03
696	600392	盛和资源	2,200	65,494.00	0.03
697	601388	怡球资源	23,100	65,373.00	0.03
698	002230	科大讯飞	1,600	65,344.00	0.03
699	603915	国茂股份	4,600	65,274.00	0.03
700	300261	雅本化学	14,600	65,262.00	0.03
701	600489	中金黄金	3,600	64,980.00	0.03
702	300007	汉威科技	1,700	64,940.00	0.03
703	603979	金诚信	1,100	64,933.00	0.03
704	002004	华邦健康	16,500	64,845.00	0.03
705	601231	环旭电子	2,000	64,800.00	0.03
706	002128	电投能源	2,800	64,736.00	0.03
707	002155	湖南黄金	2,700	64,449.00	0.03
708	603327	福蓉科技	7,600	64,448.00	0.03
709	688180	君实生物	1,900	64,258.00	0.03
710	300731	科创新源	1,100	64,196.00	0.03
711	688246	嘉和美康	3,100	63,705.00	0.03
712	600575	淮河能源	19,900	63,481.00	0.03
713	688070	纵横股份	1,700	63,461.00	0.03
714	601126	四方股份	1,000	63,200.00	0.03
715	301016	雷尔伟	4,500	62,865.00	0.03
716	688311	盟升电子	2,400	62,856.00	0.03
717	300077	国民技术	2,000	62,700.00	0.03
718	002192	融捷股份	700	62,580.00	0.03
719	688205	德科立	300	62,457.00	0.03
720	600556	天下秀	14,100	62,322.00	0.03
721	688718	唯赛勃	3,900	62,283.00	0.03
722	002049	紫光国微	700	62,125.00	0.03
723	300757	罗博特科	100	61,900.00	0.03
724	600497	驰宏锌锗	5,100	61,761.00	0.03
725	300296	利亚德	11,000	61,600.00	0.03
726	002937	兴瑞科技	1,400	61,502.00	0.03
727	000969	安泰科技	2,500	61,350.00	0.03
728	300416	苏试试验	3,000	61,140.00	0.03
729	603358	华达科技	1,400	60,900.00	0.03
730	300304	云意电气	3,400	60,690.00	0.03
731	000059	华锦股份	16,000	60,000.00	0.02
732	000830	鲁西化工	5,000	60,000.00	0.02
733	688433	华曙高科	700	59,920.00	0.02
734	600233	圆通速递	3,800	59,850.00	0.02
735	600740	山西焦化	18,700	59,653.00	0.02
736	688577	浙海德曼	1,300	59,579.00	0.02
737	300053	航宇微	3,600	59,220.00	0.02

738	300358	楚天科技	7,400	59,200.00	0.02
739	605133	嵘泰股份	1,500	59,055.00	0.02
740	300672	国科微	200	59,000.00	0.02
741	688580	伟思医疗	1,100	58,597.00	0.02
742	002895	川恒股份	2,000	58,400.00	0.02
743	002617	露笑科技	5,600	57,624.00	0.02
744	300661	圣邦股份	400	57,392.00	0.02
745	003002	壶化股份	3,300	57,387.00	0.02
746	300530	领湃科技	3,400	57,290.00	0.02
747	002283	天润工业	5,900	56,935.00	0.02
748	600361	创新新材	15,700	56,520.00	0.02
749	300751	迈为股份	200	56,492.00	0.02
750	688118	普元信息	2,800	56,336.00	0.02
751	000751	锌业股份	9,200	56,304.00	0.02
752	600362	江西铜业	1,300	56,290.00	0.02
753	300644	南京聚隆	2,400	56,112.00	0.02
754	300548	长芯博创	200	55,600.00	0.02
755	000960	锡业股份	1,300	55,497.00	0.02
756	688313	仕佳光子	300	55,395.00	0.02
757	688679	通源环境	1,300	54,717.00	0.02
758	002317	众生药业	2,200	54,054.00	0.02
759	601609	金田股份	5,000	54,000.00	0.02
760	688386	泛亚微透	600	53,904.00	0.02
761	600673	东阳光	1,600	53,728.00	0.02
762	300045	华力创通	3,100	53,444.00	0.02
763	603059	倍加洁	2,200	53,350.00	0.02
764	300659	中孚信息	5,600	53,200.00	0.02
765	002174	游族网络	4,200	52,962.00	0.02
766	300244	迪安诊断	2,800	52,472.00	0.02
767	603301	振德医疗	600	52,296.00	0.02
768	300836	佰奥智能	700	51,793.00	0.02
769	301047	义翘神州	800	51,648.00	0.02
770	300986	志特新材	3,000	51,450.00	0.02
771	688112	鼎阳科技	700	51,422.00	0.02
772	002756	永兴材料	900	50,976.00	0.02
773	603228	景旺电子	700	50,687.00	0.02
774	688611	杭州柯林	700	50,015.00	0.02
775	605389	长龄液压	520	49,920.00	0.02
776	301381	赛维时代	2,700	49,788.00	0.02
777	002273	水晶光电	1,400	49,672.00	0.02
778	002605	姚记科技	2,700	49,329.00	0.02
779	600460	士兰微	900	49,194.00	0.02
780	000550	江铃汽车	3,000	48,660.00	0.02

781	000408	藏格矿业	700	48,524.00	0.02
782	688797	臻宝科技	103	48,273.01	0.02
783	600995	南网储能	3,900	47,970.00	0.02
784	300685	艾德生物	2,800	47,152.00	0.02
785	301050	雷电微力	1,400	46,816.00	0.02
786	688116	天奈科技	1,200	45,840.00	0.02
787	002353	杰瑞股份	300	45,750.00	0.02
788	600395	盘江股份	9,800	44,688.00	0.02
789	603296	华勤技术	600	44,562.00	0.02
790	603888	新华网	2,600	44,278.00	0.02
791	300633	开立医疗	2,400	44,136.00	0.02
792	688122	西部超导	700	43,967.00	0.02
793	688685	迈信林	800	43,920.00	0.02
794	002443	金洲管道	4,600	43,838.00	0.02
795	301215	中汽股份	8,400	43,596.00	0.02
796	600111	北方稀土	900	43,245.00	0.02
797	000045	深纺织 A	4,100	43,214.00	0.02
798	000629	钒钛股份	12,700	42,418.00	0.02
799	688676	金盘科技	500	42,320.00	0.02
800	300813	泰林生物	2,200	41,998.00	0.02
801	600651	飞乐音响	7,500	41,925.00	0.02
802	688443	智翔金泰	1,800	41,850.00	0.02
803	600510	黑牡丹	5,600	41,776.00	0.02
804	600299	安迪苏	5,300	41,605.00	0.02
805	300442	润泽科技	500	41,535.00	0.02
806	002292	奥飞娱乐	6,300	41,328.00	0.02
807	603298	杭叉集团	1,700	40,562.00	0.02
808	002347	泰尔股份	6,900	40,365.00	0.02
809	300132	青松股份	7,100	40,328.00	0.02
810	301631	壹连科技	560	40,241.60	0.02
811	300457	赢合科技	1,900	40,052.00	0.02
812	600218	全柴动力	5,500	39,710.00	0.02
813	002660	茂硕电源	6,100	39,650.00	0.02
814	603556	海兴电力	1,800	39,600.00	0.02
815	600455	博通股份	1,800	39,528.00	0.02
816	002094	青岛金王	9,000	39,420.00	0.02
817	300387	富邦科技	5,800	39,382.00	0.02
818	300771	智莱科技	3,800	39,216.00	0.02
819	300515	三德科技	3,000	39,150.00	0.02
820	300817	双飞集团	2,500	39,000.00	0.02
821	300030	阳普医疗	6,700	38,927.00	0.02
822	002763	汇洁股份	5,700	38,703.00	0.02
823	603806	福斯特	2,300	38,617.00	0.02

824	003029	吉大正元	2,400	38,448.00	0.02
825	603920	世运电路	800	38,432.00	0.02
826	300738	奥飞数据	1,900	38,418.00	0.02
827	603332	苏州龙杰	3,800	38,418.00	0.02
828	001399	惠科股份	1,382	38,322.86	0.02
829	000338	潍柴动力	1,400	38,150.00	0.02
830	002054	德美化工	5,700	37,905.00	0.02
831	002887	绿茵生态	3,600	37,692.00	0.02
832	600094	大名城	10,800	37,368.00	0.02
833	603103	横店影视	2,600	37,206.00	0.02
834	600577	精达股份	3,800	37,164.00	0.02
835	688698	伟创电气	700	36,715.00	0.02
836	688309	恒誉环保	600	36,528.00	0.02
837	002544	普天科技	2,000	36,440.00	0.02
838	301053	远信工业	980	36,162.00	0.02
839	002135	东南网架	5,300	35,987.00	0.01
840	002397	梦洁股份	9,400	35,908.00	0.01
841	688607	康众医疗	700	35,700.00	0.01
842	002683	广东宏大	1,200	35,148.00	0.01
843	002028	思源电气	200	34,600.00	0.01
844	300696	爱乐达	1,300	33,839.00	0.01
845	688347	华虹宏力	100	33,630.00	0.01
846	920185	贝特瑞	1,300	32,344.00	0.01
847	601615	明阳智能	2,700	31,239.00	0.01
848	600724	宁波富达	5,900	29,913.00	0.01
849	603162	海通发展	2,800	25,116.00	0.01
850	600100	同方股份	3,400	23,290.00	0.01
851	600570	恒生电子	1,000	21,190.00	0.01
852	601360	三六零	2,300	19,987.00	0.01
853	002236	大华股份	1,200	19,788.00	0.01
854	300454	深信服	200	19,240.00	0.01
855	600196	复星医药	800	17,976.00	0.01
856	300759	康龙化成	600	17,358.00	0.01
857	300496	中科创达	200	12,358.00	0.01
858	300866	安克创新	100	10,450.00	0.00
859	688728	格科微	400	8,416.00	0.00
860	301165	锐捷网络	100	8,045.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入	占期初基金资产净值比例（%）
----	------	------	--------	----------------

			金额	
1	603588	高能环境	3,504,625.00	9.90
2	002250	联化科技	2,804,258.00	7.93
3	603876	鼎胜新材	2,723,418.00	7.70
4	002838	道恩股份	2,534,004.17	7.16
5	688127	蓝特光学	2,458,459.66	6.95
6	600595	中孚实业	2,401,403.00	6.79
7	002182	宝武镁业	2,358,047.00	6.66
8	002284	亚太股份	2,261,838.00	6.39
9	688590	新致软件	2,241,138.97	6.33
10	000603	盛达资源	2,202,728.00	6.23
11	000672	上峰材料	2,168,459.20	6.13
12	301031	中熔电气	2,113,378.40	5.97
13	688095	福昕软件	2,111,858.53	5.97
14	688388	嘉元科技	2,101,054.26	5.94
15	605016	百龙创园	2,098,653.00	5.93
16	300201	海伦哲	2,078,257.00	5.87
17	688025	杰普特	2,077,521.58	5.87
18	300740	水羊股份	2,070,278.01	5.85
19	300492	华图山鼎	2,055,123.00	5.81
20	688002	睿创微纳	2,052,222.74	5.80
21	600201	生物股份	2,022,805.00	5.72
22	002922	伊戈尔	2,000,668.00	5.65
23	002925	盈趣科技	1,976,789.00	5.59
24	300861	美畅股份	1,966,694.20	5.56
25	600459	贵研铂业	1,962,773.00	5.55
26	300308	中际旭创	1,929,540.00	5.45
27	603583	捷昌驱动	1,928,924.00	5.45
28	603530	神马电力	1,911,626.00	5.40
29	688049	炬芯科技	1,898,058.40	5.36
30	600710	苏美达	1,894,927.00	5.36
31	688136	科兴制药	1,882,671.53	5.32
32	002956	西麦食品	1,877,739.00	5.31
33	002048	宁波华翔	1,876,547.00	5.30
34	688630	芯碁微装	1,865,688.96	5.27
35	002028	思源电气	1,859,097.00	5.25
36	688059	华锐精密	1,858,608.71	5.25
37	002986	宇新股份	1,834,309.00	5.18
38	000962	东方钨业	1,824,180.00	5.16
39	603969	银龙股份	1,793,130.00	5.07
40	603317	天味食品	1,784,255.00	5.04
41	002833	弘亚数控	1,777,050.20	5.02
42	688155	先惠技术	1,774,727.51	5.02

43	603929	亚翔集成	1,767,877.00	5.00
44	002487	大金重工	1,766,806.00	4.99
45	601126	四方股份	1,742,590.00	4.92
46	603799	华友钴业	1,712,381.40	4.84
47	000810	创维数字	1,710,402.00	4.83
48	000551	创元科技	1,704,688.00	4.82
49	688799	华纳药厂	1,703,255.38	4.81
50	002768	国恩股份	1,700,888.00	4.81
51	300953	震裕科技	1,691,720.00	4.78
52	605599	菜百股份	1,672,357.00	4.73
53	688550	瑞联新材	1,669,266.05	4.72
54	002993	奥海科技	1,668,903.50	4.72
55	600429	三元股份	1,667,703.00	4.71
56	300757	罗博特科	1,640,840.00	4.64
57	605196	华通线缆	1,631,867.00	4.61
58	600366	宁波韵升	1,624,085.00	4.59
59	688690	纳微科技	1,604,552.25	4.53
60	600105	永鼎股份	1,603,315.00	4.53
61	601069	西部黄金	1,595,934.00	4.51
62	688233	神工股份	1,593,038.74	4.50
63	688510	航亚科技	1,590,624.63	4.50
64	688239	航宇科技	1,587,376.56	4.49
65	688800	瑞可达	1,580,686.95	4.47
66	300691	联合光电	1,577,940.00	4.46
67	600740	山西焦化	1,565,718.00	4.43
68	300036	超图软件	1,550,662.00	4.38
69	000049	德赛电池	1,550,477.00	4.38
70	688133	泰坦科技	1,546,282.11	4.37
71	603986	兆易创新	1,541,396.00	4.36
72	603992	松霖科技	1,528,280.00	4.32
73	603901	永创智能	1,527,492.00	4.32
74	601137	博威合金	1,523,318.00	4.31
75	688519	南亚新材	1,522,018.95	4.30
76	688083	中望软件	1,519,760.68	4.30
77	603085	天成自控	1,498,747.00	4.24
78	600183	生益科技	1,498,210.00	4.23
79	300684	中石科技	1,485,123.00	4.20
80	688778	厦钨新能	1,483,316.27	4.19
81	603067	振华股份	1,480,333.00	4.18
82	688513	苑东生物	1,479,696.33	4.18
83	601899	紫金矿业	1,478,630.00	4.18
84	002859	洁美科技	1,477,442.00	4.18
85	002979	雷赛智能	1,477,218.00	4.17

86	300206	理邦仪器	1,465,195.00	4.14
87	603256	宏和科技	1,463,805.00	4.14
88	688208	道通科技	1,458,515.61	4.12
89	688383	新益昌	1,457,851.54	4.12
90	300257	开山股份	1,453,252.00	4.11
91	002649	博彦科技	1,451,892.00	4.10
92	601233	桐昆股份	1,448,090.00	4.09
93	603308	应流股份	1,439,500.00	4.07
94	600230	沧州大化	1,438,682.60	4.07
95	002293	罗莱生活	1,438,074.00	4.06
96	603663	三祥新材	1,437,349.00	4.06
97	605319	无锡振华	1,433,959.00	4.05
98	002158	汉钟精机	1,426,541.80	4.03
99	000589	贵州轮胎	1,418,410.00	4.01
100	600150	中国船舶	1,414,680.74	4.00
101	002396	星网锐捷	1,414,437.60	4.00
102	300475	香农芯创	1,413,172.80	3.99
103	688087	英科再生	1,411,727.32	3.99
104	002518	科士达	1,410,196.00	3.99
105	002079	苏州固锔	1,407,002.00	3.98
106	002511	中顺洁柔	1,402,240.00	3.96
107	002531	天顺风能	1,392,512.00	3.94
108	000534	万泽股份	1,383,716.00	3.91
109	002928	华夏航空	1,372,880.00	3.88
110	688390	固德威	1,367,659.28	3.87
111	002216	三全食品	1,361,073.00	3.85
112	600206	有研新材	1,360,872.00	3.85
113	603993	洛阳钼业	1,360,494.00	3.85
114	600961	株冶集团	1,356,707.00	3.83
115	688222	成都先导	1,356,636.89	3.83
116	603297	永新光学	1,354,632.00	3.83
117	002043	兔宝宝	1,354,243.00	3.83
118	603823	百合花	1,350,277.00	3.82
119	002947	恒铭达	1,344,132.00	3.80
120	300389	艾比森	1,342,565.00	3.79
121	300031	宝通科技	1,339,592.00	3.79
122	688408	中信博	1,337,378.08	3.78
123	300320	海达股份	1,332,694.00	3.77
124	002246	北化股份	1,331,996.00	3.76
125	600971	恒源煤电	1,331,821.00	3.76
126	600251	冠农股份	1,331,788.00	3.76
127	601579	会稽山	1,321,910.00	3.74
128	605376	博迁新材	1,320,036.00	3.73

129	002810	山东赫达	1,319,850.00	3.73
130	002545	东方铁塔	1,319,365.00	3.73
131	002392	北京利尔	1,317,902.00	3.72
132	002544	普天科技	1,311,938.69	3.71
133	603031	安孚科技	1,310,542.00	3.70
134	300005	探路者	1,299,039.00	3.67
135	301087	可孚医疗	1,297,313.00	3.67
136	600929	雪天盐业	1,296,235.00	3.66
137	688636	智明达	1,296,099.34	3.66
138	000408	藏格矿业	1,290,089.00	3.65
139	002230	科大讯飞	1,288,985.00	3.64
140	688097	博众精工	1,281,542.25	3.62
141	300590	移为通信	1,272,514.00	3.60
142	603127	昭衍新药	1,266,657.00	3.58
143	300224	正海磁材	1,258,691.00	3.56
144	603611	诺力股份	1,255,879.00	3.55
145	688668	鼎通科技	1,250,629.07	3.53
146	300857	协创数据	1,249,719.00	3.53
147	002414	高德红外	1,244,468.00	3.52
148	002946	新乳业	1,242,828.00	3.51
149	603185	弘元绿能	1,240,935.00	3.51
150	300976	达瑞电子	1,240,765.00	3.51
151	000682	东方电子	1,237,042.00	3.50
152	600596	新安股份	1,234,028.00	3.49
153	600869	远东股份	1,231,309.00	3.48
154	688012	中微公司	1,230,023.70	3.48
155	002985	北摩高科	1,225,622.00	3.46
156	688258	卓易信息	1,225,511.04	3.46
157	603950	长源东谷	1,224,923.00	3.46
158	600346	恒力石化	1,222,437.00	3.45
159	600189	泉阳泉	1,214,659.00	3.43
160	605128	上海沿浦	1,212,055.00	3.43
161	603708	家家悦	1,201,941.00	3.40
162	002996	顺博合金	1,200,925.00	3.39
163	300073	当升科技	1,198,277.00	3.39
164	688182	灿勤科技	1,190,642.41	3.37
165	600817	宇通重工	1,187,643.00	3.36
166	002886	沃特股份	1,183,257.00	3.34
167	688013	天臣医疗	1,182,918.46	3.34
168	002029	七匹狼	1,181,686.00	3.34
169	000035	中国天楹	1,179,605.00	3.33
170	002283	天润工业	1,178,903.00	3.33
171	600882	妙可蓝多	1,172,377.00	3.31

172	300286	安科瑞	1,168,779.00	3.30
173	000922	佳电股份	1,164,526.00	3.29
174	601339	百隆东方	1,163,332.00	3.29
175	002829	星网宇达	1,162,295.00	3.28
176	688596	正帆科技	1,161,045.29	3.28
177	603612	索通发展	1,155,757.00	3.27
178	002497	雅化集团	1,149,768.00	3.25
179	300919	中伟新材	1,147,230.00	3.24
180	300727	润禾材料	1,142,275.00	3.23
181	002204	大连重工	1,141,642.00	3.23
182	600577	精达股份	1,141,469.00	3.23
183	688625	呈和科技	1,140,838.58	3.22
184	002440	闰土股份	1,138,844.00	3.22
185	002154	报喜鸟	1,136,970.00	3.21
186	603507	振江股份	1,136,394.00	3.21
187	688767	博拓生物	1,134,789.61	3.21
188	688200	华峰测控	1,133,131.63	3.20
189	603306	华懋科技	1,133,080.00	3.20
190	688068	热景生物	1,129,203.39	3.19
191	600750	华润江中	1,127,206.00	3.19
192	605389	长龄液压	1,120,810.00	3.17
193	603995	甬金股份	1,114,373.00	3.15
194	002930	宏川智慧	1,112,364.00	3.14
195	003010	若羽臣	1,111,401.00	3.14
196	603638	艾迪精密	1,109,968.00	3.14
197	603889	新澳股份	1,108,711.60	3.13
198	002536	飞龙股份	1,102,953.00	3.12
199	002111	威海广泰	1,102,352.00	3.12
200	002961	瑞达期货	1,101,060.00	3.11
201	300363	博腾股份	1,097,453.00	3.10
202	002301	齐心集团	1,084,847.00	3.07
203	002120	韵达股份	1,083,617.00	3.06
204	002988	豪美新材	1,079,787.00	3.05
205	605123	派克新材	1,077,178.00	3.04
206	601699	潞安环能	1,076,358.00	3.04
207	300327	中颖电子	1,075,250.00	3.04
208	300697	电工合金	1,071,923.00	3.03
209	603386	骏亚科技	1,071,157.00	3.03
210	600129	太极集团	1,064,533.00	3.01
211	002380	科远智慧	1,060,438.00	3.00
212	603713	密尔克卫	1,055,133.00	2.98
213	688766	普冉股份	1,052,962.70	2.98
214	002780	三夫户外	1,052,231.00	2.97

215	002478	常宝股份	1,050,608.00	2.97
216	688498	源杰科技	1,049,414.61	2.97
217	603516	淳中科技	1,044,282.00	2.95
218	002488	金固股份	1,044,121.00	2.95
219	002824	和胜股份	1,041,413.00	2.94
220	600603	广汇物流	1,035,370.00	2.93
221	000506	招金黄金	1,034,426.00	2.92
222	002222	福晶科技	1,033,319.00	2.92
223	688776	国光电气	1,023,143.08	2.89
224	688733	壹石通	1,016,598.92	2.87
225	601020	华钰矿业	1,012,814.00	2.86
226	301221	光庭信息	1,007,750.00	2.85
227	605060	联德股份	1,004,181.00	2.84
228	688697	纽威数控	1,004,140.86	2.84
229	002587	奥拓电子	1,002,534.00	2.83
230	600320	振华重工	999,473.00	2.82
231	688226	威腾电气	999,285.19	2.82
232	688186	广大特材	995,088.42	2.81
233	300408	三环集团	994,035.00	2.81
234	300793	佳禾智能	992,752.00	2.81
235	300450	先导智能	990,643.00	2.80
236	002913	奥士康	990,512.00	2.80
237	300498	温氏股份	987,037.00	2.79
238	300219	鸿利智汇	985,816.00	2.79
239	002782	可立克	983,181.00	2.78
240	688378	奥来德	983,059.14	2.78
241	002034	旺能环境	980,159.00	2.77
242	002046	国机精工	978,138.00	2.76
243	605056	咸亨国际	976,584.00	2.76
244	002916	深南电路	973,464.00	2.75
245	300811	铂科新材	973,168.20	2.75
246	300842	帝科股份	969,421.00	2.74
247	601369	陕鼓动力	964,935.00	2.73
248	600746	江苏索普	963,299.00	2.72
249	002983	芯瑞达	963,258.00	2.72
250	000555	神州信息	963,151.00	2.72
251	603890	春秋电子	962,759.00	2.72
252	300292	吴通控股	957,081.00	2.70
253	600686	金龙汽车	954,502.00	2.70
254	300399	天利科技	954,417.00	2.70
255	000811	冰轮环境	952,859.00	2.69
256	600399	抚顺特钢	951,911.00	2.69
257	002458	益生股份	943,073.00	2.67

258	688246	嘉和美康	941,336.93	2.66
259	603380	易德龙	939,904.00	2.66
260	002132	恒星科技	937,357.00	2.65
261	300768	迪普科技	935,426.00	2.64
262	300566	激智科技	930,334.18	2.63
263	002876	三利谱	928,415.00	2.62
264	603279	景津装备	926,931.00	2.62
265	000975	山金国际	922,621.00	2.61
266	002140	东华科技	921,396.00	2.60
267	601038	一拖股份	920,956.00	2.60
268	688686	奥普特	920,539.53	2.60
269	300054	鼎龙股份	920,380.00	2.60
270	300815	玉禾田	919,722.00	2.60
271	605168	三人行	917,735.00	2.59
272	688112	鼎阳科技	916,148.23	2.59
273	600507	方大特钢	915,568.00	2.59
274	688575	亚辉龙	915,345.29	2.59
275	001288	运机集团	912,070.00	2.58
276	002845	同兴达	911,601.00	2.58
277	605277	新亚电子	910,447.00	2.57
278	002443	金洲管道	907,082.00	2.56
279	002384	东山精密	906,259.00	2.56
280	300213	佳讯飞鸿	903,655.00	2.55
281	688023	安恒信息	903,112.85	2.55
282	688789	宏华数科	899,658.83	2.54
283	301217	铜冠铜箔	898,192.00	2.54
284	688678	福立旺	897,172.55	2.54
285	301377	鼎泰高科	896,148.00	2.53
286	603931	格林达	893,761.00	2.53
287	603301	振德医疗	891,009.00	2.52
288	300532	今天国际	889,736.00	2.51
289	603590	康辰药业	886,605.00	2.51
290	002534	西子洁能	881,546.00	2.49
291	300428	立中集团	879,478.00	2.49
292	603680	今创集团	877,090.00	2.48
293	688085	三友医疗	870,618.91	2.46
294	300850	新强联	864,427.00	2.44
295	603187	海容冷链	864,162.00	2.44
296	002823	凯中精密	864,043.00	2.44
297	002918	蒙娜丽莎	862,584.00	2.44
298	600331	宏达股份	860,513.00	2.43
299	002558	巨人网络	858,915.00	2.43
300	300607	拓斯达	856,890.00	2.42

301	600461	洪城环境	856,478.00	2.42
302	002935	天奥电子	852,350.00	2.41
303	300681	英搏尔	851,106.00	2.41
304	688685	迈信林	848,380.26	2.40
305	600826	兰生股份	846,492.00	2.39
306	002438	江苏神通	846,281.00	2.39
307	688001	华兴源创	844,946.39	2.39
308	688639	华恒生物	843,556.66	2.38
309	300378	鼎捷数智	842,046.00	2.38
310	688698	伟创电气	841,903.67	2.38
311	301026	浩通科技	841,778.40	2.38
312	300806	斯迪克	841,554.00	2.38
313	300244	迪安诊断	840,194.00	2.37
314	688621	阳光诺和	840,137.18	2.37
315	300887	谱尼测试	838,370.00	2.37
316	002709	天赐材料	837,126.00	2.37
317	002225	濮耐股份	833,265.00	2.36
318	002911	佛燃能源	833,143.00	2.35
319	002559	亚威股份	831,145.00	2.35
320	600879	航天电子	830,250.00	2.35
321	300516	久之洋	825,031.40	2.33
322	002460	赣锋锂业	820,781.00	2.32
323	300814	中富电路	818,703.00	2.31
324	300435	中泰股份	818,635.00	2.31
325	002466	天齐锂业	815,793.00	2.31
326	601101	昊华能源	814,304.00	2.30
327	300592	华凯易佰	813,086.00	2.30
328	605289	罗曼股份	812,390.40	2.30
329	300174	元力股份	810,063.00	2.29
330	601888	中国中免	808,892.00	2.29
331	301511	德福科技	806,889.00	2.28
332	002258	利尔化学	806,627.00	2.28
333	002662	峰璟股份	805,860.00	2.28
334	300481	濮阳惠成	804,991.00	2.28
335	605133	嵘泰股份	803,361.00	2.27
336	605118	力鼎光电	803,357.00	2.27
337	002912	中新赛克	800,477.00	2.26
338	603115	海星股份	799,516.00	2.26
339	688516	奥特维	798,746.14	2.26
340	600458	时代新材	796,591.60	2.25
341	600894	广日股份	791,754.00	2.24
342	688003	天准科技	787,489.48	2.23
343	300465	高伟达	786,298.00	2.22

344	688319	欧林生物	786,263.44	2.22
345	000801	四川九洲	785,845.00	2.22
346	002324	普利特	785,709.00	2.22
347	300638	广和通	784,212.00	2.22
348	300687	赛意信息	783,448.61	2.21
349	002134	天津普林	783,202.00	2.21
350	601226	华电科工	779,662.00	2.20
351	688202	美迪西	774,720.20	2.19
352	301606	绿联科技	770,424.00	2.18
353	688308	欧科亿	769,981.53	2.18
354	002290	禾盛新材	768,929.00	2.17
355	600116	三峡水利	767,820.00	2.17
356	002454	松芝股份	765,355.00	2.16
357	688179	阿拉丁	764,185.87	2.16
358	600409	三友化工	762,107.00	2.15
359	603259	药明康德	760,575.00	2.15
360	000028	国药一致	756,038.00	2.14
361	688029	南微医学	752,906.02	2.13
362	002008	大族激光	752,547.00	2.13
363	300818	耐普矿机	752,047.70	2.13
364	002791	坚朗五金	743,952.00	2.10
365	603100	川仪股份	742,386.00	2.10
366	603009	北特科技	741,462.00	2.10
367	000600	建投能源	741,288.00	2.10
368	300926	博俊科技	739,732.00	2.09
369	002237	恒邦股份	738,818.00	2.09
370	688196	卓越新能	737,249.71	2.08
371	301358	湖南裕能	737,094.00	2.08
372	688559	海目星	735,722.42	2.08
373	601225	陕西煤业	734,953.00	2.08
374	300183	东软载波	733,081.00	2.07
375	688010	福光股份	731,215.27	2.07
376	300134	大富科技	729,002.00	2.06
377	688626	翔宇医疗	722,231.00	2.04
378	300662	科锐国际	720,785.00	2.04
379	000923	河钢资源	720,263.00	2.04
380	000685	中山公用	719,815.00	2.03
381	605020	永和股份	718,669.00	2.03
382	688518	联赢激光	716,233.91	2.02
383	600877	电科芯片	715,629.00	2.02
384	600255	鑫科材料	713,742.00	2.02
385	688128	中国电研	713,052.15	2.02
386	603579	荣泰健康	709,460.00	2.01

387	600510	黑牡丹	709,232.00	2.00
-----	--------	-----	------------	------

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出 金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	603256	宏和科技	2,679,710.00	7.57
2	603588	高能环境	2,678,615.00	7.57
3	301031	中熔电气	2,239,949.00	6.33
4	603929	亚翔集成	2,164,956.00	6.12
5	688590	新致软件	2,157,528.19	6.10
6	600459	贵研铂业	2,131,345.00	6.02
7	688233	神工股份	2,010,364.22	5.68
8	000672	上峰材料	2,006,655.00	5.67
9	688127	蓝特光学	1,958,629.77	5.54
10	605016	百龙创园	1,944,183.00	5.49
11	300740	水羊股份	1,916,228.00	5.42
12	002284	亚太股份	1,910,311.00	5.40
13	600201	生物股份	1,895,933.00	5.36
14	002048	宁波华翔	1,862,956.00	5.27
15	002993	奥海科技	1,831,174.00	5.18
16	002028	思源电气	1,807,225.00	5.11
17	601126	四方股份	1,783,235.00	5.04
18	688799	华纳药厂	1,756,280.47	4.96
19	688059	华锐精密	1,756,009.04	4.96
20	300201	海伦哲	1,721,489.00	4.87
21	688800	瑞可达	1,692,355.40	4.78
22	688630	芯碁微装	1,673,186.81	4.73
23	002250	联化科技	1,661,011.00	4.69
24	603876	鼎胜新材	1,647,159.00	4.66
25	600183	生益科技	1,646,048.00	4.65
26	688550	瑞联新材	1,643,546.89	4.65
27	605376	博迁新材	1,641,811.00	4.64
28	603969	银龙股份	1,637,760.00	4.63
29	300691	联合光电	1,633,640.00	4.62
30	000810	创维数字	1,622,416.00	4.59
31	603823	百合花	1,599,843.00	4.52
32	600105	永鼎股份	1,598,883.00	4.52
33	688200	华峰测控	1,596,229.41	4.51
34	300757	罗博特科	1,574,164.32	4.45
35	688239	航宇科技	1,562,324.85	4.42
36	002158	汉钟精机	1,531,009.20	4.33

37	002838	道恩股份	1, 522, 943. 00	4. 30
38	300206	理邦仪器	1, 502, 959. 00	4. 25
39	688388	嘉元科技	1, 484, 577. 44	4. 20
40	688133	泰坦科技	1, 464, 641. 33	4. 14
41	002859	洁美科技	1, 461, 448. 00	4. 13
42	002956	西麦食品	1, 453, 007. 00	4. 11
43	002925	盈趣科技	1, 450, 900. 00	4. 10
44	000811	冰轮环境	1, 446, 693. 00	4. 09
45	603085	天成自控	1, 443, 422. 00	4. 08
46	002922	伊戈尔	1, 432, 914. 00	4. 05
47	300031	宝通科技	1, 426, 572. 00	4. 03
48	002531	天顺风能	1, 423, 224. 00	4. 02
49	603992	松霖科技	1, 405, 542. 00	3. 97
50	002293	罗莱生活	1, 398, 832. 00	3. 95
51	002518	科士达	1, 398, 634. 00	3. 95
52	605389	长龄液压	1, 395, 970. 00	3. 95
53	688513	苑东生物	1, 382, 146. 48	3. 91
54	600206	有研新材	1, 376, 371. 00	3. 89
55	600971	恒源煤电	1, 370, 923. 00	3. 87
56	600740	山西焦化	1, 363, 991. 00	3. 85
57	601137	博威合金	1, 360, 409. 26	3. 84
58	601899	紫金矿业	1, 360, 338. 00	3. 84
59	600595	中孚实业	1, 359, 232. 00	3. 84
60	300857	协创数据	1, 357, 264. 20	3. 84
61	603993	洛阳钼业	1, 355, 906. 00	3. 83
62	688083	中望软件	1, 354, 117. 71	3. 83
63	688208	道通科技	1, 349, 637. 73	3. 81
64	688625	呈和科技	1, 341, 670. 99	3. 79
65	600929	雪天盐业	1, 341, 091. 00	3. 79
66	688222	成都先导	1, 334, 719. 16	3. 77
67	300976	达瑞电子	1, 327, 236. 20	3. 75
68	000408	藏格矿业	1, 322, 683. 00	3. 74
69	688097	博众精工	1, 320, 226. 45	3. 73
70	600366	宁波韵升	1, 314, 958. 00	3. 72
71	300286	安科瑞	1, 314, 131. 00	3. 71
72	000589	贵州轮胎	1, 312, 270. 00	3. 71
73	002996	顺博合金	1, 304, 321. 00	3. 69
74	603611	诺力股份	1, 298, 695. 00	3. 67
75	688049	炬芯科技	1, 295, 976. 86	3. 66
76	600710	苏美达	1, 284, 527. 00	3. 63
77	688596	正帆科技	1, 283, 284. 63	3. 63
78	603583	捷昌驱动	1, 278, 008. 00	3. 61
79	300005	探路者	1, 261, 106. 00	3. 56

80	002768	国恩股份	1,257,359.00	3.55
81	000682	东方电子	1,256,483.00	3.55
82	000922	佳电股份	1,255,670.80	3.55
83	688136	科兴制药	1,251,481.13	3.54
84	605599	菜百股份	1,246,006.00	3.52
85	300320	海达股份	1,244,854.00	3.52
86	002414	高德红外	1,244,787.00	3.52
87	002216	三全食品	1,242,981.70	3.51
88	002440	闰土股份	1,235,548.00	3.49
89	002824	和胜股份	1,233,835.00	3.49
90	002536	飞龙股份	1,226,857.00	3.47
91	603986	兆易创新	1,226,665.00	3.47
92	688087	英科再生	1,212,302.62	3.43
93	002544	普天科技	1,212,007.24	3.43
94	300566	激智科技	1,211,404.86	3.42
95	002380	科远智慧	1,209,612.00	3.42
96	002230	科大讯飞	1,199,743.00	3.39
97	002392	北京利尔	1,199,166.00	3.39
98	301511	德福科技	1,198,882.00	3.39
99	600251	冠农股份	1,198,281.00	3.39
100	605128	上海沿浦	1,183,766.04	3.35
101	300727	润禾材料	1,180,420.96	3.34
102	002182	宝武镁业	1,179,524.00	3.33
103	002946	新乳业	1,175,763.58	3.32
104	603185	弘元绿能	1,168,598.00	3.30
105	002487	大金重工	1,162,508.00	3.29
106	000962	东方钨业	1,158,903.00	3.28
107	002079	苏州固锟	1,158,177.00	3.27
108	002782	可立克	1,157,290.00	3.27
109	002829	星网宇达	1,157,150.00	3.27
110	002046	国机精工	1,154,675.00	3.26
111	300492	华图山鼎	1,153,089.00	3.26
112	688766	普冉股份	1,145,567.25	3.24
113	600817	宇通重工	1,127,262.00	3.19
114	688690	纳微科技	1,123,305.51	3.17
115	603708	家家悦	1,122,417.00	3.17
116	603386	骏亚科技	1,120,850.00	3.17
117	603663	三祥新材	1,119,401.00	3.16
118	002886	沃特股份	1,111,003.00	3.14
119	603308	应流股份	1,110,518.00	3.14
120	688068	热景生物	1,103,933.52	3.12
121	300224	正海磁材	1,101,421.00	3.11
122	002833	弘亚数控	1,101,275.00	3.11

123	688012	中微公司	1,099,386.70	3.11
124	603890	春秋电子	1,098,835.00	3.11
125	688182	灿勤科技	1,095,593.46	3.10
126	688733	壹石通	1,094,855.25	3.09
127	605319	无锡振华	1,094,562.00	3.09
128	688025	杰普特	1,092,304.66	3.09
129	002132	恒星科技	1,090,713.00	3.08
130	002511	中顺洁柔	1,089,307.00	3.08
131	603297	永新光学	1,086,957.00	3.07
132	603995	甬金股份	1,084,787.00	3.07
133	002587	奥拓电子	1,080,828.00	3.05
134	601579	会稽山	1,070,603.00	3.03
135	603067	振华股份	1,070,171.00	3.02
136	300292	吴通控股	1,065,474.00	3.01
137	002985	北摩高科	1,057,475.00	2.99
138	002961	瑞达期货	1,056,861.00	2.99
139	002283	天润工业	1,056,456.00	2.99
140	002222	福晶科技	1,054,774.00	2.98
141	688378	奥来德	1,053,502.72	2.98
142	300590	移为通信	1,052,665.00	2.98
143	603889	新澳股份	1,050,969.40	2.97
144	688636	智明达	1,048,148.49	2.96
145	603799	华友钴业	1,043,110.00	2.95
146	605123	派克新材	1,036,390.00	2.93
147	601369	陕鼓动力	1,035,632.00	2.93
148	600507	方大特钢	1,033,373.00	2.92
149	002043	兔宝宝	1,029,620.00	2.91
150	688013	天臣医疗	1,025,136.09	2.90
151	600596	新安股份	1,018,536.14	2.88
152	002258	利尔化学	1,016,150.00	2.87
153	000035	中国天楹	1,015,262.00	2.87
154	300498	温氏股份	1,012,640.00	2.86
155	600869	远东股份	1,011,844.71	2.86
156	300684	中石科技	1,009,498.00	2.85
157	688003	天准科技	999,070.97	2.82
158	002154	报喜鸟	988,892.00	2.79
159	002111	威海广泰	987,123.00	2.79
160	300861	美畅股份	981,209.00	2.77
161	600577	精达股份	965,271.00	2.73
162	688778	厦钨新能	964,352.55	2.73
163	688383	新益昌	963,777.28	2.72
164	002497	雅化集团	961,113.00	2.72
165	688112	鼎阳科技	959,527.96	2.71

166	000506	招金黄金	958,880.00	2.71
167	688095	福昕软件	957,421.88	2.71
168	688510	航亚科技	955,097.48	2.70
169	300953	震裕科技	951,523.00	2.69
170	301087	可孚医疗	948,158.00	2.68
171	002845	同兴达	941,384.00	2.66
172	603901	永创智能	938,730.00	2.65
173	002458	益生股份	938,665.40	2.65
174	001288	运机集团	933,309.00	2.64
175	300806	斯迪克	932,253.00	2.63
176	000600	建投能源	931,221.00	2.63
177	603516	淳中科技	929,766.00	2.63
178	002034	旺能环境	929,708.00	2.63
179	002396	星网锐捷	928,424.70	2.62
180	002918	蒙娜丽莎	924,614.00	2.61
181	688686	奥普特	924,111.48	2.61
182	300697	电工合金	921,897.00	2.61
183	002545	东方铁塔	916,568.00	2.59
184	600726	华电能源	914,056.00	2.58
185	603950	长源东谷	913,394.00	2.58
186	600750	华润江中	910,420.00	2.57
187	000555	神州信息	909,419.00	2.57
188	300516	久之洋	908,187.00	2.57
189	002823	凯中精密	906,636.00	2.56
190	688246	嘉和美康	902,221.13	2.55
191	605277	新亚电子	897,688.00	2.54
192	002979	雷赛智能	895,104.00	2.53
193	301221	光庭信息	890,523.80	2.52
194	603590	康辰药业	887,277.00	2.51
195	688155	先惠技术	887,155.83	2.51
196	300219	鸿利智汇	885,726.00	2.50
197	002559	亚威股份	884,687.00	2.50
198	300768	迪普科技	884,430.00	2.50
199	300408	三环集团	883,975.00	2.50
200	300592	华凯易佰	883,210.00	2.50
201	601101	昊华能源	883,065.00	2.50
202	002488	金固股份	861,722.00	2.44
203	300815	玉禾田	861,215.00	2.43
204	688698	伟创电气	855,305.03	2.42
205	688685	迈信林	854,686.97	2.42
206	300257	开山股份	853,667.00	2.41
207	300532	今天国际	853,107.00	2.41
208	603530	神马电力	851,086.00	2.41

209	002140	东华科技	850,738.00	2.40
210	300450	先导智能	850,404.00	2.40
211	300174	元力股份	847,387.00	2.39
212	600461	洪城环境	846,649.00	2.39
213	605020	永和股份	845,413.48	2.39
214	002916	深南电路	843,604.00	2.38
215	002441	众业达	836,553.00	2.36
216	600320	振华重工	829,330.00	2.34
217	000551	创元科技	828,208.00	2.34
218	603301	振德医疗	822,195.00	2.32
219	300428	立中集团	820,089.00	2.32
220	300465	高伟达	816,525.00	2.31
221	600331	宏达股份	814,746.00	2.30
222	002986	宇新股份	812,907.00	2.30
223	600429	三元股份	811,353.00	2.29
224	300213	佳讯飞鸿	810,861.00	2.29
225	688023	安恒信息	810,087.39	2.29
226	603127	昭衍新药	809,628.00	2.29
227	603187	海容冷链	806,289.00	2.28
228	300435	中泰股份	803,775.00	2.27
229	000049	德赛电池	803,396.00	2.27
230	600882	妙可蓝多	803,019.00	2.27
231	601069	西部黄金	802,726.00	2.27
232	300389	艾比森	797,943.00	2.26
233	688319	欧林生物	797,625.74	2.25
234	688508	芯朋微	796,305.84	2.25
235	000534	万泽股份	794,147.00	2.24
236	002443	金洲管道	791,402.00	2.24
237	600255	鑫科材料	791,344.00	2.24
238	002246	北化股份	788,274.00	2.23
239	300481	濮阳惠成	788,050.00	2.23
240	688202	美迪西	784,638.73	2.22
241	600458	时代新材	782,054.00	2.21
242	300887	谱尼测试	769,818.00	2.18
243	600888	新疆众和	769,374.00	2.17
244	600879	航天电子	764,936.00	2.16
245	000923	河钢资源	761,851.00	2.15
246	688258	卓易信息	761,812.28	2.15
247	003010	若羽臣	758,755.20	2.14
248	688029	南微医学	758,405.18	2.14
249	601699	潞安环能	758,147.00	2.14
250	002930	宏川智慧	756,062.00	2.14
251	002662	峰璟股份	754,019.00	2.13

252	688697	纽威数控	748,872.63	2.12
253	300687	赛意信息	746,809.00	2.11
254	002029	七匹狼	742,655.00	2.10
255	688639	华恒生物	741,839.29	2.10
256	603100	川仪股份	738,555.00	2.09
257	688516	奥特维	738,225.04	2.09
258	301606	绿联科技	737,470.00	2.08
259	300378	鼎捷数智	736,523.00	2.08
260	002454	松芝股份	732,956.40	2.07
261	002204	大连重工	732,431.00	2.07
262	301377	鼎泰高科	731,715.00	2.07
263	688085	三友医疗	730,708.05	2.07
264	000028	国药一致	729,986.00	2.06
265	002876	三利谱	727,995.00	2.06
266	300244	迪安诊断	727,955.00	2.06
267	603031	安孚科技	727,630.00	2.06
268	605133	嵘泰股份	726,433.00	2.05
269	601888	中国中免	718,337.00	2.03
270	300327	中颖电子	714,829.00	2.02
271	002803	吉宏股份	712,263.00	2.01
272	600894	广日股份	711,841.00	2.01
273	000949	新乡化纤	711,823.00	2.01
274	300399	天利科技	711,427.00	2.01
275	301216	万凯新材	711,130.00	2.01

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	897,994,180.85
卖出股票收入（成交）总额	734,149,510.68

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	31,701.27	0.01

8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	31,701.27	0.01

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
1	127114	宜化转债	197	19,700.43	0.01
2	113706	金帝转债	120	12,000.84	0.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

无。

7.11.2 本期国债期货投资评价

无。

7.12 投资组合报告附注

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

本基金投资的前十名证券的发行主体中，盛达金属资源股份有限公司本期被中国证券监督管理委员会立案调查，南亚新材料科技股份有限公司在报告编制日前一年内曾被上海证券交易所予以监

管警示。

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

7.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同约定的备选股票库情况的说明

本报告期内，本基金不存在投资的前十名股票超出基金合同约定的备选股票库的情况。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,867,568.00
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,990,166.53
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,857,734.53

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例

中信建投睿利 A	1,545	20,498.84	0.00	0.0000%	31,670,714.92	100.0000%
中信建投睿利 C	3,649	28,272.95	6,759,529.45	6.5520%	96,408,468.86	93.4480%
合计	5,111	26,382.06	6,759,529.45	5.0130%	128,079,183.78	94.9870%

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

8.2 盈利投资者数量占比

项目	过去一年（2025 年 07 月 01 日-2026 年 06 月 30 日）
盈利投资者数量占比	81.5128%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	中信建投睿利 A	230,551.68	0.7280%
	中信建投睿利 C	35,816.05	0.0347%
	合计	266,367.73	0.1975%

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

8.5 发起式基金发起资金持有份额情况

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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

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

本报告期期初基金份额总额	5,774,345.39	16,990,904.24
本报告期基金总申购份额	40,682,479.84	188,934,529.18
减：本报告期基金总赎回份额	14,786,110.31	102,757,435.11
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	31,670,714.92	103,167,998.31

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

2026 年 4 月 23 日，金强先生不再担任基金管理人总经理、副董事长，转任基金管理人董事长（法定代表人），黄凌先生不再担任基金管理人董事长（法定代表人）。自 2026 年 4 月 23 日起，金强先生代为履行基金管理人总经理职务。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期，无涉及基金管理人、基金财产的诉讼。

本报告期，无基金托管业务需要承担民事或刑事责任的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金未改聘会计师事务所。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，管理人未受调查或处罚。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，管理人相关从业人员未受调查或处罚。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，托管人无重大受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，托管人相关从业人员无重大受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信建投证券股份有限公司	3	1,632,061,947.05	100.00%	719,473.77	100.00%	-
东方证券股份有限公司	3	1,116.00	0.00%	0.39	0.00%	-

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

2、本报告期内，本基金办理证券投资委托的证券公司未发生变更。

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

（1）选择证券公司参与证券交易的标准

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

（2）选择证券公司参与证券交易的程序

基金管理人指定专人负责参与证券交易的证券公司的准入评估，并根据评估结果完成与证券公司的协议签订及交易佣金费率的确定等工作。基金管理人建立了“证券研究报告质量评分机制”“证券综合研究服务评分体系”等，每季度组织公募投研部门完成对已合作证券公司的研究服务打分评价，评价结果是确定/调整证券公司股票交易成交金额及佣金比例限制的参考。

10.7.2 基金租用或者通过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	成交金	占当期	成交金	占当期	成交金	占当期

		债券成交总额的比例	额	债券回购成交总额的比例	额	权证成交总额的比例	额	基金成交总额的比例
中信建投证券股份有限公司	70,512.13	100.00%	-	-	-	-	-	-
东方证券股份有限公司	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中信建投基金管理有限公司旗下部分基金 2025 年第 4 季度报告提示性公告	规定报刊	2026-01-22
2	中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	规定网站	2026-01-22
3	《中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金 2025 年第 4 季度报告》更正公告	规定网站	2026-01-24
4	中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金 2025 年第 4 季度报告（更正版）	规定网站	2026-01-24
5	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分基金增加广发银行股份有限公司为代销机构并开通定期定额投资业务及开展费率优惠的公告	规定网站、规定报刊	2026-02-11
6	中信建投基金管理有限公司旗下部分基金 2025 年年度报告提示性公告	规定报刊	2026-03-31
7	中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金 2025 年年度报告	规定网站	2026-03-31
8	中信建投基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况公告（2025 年度）	规定网站	2026-03-31
9	中信建投基金管理有限公司旗下部分基金 2026 年第 1 季度报告提示性公告	规定报刊	2026-04-22
10	中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	规定网站	2026-04-22
11	中信建投基金管理有限公司董事长（法定代表人）、高级管理人员变更公告	规定网站、规定报刊	2026-04-25
12	中信建投睿利灵活配置混合型发起式证券投资基金暂停大额申购（含大额定期定额投资）、大额转换转入公告	规定网站、规定报刊	2026-05-12
13	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分基金在北京银行股份有限公司开通基金转换业务的公告	规定网站、规定报刊	2026-05-26

14	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分基金在北京银行股份有限公司开通基金转换业务的公告	规定网站、规定报刊	2026-06-12
15	中信建投基金管理有限公司关于终止中证金牛（北京）基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	规定网站、规定报刊	2026-06-25

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20260212-20260212	0.00	8,877,315.50	8,877,315.50	0.00	0.0000%
产品特有风险							
本基金在报告期内存在单一投资者持有基金份额比例达到或者超过基金总份额 20%的情形，在市场流动性不足的情况下，如遇投资者巨额赎回或集中赎回，基金管理人可能无法以合理的价格及时变现基金资产，有可能对基金净值产生一定的影响，甚至可能引发基金的流动性风险。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，无影响投资者决策的其他重要信息。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

基金管理人及基金托管人住所。

12.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

中信建投基金管理有限公司
二〇二六年八月三十一日