

# 中信建投量化精选 6 个月持有期混合型证券投资基金

## 2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人:中信建投基金管理有限公司

基金托管人:中信银行股份有限公司

送出日期:2024 年 03 月 29 日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年3月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告期自2023年1月1日起至12月31日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	15
§7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	20
7.3 净资产变动表	21
7.4 报表附注	24
§8 投资组合报告	56
8.1 期末基金资产组合情况	56
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	56
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	57
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	77
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	81
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	82
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	82
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	82
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	82
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	82

8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	82
8.12	投资组合报告附注 .....	82
§9	基金份额持有人信息 .....	83
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	83
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	84
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	84
§10	开放式基金份额变动 .....	85
§11	重大事件揭示 .....	85
11.1	基金份额持有人大会决议 .....	85
11.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	85
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	85
11.4	基金投资策略的改变 .....	85
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	86
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	86
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	86
11.8	其他重大事件 .....	87
§12	影响投资者决策的其他重要信息 .....	91
12.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	91
12.2	影响投资者决策的其他重要信息 .....	91
§13	备查文件目录 .....	91
13.1	备查文件目录 .....	91
13.2	存放地点 .....	91
13.3	查阅方式 .....	91

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中信建投量化精选6个月持有期混合型证券投资基金	
基金简称	中信建投量化精选6个月持有期混合	
基金主代码	012878	
基金运作方式	契约型开放式、对每份基金份额设置6个月的最短持有期	
基金合同生效日	2021年07月27日	
基金管理人	中信建投基金管理有限公司	
基金托管人	中信银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	439,951,369.28份	
基金合同存续期	不定期	
下属各类别基金的基金简称	中信建投量化精选6个月持有期混合A	中信建投量化精选6个月持有期混合C
下属各类别基金的交易代码	012878	012879
报告期末下属各类别基金的份额总额	150,835,495.95份	289,115,873.33份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过数量化的方法精选个股，在严格控制风险、保持良好流动性的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金通过对各类宏观经济指标及资产市场行为数据进行量化分析，判断当前市场行为热点、运动趋势以及投资者风险偏好，并构建多种估值、发展预期等因子指标。基于各因子与股票、债券等大类资产价格的内在相关性及其影响机制，分别进行定量判断、筛选及归类。在上述归类结果的基础上，灵活运用各类数量模型，分别构建股票、债券、货币等大类资产配置价值的趋势判断的量化因子，形成对股票、债券、货币等大类资产的配置观点。

业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+中证综合债指数收益率×20%
风险收益特征	本基金属于混合型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	中信建投基金管理有限公司	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	朱伟
	联系电话	010-59100208
	电子邮箱	zhuweibj@csc.com.cn
客户服务电话	4009-108-108	95558
传真	010-59100298	010-85230024
注册地址	北京市怀柔区桥梓镇八龙桥雅苑3号楼1室	北京市朝阳区光华路10号院1号楼6-30层、32-42层
办公地址	北京市东城区朝阳门内大街2号凯恒中心B座17、19层	北京市朝阳区光华路10号院1号楼6-30层、32-42层
邮政编码	100010	100020
法定代表人	黄凌	方合英

### 2.4 信息披露方式

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

### 2.5 其他相关资料

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

## §3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2023年		2022年		2021年07月27日 (基金合同生效日) - 2021年12月31日	
	中信建投量化精选6个月持有期混合A	中信建投量化精选6个月持有期混合C	中信建投量化精选6个月持有期混合A	中信建投量化精选6个月持有期混合C	中信建投量化精选6个月持有期混合A	中信建投量化精选6个月持有期混合C
本期已实现收益	-6,291,917.58	-12,903,128.69	-40,736,180.17	-86,481,003.76	-9,863,106.02	-22,222,671.34
本期利润	-4,884,378.39	-10,383,167.58	-41,992,146.84	-91,216,946.36	-10,264,293.74	-22,922,283.03
加权平均基金份额本期利润	-0.0283	-0.0306	-0.1847	-0.1957	-0.0405	-0.0410
本期加权平均净值利润率	-3.56%	-3.87%	-21.76%	-23.11%	-4.09%	-4.15%
本期基金份额净值增长率	-4.74%	-5.13%	-18.33%	-18.65%	-3.74%	-3.91%
3.1.2 期末数据和指标	2023年末		2022年末		2021年末	
期末可供分配利润	-38,084,437.89	-75,086,144.47	-43,129,097.56	-87,183,927.44	-9,765,792.08	-22,333,137.66
期末可供分配基金份额利润	-0.2525	-0.2597	-0.2138	-0.2183	-0.0374	-0.0391
期末基金资产净值	112,959,625.04	214,417,395.86	158,579,173.39	312,170,586.30	251,066,598.11	548,909,865.22
期末基金份额净值	0.7489	0.7416	0.7862	0.7817	0.9626	0.9609
3.1.3 累计期末指标	2023年末		2022年末		2021年末	
基金份额累计净值增长率	-25.11%	-25.84%	-21.38%	-21.83%	-3.74%	-3.91%

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

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

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中信建投量化精选6个月持有期混合A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-3.67%	0.65%	-5.37%	0.63%	1.70%	0.02%
过去六个月	-7.44%	0.64%	-8.22%	0.68%	0.78%	-0.04%
过去一年	-4.74%	0.57%	-8.22%	0.68%	3.48%	-0.11%
自基金合同生效起至今	-25.11%	0.95%	-23.22%	0.85%	-1.89%	0.10%

中信建投量化精选6个月持有期混合C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-3.76%	0.65%	-5.37%	0.63%	1.61%	0.02%
过去六个月	-7.63%	0.64%	-8.22%	0.68%	0.59%	-0.04%
过去一年	-5.13%	0.57%	-8.22%	0.68%	3.09%	-0.11%
自基金合同生效起至今	-25.84%	0.95%	-23.22%	0.85%	-2.62%	0.10%

### 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

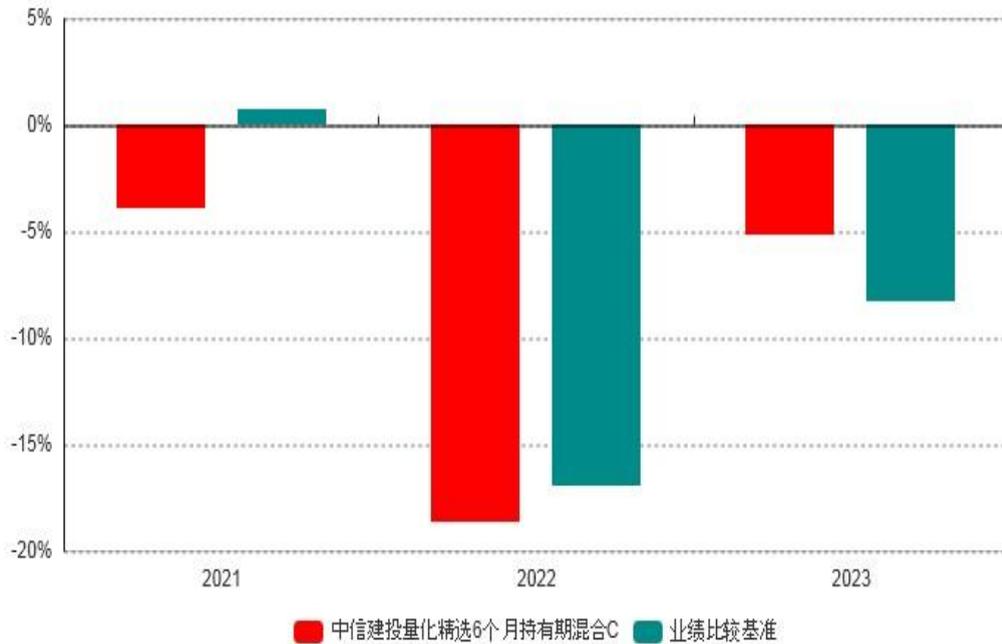
中信建投量化精选6个月持有期混合A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2021年07月27日-2023年12月31日)



中信建投量化精选6个月持有期混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2021年07月27日-2023年12月31日)



### 3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：基金合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至报告期末，中信建投基金在管公募证券投资基金共54个。中信建投基金以公募基金为业务本源，以专户业务为服务抓手，加强投研体系建设，注重核心投资人才的积累、培养，不断提升主动投资管理能力。同时，中信建投基金加强客户体系建设，积极拓展渠道，加大与国有大行、股份制银行、证券公司以及保险机构的合作力度。中信建投基金各项业务有序开展，为进一步发展奠定了良好的基础。

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

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王鹏	本基金的基金经理、指数与量化投资部行政负责人	2021-07-27	-	8年	中国籍，1984年8月生，哥伦比亚大学统计学硕士。曾任中财期货分析师、LCM Commodities研究员、CIBC World Market期权交易员、中金基金管理有限公司量化投资副总经理、中金睿投投资管理有限公司量化投资副总经理、中信建投证券股份有限公司量化投资总监。2019年2月加入中信建投基金管理有限公司，曾任权益投资部-指数与量化投

					<p>资部负责人、总监，现任本公司指数与量化投资部行政负责人、基金经理，担任中信建投中证500指数增强型证券投资基金、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、中信建投中证1000指数增强型证券投资基金、中信建投沪深300指数增强型证券投资基金、中信建投红利智选混合型证券投资基金基金经理。</p>
--	--	--	--	--	--

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

2、证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023年，中国资产的整体表现不尽如人意。A股、港股在年初曾开启一波强劲的震荡反弹行情，但是二季度以后，两大市场的指数整体重心下移，上证指数年末仍在3000点下方徘徊。从宏观经济看，受外部环境复杂性、严峻性、不确定性上升的影响，2023年以来的复苏节奏有所扰动。由于市场筹码结构、投资者认知偏差等因素影响，权益市场四季度情绪仍较为悲观，赚钱效应较差。四季度末市场资金面明显改善。目前市场总体估值处于冰点，作为大类资产的权益资产，综合性价比不断提升。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中信建投量化精选6个月持有期混合A基金份额净值为0.7489元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-4.74%，同期业绩比较基准收益率为-8.22%；截至报告期末中信建投量化精选6个月持有期混合C基金份额净值为0.7416元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-5.13%，同期业绩比较基准收益率为-8.22%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2024年A股的企业盈利和股票供求关系会好于2023年，中美关系稳定，外部的流动性环境对A股有利。这些因素综合在一起来看，A股现在具备配置价值。从估值上看，权益市场风险溢价在2023年四季度更接近历史极值水平，从性价比看权益对债券的相对优势也在进一步扩大；从政策面看，我们相信防风险最好的路径是发展，且经过一年的观察评估和筹划准备，预计未来将有更多实质性稳增长新政策落地，新老措施效果也有望逐渐体现。

## 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术；建立了估值委员会，由公司分管运营领导任估值委员会主任，委员包括权益投资相关部门、固定收益部、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。

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

#### 4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

## §5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对中信建投量化精选6个月持有期混合型证券投资基金2023年的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，中信建投基金管理有限公司在中信建投量化精选6个月持有期混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，中信建投基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的2023年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

## §6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2024)第22904号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	中信建投量化精选6个月持有期混合型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	(一) 我们审计的内容 我们审计了中信建投量化精选6个月持有期混合型证券投资基金(以下简称“中信建投量化精选6

	<p>个月持有期混合基金”)的财务报表,包括2023年12月31日的资产负债表,2023年度的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了中信建投量化精选6个月持有期混合基金2023年12月31日的财务状况以及2023年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
<p>形成审计意见的基础</p>	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于中信建投量化精选6个月持有期混合基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
<p>强调事项</p>	<p>无</p>
<p>其他事项</p>	<p>无</p>
<p>其他信息</p>	<p>无</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>中信建投量化精选6个月持有期混合基金的基金管理人中信建投基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估中信建投量化精选6个月持有期混合基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),</p>

	<p>并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算中信建投量化精选6个月持有期混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督中信建投量化精选6个月持有期混合基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对中信建投量化精选6个月持有期混合基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们</p>

	<p>在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致中信建投量化精选6个月持有期混合基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	叶尔甸	张碧佳
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场二座普华永道中心11楼	
审计报告日期	2024-03-27	

## §7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：中信建投量化精选6个月持有期混合型证券投资基金

报告截止日：2023年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	32,893,207.18	120,384,996.27
结算备付金		34,306,788.96	20,500,527.83
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	262,558,865.47	331,147,703.49
其中：股票投资		262,304,579.68	331,147,703.49

基金投资		-	-
债券投资		254,285.79	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		1,008.95	2,708.12
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		329,759,870.56	472,035,935.71
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年12月31日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		1,747,321.89	274,611.97
应付管理人报酬		336,363.35	618,819.66
应付托管费		56,060.57	103,136.61
应付销售服务费		73,100.16	109,607.78
应付投资顾问费		-	-
应交税费		3.69	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	170,000.00	180,000.00

负债合计		2,382,849.66	1,286,176.02
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.7	439,951,369.28	601,062,784.69
未分配利润	7.4.7.8	-112,574,348.38	-130,313,025.00
净资产合计		327,377,020.90	470,749,759.69
负债和净资产总计		329,759,870.56	472,035,935.71

注：报告截止日2023年12月31日，基金份额总额439,951,369.28份，其中A类基金份额净值0.7489元，基金份额150,835,495.95份；C类基金份额净值0.7416元，基金份额289,115,873.33份。

## 7.2 利润表

会计主体：中信建投量化精选6个月持有期混合型证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年01月01日至2 023年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2 022年12月31日
<b>一、营业总收入</b>		-7,317,517.19	-121,116,078.77
1.利息收入		792,496.25	419,047.45
其中：存款利息收入	7.4.7.9	792,496.25	419,047.45
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）		-12,037,513.74	-115,543,216.95
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-16,397,697.82	-125,146,164.93
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	151,296.46	-
资产支持证券投资		-	-

收益			
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.12	-2,218,977.34	-
股利收益	7.4.7.13	6,427,864.96	9,602,947.98
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.14	3,927,500.30	-5,991,909.27
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		7,950,028.78	12,093,014.43
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	5,741,387.58	8,847,799.31
2.托管费	7.4.10.2.2	956,897.86	1,474,633.27
3.销售服务费	7.4.10.2.3	1,076,795.48	1,585,266.78
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.信用减值损失	7.4.7.16	-	-
7.税金及附加		114.36	-
8.其他费用	7.4.7.17	174,833.50	185,315.07
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-15,267,545.97	-133,209,093.20
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-15,267,545.97	-133,209,093.20
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-15,267,545.97	-133,209,093.20

### 7.3 净资产变动表

会计主体：中信建投量化精选6个月持有期混合型证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	601,062,784.69	-130,313,025.00	470,749,759.69
二、本期期初净资产	601,062,784.69	-130,313,025.00	470,749,759.69
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-161,111,415.41	17,738,676.62	-143,372,738.79
（一）、综合收益总额	-	-15,267,545.97	-15,267,545.97
（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）	-161,111,415.41	33,006,222.59	-128,105,192.82
其中：1.基金申购款	2,372,740.23	-472,993.35	1,899,746.88
2.基金赎回款	-163,484,155.64	33,479,215.94	-130,004,939.70
（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）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-
四、本期期末净资产	439,951,369.28	-112,574,348.38	327,377,020.90
项目	上年度可比期间		

	2022年01月01日至2022年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	832,075,393.07	-32,098,929.74	799,976,463.33
二、本期期初净资产	832,075,393.07	-32,098,929.74	799,976,463.33
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-231,012,608.38	-98,214,095.26	-329,226,703.64
（一）、综合收益总额	-	-133,209,093.20	-133,209,093.20
（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）	-231,012,608.38	34,994,997.94	-196,017,610.44
其中：1.基金申购款	11,662,126.30	-1,789,796.05	9,872,330.25
2.基金赎回款	-242,674,734.68	36,784,793.99	-205,889,940.69
（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）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-
四、本期期末净资产	601,062,784.69	-130,313,025.00	470,749,759.69

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

黄凌

张欣宇

谭保民

-----  
基金管理人负责人

-----  
主管会计工作负责人

-----  
会计机构负责人

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

中信建投量化精选6个月持有期混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可〔2021〕2090号《关于准予中信建投量化精选6个月持有期混合型证券投资基金注册的批复》核准,由中信建投基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中信建投量化精选6个月持有期混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,最短持有期为6个月的单笔锁定持续运作,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币782,504,063.09元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2021)第0742号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《中信建投量化精选6个月持有期混合型证券投资基金基金合同》于2021年7月27日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为782,620,738.32份基金份额,其中认购资金利息折合116,675.23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,基金托管人为中信银行股份有限公司。

根据《中信建投量化精选6个月持有期混合型证券投资基金招募说明书》,本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用的基金份额,称为A类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额,称为C类基金份额。本基金A类、C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中信建投量化精选6个月持有期混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(含创业板及其他经中国证监会允许上市的股票、存托凭证)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、证券公司短期公司债券、公开发行的次级债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为:股票(含存托凭证)资产占基金资产的60%-95%;每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券;

其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率\*80%+中证综合债指数收益率\*20%。

本财务报表由本基金的基金管理人中信建投基金管理有限公司于2024年3月27日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《中信建投量化精选6个月持有期混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2023年度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2023年12月31日的财务状况以及2023年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

###### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金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。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

#### 债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

##### 以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

##### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

#### 权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

#### (2)金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### (3)衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于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，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征

因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

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

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。对于已开放转换业务的基金，上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息确认为公允价值变动损益;于处置时,其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用后的净额确认为投资收益,其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作,不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

(2)对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发〔2017〕6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告〔2017〕13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

## 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

## 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税〔2002〕128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税〔2008〕1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税〔2012〕85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税〔2015〕101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税〔2016〕36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税〔2016〕46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税〔2016〕70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、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》、财税〔2017〕2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税〔2017〕56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

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

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告2023年第39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
	2023年12月31日	2022年12月31日
活期存款	4,892,392.60	14,517,859.49
等于：本金	4,891,629.55	14,514,405.11
加：应计利息	763.05	3,454.38
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	28,000,814.58	105,867,136.78
等于：本金	27,997,141.48	105,861,139.88
加：应计利息	3,673.10	5,996.90
减：坏账准备	-	-
合计	32,893,207.18	120,384,996.27

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2023年12月31日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	265,529,976.34	-	262,304,579.68	-3,225,396.66
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债   交易所市场	194,000.00	97.51	254,285.79	60,188.28

券	银行间市场	-	-	-	-
	合计	194,000.00	97.51	254,285.79	60,188.28
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		265,723,976.34	97.51	262,558,865.47	-3,165,208.38
项目		上年度末			
		2022年12月31日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		338,240,412.17	-	331,147,703.49	-7,092,708.68
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		338,240,412.17	-	331,147,703.49	-7,092,708.68

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

#### 7.4.7.5 其他资产

无余额。

#### 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
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	170,000.00	180,000.00
合计	170,000.00	180,000.00

#### 7.4.7.7 实收基金

##### 7.4.7.7.1 中信建投量化精选6个月持有期混合A

金额单位：人民币元

项目 (中信建投量化精选6个月持有期混合A)	本期 2023年01月01日至2023年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	201,708,270.95	201,708,270.95
本期申购	729,424.92	729,424.92
本期赎回(以“-”号填列)	-51,602,199.92	-51,602,199.92
本期末	150,835,495.95	150,835,495.95

##### 7.4.7.7.2 中信建投量化精选6个月持有期混合C

金额单位：人民币元

项目 (中信建投量化精选6个月持有期混合C)	本期 2023年01月01日至2023年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	399,354,513.74	399,354,513.74

本期申购	1,643,315.31	1,643,315.31
本期赎回（以“-”号填列）	-111,881,955.72	-111,881,955.72
本期末	289,115,873.33	289,115,873.33

#### 7.4.7.8 未分配利润

##### 7.4.7.8.1 中信建投量化精选6个月持有期混合A

单位：人民币元

项目 (中信建投量化精选6 个月持有期混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-42,229,852.66	-899,244.90	-43,129,097.56
本期期初	-42,229,852.66	-899,244.90	-43,129,097.56
本期利润	-6,291,917.58	1,407,539.19	-4,884,378.39
本期基金份额交易产 生的变动数	10,437,332.35	-299,727.31	10,137,605.04
其中：基金申购款	-149,901.67	4,816.95	-145,084.72
基金赎回款	10,587,234.02	-304,544.26	10,282,689.76
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-38,084,437.89	208,566.98	-37,875,870.91

##### 7.4.7.8.2 中信建投量化精选6个月持有期混合C

单位：人民币元

项目 (中信建投量化精选6 个月持有期混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-85,397,185.79	-1,786,741.65	-87,183,927.44
本期期初	-85,397,185.79	-1,786,741.65	-87,183,927.44
本期利润	-12,903,128.69	2,519,961.11	-10,383,167.58
本期基金份额交易产 生的变动数	23,214,170.01	-345,552.46	22,868,617.55
其中：基金申购款	-343,977.82	16,069.19	-327,908.63
基金赎回款	23,558,147.83	-361,621.65	23,196,526.18

本期已分配利润	-	-	-
本期末	-75,086,144.47	387,667.00	-74,698,477.47

#### 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日
活期存款利息收入	79,475.87	91,931.25
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	138,622.08	126,340.02
结算备付金利息收入	574,398.30	200,776.18
其他	-	-
合计	792,496.25	419,047.45

#### 7.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日
卖出股票成交总额	3,521,752,529.82	9,516,302,563.55
减：卖出股票成本总额	3,530,823,067.52	9,620,352,112.62
减：交易费用	7,327,160.12	21,096,615.86
买卖股票差价收入	-16,397,697.82	-125,146,164.93

#### 7.4.7.11 债券投资收益

##### 7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日
债券投资收益——利息收入	219.35	-

债券投资收益——买卖债券 (债转股及债券到期兑付) 差价收入	151,077.11	-
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	151,296.46	-

#### 7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月 31日
卖出债券（债转股 及债券到期兑付） 成交总额	537,332.88	-
减：卖出债券（债 转股及债券到期兑 付）成本总额	386,100.00	-
减：应计利息总额	129.48	-
减：交易费用	26.29	-
买卖债券差价收入	151,077.11	-

#### 7.4.7.12 衍生工具收益

##### 7.4.7.12.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

##### 7.4.7.12.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日

期货投资	-2,218,977.34	-
------	---------------	---

#### 7.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023 年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022 年12月31日
股票投资产生的股利收益	6,427,864.96	9,602,947.98
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	6,427,864.96	9,602,947.98

#### 7.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年01月01日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12 月31日
1.交易性金融资产	3,927,500.30	-5,991,909.27
——股票投资	3,867,312.02	-5,991,909.27
——债券投资	60,188.28	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允 价值变动产生的预估增 值税	-	-
合计	3,927,500.30	-5,991,909.27

#### 7.4.7.15 其他收入

无。

#### 7.4.7.16 信用减值损失

无。

#### 7.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日
审计费用	50,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
汇划手续费	4,833.50	5,315.07
合计	174,833.50	185,315.07

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无重大资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

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

注：元达信资本管理（北京）有限公司于2023年7月更名为中信建投利信资本管理（北京）有限公司。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

无。

###### 7.4.10.1.2 权证交易

无。

###### 7.4.10.1.3 债券交易

无。

###### 7.4.10.1.4 债券回购交易

无。

###### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至20 23年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至20 22年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	5,741,387.58	8,847,799.31
其中：应支付销售机构的客户维护费	2,845,113.19	4,382,503.71
应支付基金管理人的净管理费	2,896,274.39	4,465,295.60

注：1、支付基金管理人中信建投基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.50%/当年天数。

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

#### 7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023 年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022 年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	956,897.86	1,474,633.27

注：1、支付基金托管人中信银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.25%/当年天数。

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

#### 7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中信建投量化精选6个月持有期混合A	中信建投量化精选6个月持有期混合C	合计
中信建投基金管理有限公司	0.00	439.83	439.83
中信建投证券股份有限公司	0.00	78,312.03	78,312.03

中信银行股份有限公司	0.00	165,094.39	165,094.39
合计	0.00	243,846.25	243,846.25
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中信建投量化精选6个月持有期混合A	中信建投量化精选6个月持有期混合C	合计
中信建投基金管理有限公司	0.00	783.09	783.09
中信建投证券股份有限公司	0.00	106,072.52	106,072.52
中信银行股份有限公司	0.00	214,759.27	214,759.27
合计	0.00	321,614.88	321,614.88

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

#### 7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

##### 7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

**7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信银行股份有限公司	4,892,392.60	79,475.87	14,517,859.49	91,931.25

注：本基金的银行存款由基金托管人中信银行股份有限公司保管，按约定利率计息。

**7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

金额单位：人民币元

本期 2023年01月01日至2023年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张/股）	总金额
中信建投证券股份有限公司	301260	格力博	网下配售	9,227	284,652.95
中信建投证券股份有限公司	301358	湖南裕能	网下配售	6,678	158,736.06
中信建投证券股份有限公司	001337	四川黄金	网下配售	795	5,636.55
上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张/股）	总金额

中信建投 证券股份 有限公司	001227	兰州银行	网下配售	7,868	28,088.76
中信建投 证券股份 有限公司	688281	华秦科技	网下配售	1,936	366,872.00
中信建投 证券股份 有限公司	301236	软通动力	网下配售	6,085	443,474.80
中信建投 证券股份 有限公司	688153	唯捷创芯	网下配售	5,312	353,779.20
中信建投 证券股份 有限公司	603272	联翔股份	网下配售	443	6,042.52
中信建投 证券股份 有限公司	688119	中钢洛耐	网下配售	33,327	168,634.62
中信建投 证券股份 有限公司	301266	宇邦新材	网下配售	5,161	138,624.46
中信建投 证券股份 有限公司	688322	奥比中光	网下配售	8,529	264,313.71
中信建投 证券股份 有限公司	301308	江波龙	网下配售	5,915	329,288.05
中信建投 证券股份 有限公司	001236	弘业期货	网下配售	1,399	2,602.14
中信建投 证券股份 有限公司	688203	海正生材	网下配售	5,761	96,093.48

中信建投证券股份有限公司	688381	帝奥微	网下配售	4,494	187,309.92
中信建投证券股份有限公司	001300	三柏硕	网下配售	763	8,522.71
中信建投证券股份有限公司	001338	永顺泰	网下配售	1,649	11,246.18
中信建投证券股份有限公司	603130	云中马	网下配售	480	9,465.60
中信建投证券股份有限公司	301311	昆船智能	网下配售	8,320	115,481.60
中信建投证券股份有限公司	688143	长盈通	网下配售	1,938	69,128.46
中信建投证券股份有限公司	688172	燕东微	网下配售	13,981	307,302.38

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金用于期货交易结算的资金存放于中信建投期货的结算账户中，结算备付金按银行同业利率计息。于2023年12月31日，本基金存放于中信建投期货的结算备付金余额为0.00元。于2023年度，本基金当期的中信建投期货结算备付金利息收入为216,222.33元。（于2022年12月31日，本基金存放于中信建投期货的结算备付金余额为68,531.01元。于2022年度，本基金当期的中信建投期货结算备付金利息收入为68,511.83元。）

#### 7.4.11 利润分配情况--固定净值型货币市场基金之外的基金

无。

#### 7.4.12 期末（2023年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

##### 7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人及结算券商华创证券有限责任公司的证券账户，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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

#### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无余额。

#### 7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无余额。

#### 7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无余额。

#### 7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
AAA	-	-
AAA以下	254,285.79	-
未评级	-	-
合计	254,285.79	-

注：以上按长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无余额。

#### 7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无余额。

### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可于约定开放日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2023年12月31日，除附注7.4.12.3中列示的卖出回购金融资产款余额将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。于2023年12月31日，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。于2023年12月31日，本基金确认的净赎回申请未超过7个工作日可变现资产的可变现价值。

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

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年1 2月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					

中信建投量化精选6个月持有期混合型证券投资基金2023年年度报告

货币资金	32,893,207.18	-	-	-	32,893,207.18
结算备付金	34,306,788.96	-	-	-	34,306,788.96
交易性金融资产	-	-	254,285.79	262,304,579.68	262,558,865.47
应收申购款	-	-	-	1,008.95	1,008.95
资产总计	67,199,996.14	-	254,285.79	262,305,588.63	329,759,870.56
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,747,321.89	1,747,321.89
应付管理人报酬	-	-	-	336,363.35	336,363.35
应付托管费	-	-	-	56,060.57	56,060.57
应付销售服务费	-	-	-	73,100.16	73,100.16
应交税费	-	-	-	3.69	3.69
其他负债	-	-	-	170,000.00	170,000.00
负债总计	-	-	-	2,382,849.66	2,382,849.66
利率敏感度缺口	67,199,996.14	-	254,285.79	259,922,738.97	327,377,020.90
上年度末 2022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	120,384,996.27	-	-	-	120,384,996.27
结算备付金	20,500,527.83	-	-	-	20,500,527.83
交易性金融资产	-	-	-	331,147,703.49	331,147,703.49
应收申购款	-	-	-	2,708.12	2,708.12
资产总计	140,885,524.10	-	-	331,150,411.61	472,035,935.71
负债					
应付赎回款	-	-	-	274,611.97	274,611.97
应付管理人报酬	-	-	-	618,819.66	618,819.66
应付托管费	-	-	-	103,136.61	103,136.61
应付销售服务费	-	-	-	109,607.78	109,607.78
其他负债	-	-	-	180,000.00	180,000.00
负债总计	-	-	-	1,286,176.02	1,286,176.02
利率敏感度缺口	140,885,524.10	-	-	329,864,235.59	470,749,759.69

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2023年12月31日，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为0.08%（2022年12月31日：无），因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响（2022年12月31日：同）。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过量化分析，对宏观经济情况及市场行为进行分析，做出资产配置的决定；通过运用多因子分析模型和机器学习模型构建投资组合，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

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

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日		上年度末 2022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	262,304,579.68	80.12	331,147,703.49	70.34
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	254,285.79	0.08	-	-
交易性金融资	-	-	-	-

产—贵金属投资				
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	262,558,865.47	80.20	331,147,703.49	70.34

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币元)	
		本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
	业绩比较基准上升5%	11,479,073.67	25,328,744.45
	业绩比较基准下降5%	-11,479,073.67	-25,328,744.45

#### 7.4.14 公允价值

##### 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	262,558,865.47	329,681,512.95
第二层次	-	283,877.10
第三层次	-	1,182,313.44
合计	262,558,865.47	331,147,703.49

#### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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。

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

#### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

##### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	1,182,313.44	1,182,313.44
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	89,883.10	89,883.10
转出第三层次	-	1,458,162.61	1,458,162.61
当期利得或损失总额	-	185,966.07	185,966.07
其中：计入损益的利得或损失	-	185,966.07	185,966.07
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-
项目	上年度可比期间		

	2022年01月01日至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	561,231.87	561,231.87
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	1,339,037.47	1,339,037.47
转出第三层次	-	458,636.87	458,636.87
当期利得或损失总额	-	-259,319.03	-259,319.03
其中：计入损益的利得或损失	-	-259,319.03	-259,319.03
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,182,313.44	1,182,313.44
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	119,628.07	119,628.07

注：于2023年度，本基金从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资（2022年度同）。计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

#### 7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
交易性金融资产-股票投资	1,182,313.44	亚式期权	预期波动率	21.27%~247.56%	负相关

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2023年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2022年12月31日：同)。

#### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

### §8 投资组合报告

#### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	262,304,579.68	79.54
	其中：股票	262,304,579.68	79.54
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	254,285.79	0.08
	其中：债券	254,285.79	0.08
	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	67,199,996.14	20.38
8	其他各项资产	1,008.95	0.00
9	合计	329,759,870.56	100.00

#### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

##### 8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	357,408.00	0.11
B	采矿业	5,634,967.00	1.72
C	制造业	163,751,170.68	50.02
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,983,932.00	2.13
E	建筑业	9,866,070.00	3.01
F	批发和零售业	5,222,941.00	1.60
G	交通运输、仓储和邮政业	8,548,159.00	2.61
H	住宿和餐饮业	409,630.00	0.13
I	信息传输、软件和信息技术服务业	19,097,404.00	5.83
J	金融业	19,380,223.00	5.92
K	房地产业	4,350,318.00	1.33
L	租赁和商务服务业	6,032,954.00	1.84
M	科学研究和技术服务业	3,076,024.00	0.94
N	水利、环境和公共设施管理业	4,594,413.00	1.40
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	183,890.00	0.06
Q	卫生和社会工作	1,338,753.00	0.41
R	文化、体育和娱乐业	3,280,265.00	1.00
S	综合	196,058.00	0.06
	合计	262,304,579.68	80.12

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无余额。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002493	荣盛石化	230,400	2,384,640.00	0.73

2	605007	五洲特纸	138,300	2,034,393.00	0.62
3	688127	蓝特光学	85,900	2,000,611.00	0.61
4	300308	中际旭创	16,800	1,896,888.00	0.58
5	300854	中兰环保	107,500	1,875,875.00	0.57
6	000059	华锦股份	330,300	1,813,347.00	0.55
7	300558	贝达药业	34,800	1,793,940.00	0.55
8	000543	皖能电力	286,400	1,792,864.00	0.55
9	002045	国光电器	106,600	1,774,890.00	0.54
10	603208	江山欧派	59,600	1,769,524.00	0.54
11	600153	建发股份	179,300	1,726,659.00	0.53
12	002878	元隆雅图	90,700	1,687,927.00	0.52
13	688510	航亚科技	94,500	1,665,090.00	0.51
14	300729	乐歌股份	92,200	1,651,302.00	0.50
15	300129	泰胜风能	152,300	1,640,271.00	0.50
16	688223	晶科能源	183,100	1,622,266.00	0.50
17	600567	山鹰国际	832,900	1,615,826.00	0.49
18	603063	禾望电气	64,600	1,615,000.00	0.49
19	603221	爱丽家居	160,800	1,598,352.00	0.49
20	000157	中联重科	242,600	1,584,178.00	0.48
21	600061	国投资本	234,200	1,578,508.00	0.48
22	603197	保隆科技	27,900	1,573,560.00	0.48
23	002870	香山股份	43,800	1,571,106.00	0.48
24	605338	巴比食品	72,100	1,548,708.00	0.47
25	600010	包钢股份	1,054,100	1,538,986.00	0.47
26	601688	华泰证券	109,300	1,524,735.00	0.47
27	601600	中国铝业	269,800	1,521,672.00	0.46
28	688226	威腾电气	80,500	1,513,400.00	0.46
29	601138	工业富联	100,000	1,512,000.00	0.46
30	688129	东来技术	91,300	1,511,015.00	0.46
31	601360	三六零	164,500	1,482,145.00	0.45
32	300947	德必集团	93,700	1,470,153.00	0.45

33	000035	中国天楹	285,900	1,412,346.00	0.43
34	688168	安博通	38,800	1,403,008.00	0.43
35	603501	韦尔股份	13,100	1,397,901.00	0.43
36	601618	中国中冶	456,600	1,397,196.00	0.43
37	300217	东方电热	258,300	1,389,654.00	0.42
38	000338	潍柴动力	100,300	1,369,095.00	0.42
39	300990	同飞股份	30,200	1,344,202.00	0.41
40	600115	中国东航	342,900	1,330,452.00	0.41
41	600570	恒生电子	45,700	1,314,332.00	0.40
42	601111	中国国航	179,000	1,313,860.00	0.40
43	600150	中国船舶	44,500	1,310,080.00	0.40
44	600372	中航机载	98,500	1,298,230.00	0.40
45	002027	分众传媒	204,100	1,289,912.00	0.39
46	000725	京东方A	317,400	1,237,860.00	0.38
47	000538	云南白药	25,100	1,233,665.00	0.38
48	605167	利柏特	128,100	1,215,669.00	0.37
49	600038	中直股份	31,400	1,209,842.00	0.37
50	300084	海默科技	158,300	1,209,412.00	0.37
51	601633	长城汽车	47,900	1,208,038.00	0.37
52	001979	招商蛇口	126,700	1,207,451.00	0.37
53	000651	格力电器	37,400	1,203,158.00	0.37
54	000166	申万宏源	268,300	1,191,252.00	0.36
55	002563	森马服饰	206,100	1,189,197.00	0.36
56	603683	晶华新材	104,400	1,175,544.00	0.36
57	000617	中油资本	216,500	1,169,100.00	0.36
58	600085	同仁堂	21,700	1,165,290.00	0.36
59	300274	阳光电源	13,200	1,156,188.00	0.35
60	002271	东方雨虹	60,000	1,152,000.00	0.35
61	300823	建科机械	53,000	1,140,030.00	0.35
62	601788	光大证券	73,400	1,131,828.00	0.35
63	002811	郑中设计	113,800	1,120,930.00	0.34

64	300433	蓝思科技	84,700	1,118,040.00	0.34
65	601800	中国交建	146,300	1,111,880.00	0.34
66	600011	华能国际	143,300	1,103,410.00	0.34
67	601857	中国石油	155,900	1,100,654.00	0.34
68	002648	卫星化学	74,400	1,097,400.00	0.34
69	600362	江西铜业	60,600	1,082,316.00	0.33
70	601186	中国铁建	140,000	1,065,400.00	0.33
71	002837	英维克	38,600	1,060,728.00	0.32
72	600588	用友网络	59,600	1,060,284.00	0.32
73	300851	交大思诺	33,500	1,044,195.00	0.32
74	600029	南方航空	180,700	1,040,832.00	0.32
75	600493	凤竹纺织	152,800	1,026,816.00	0.31
76	002823	凯中精密	80,800	1,026,160.00	0.31
77	601336	新华保险	32,900	1,024,177.00	0.31
78	002615	哈尔斯	138,900	1,018,137.00	0.31
79	600066	宇通客车	76,400	1,012,300.00	0.31
80	000100	TCL科技	235,100	1,010,930.00	0.31
81	600489	中金黄金	100,200	997,992.00	0.30
82	600919	江苏银行	146,500	980,085.00	0.30
83	300316	晶盛机电	22,100	974,389.00	0.30
84	601019	山东出版	102,900	965,202.00	0.29
85	000776	广发证券	66,700	953,143.00	0.29
86	601668	中国建筑	197,400	949,494.00	0.29
87	601868	中国能建	448,900	942,690.00	0.29
88	605128	上海沿浦	16,200	940,410.00	0.29
89	300015	爱尔眼科	59,000	933,380.00	0.29
90	002459	晶澳科技	44,100	913,752.00	0.28
91	002736	国信证券	106,800	912,072.00	0.28
92	000786	北新建材	38,800	906,368.00	0.28
93	002753	永东股份	109,200	900,900.00	0.28
94	600050	中国联通	204,800	897,024.00	0.27

95	600019	宝钢股份	147,600	875,268.00	0.27
96	600926	杭州银行	86,200	862,862.00	0.26
97	002212	天融信	88,100	861,618.00	0.26
98	600030	中信证券	42,200	859,614.00	0.26
99	688147	微导纳米	21,900	853,881.00	0.26
100	601728	中国电信	157,800	853,698.00	0.26
101	688310	迈得医疗	28,300	846,170.00	0.26
102	000533	顺钠股份	174,200	816,998.00	0.25
103	002236	大华股份	43,700	806,265.00	0.25
104	600481	双良节能	95,100	804,546.00	0.25
105	300450	先导智能	30,900	791,040.00	0.24
106	000554	泰山石油	132,900	766,833.00	0.23
107	002429	兆驰股份	136,600	762,228.00	0.23
108	002991	甘源食品	10,500	750,330.00	0.23
109	601566	九牧王	74,900	746,753.00	0.23
110	688676	金盘科技	19,800	709,434.00	0.22
111	601155	新城控股	62,100	708,561.00	0.22
112	600606	绿地控股	300,400	690,920.00	0.21
113	688376	美埃科技	17,800	676,222.00	0.21
114	002697	红旗连锁	135,400	674,292.00	0.21
115	601339	百隆东方	138,200	673,034.00	0.21
116	301004	嘉益股份	14,800	672,660.00	0.21
117	600398	海澜之家	90,500	671,510.00	0.21
118	002032	苏泊尔	12,600	667,926.00	0.20
119	601000	唐山港	189,700	663,950.00	0.20
120	600887	伊利股份	24,600	658,050.00	0.20
121	601236	红塔证券	83,200	631,488.00	0.19
122	688049	炬芯科技	16,300	620,541.00	0.19
123	600064	南京高科	96,200	581,048.00	0.18
124	600461	洪城环境	63,200	577,648.00	0.18
125	300394	天孚通信	6,300	576,576.00	0.18

126	688489	三未信安	12,000	564,240.00	0.17
127	002884	凌霄泵业	32,000	555,520.00	0.17
128	603328	依顿电子	67,300	548,495.00	0.17
129	600639	浦东金桥	53,500	540,885.00	0.17
130	002533	金杯电工	66,000	533,280.00	0.16
131	601233	桐昆股份	35,200	532,576.00	0.16
132	300625	三雄极光	35,600	527,592.00	0.16
133	688033	天宜上佳	30,600	517,140.00	0.16
134	300347	泰格医药	9,400	516,718.00	0.16
135	600502	安徽建工	110,600	514,290.00	0.16
136	000404	长虹华意	87,100	513,019.00	0.16
137	002381	双箭股份	65,800	498,764.00	0.15
138	002138	顺络电子	18,400	496,984.00	0.15
139	001965	招商公路	50,300	491,431.00	0.15
140	300001	特锐德	23,500	472,350.00	0.14
141	688059	华锐精密	6,000	472,260.00	0.14
142	301266	宇邦新材	8,500	470,645.00	0.14
143	300957	贝泰妮	6,900	470,373.00	0.14
144	600535	天士力	27,600	469,752.00	0.14
145	600820	隧道股份	81,500	469,440.00	0.14
146	600710	苏美达	65,700	465,813.00	0.14
147	002891	中宠股份	17,600	463,760.00	0.14
148	002014	永新股份	55,200	460,920.00	0.14
149	002905	金逸影视	41,600	455,936.00	0.14
150	002919	名臣健康	17,700	453,828.00	0.14
151	600241	时代万恒	50,500	452,985.00	0.14
152	000513	丽珠集团	12,800	448,128.00	0.14
153	688556	高测股份	11,400	444,486.00	0.14
154	601298	青岛港	71,100	439,398.00	0.13
155	000997	新大陆	22,300	437,303.00	0.13
156	002011	盾安环境	31,700	435,875.00	0.13

157	600060	海信视像	20,800	434,720.00	0.13
158	002415	海康威视	12,400	430,528.00	0.13
159	001696	宗申动力	64,900	430,287.00	0.13
160	603920	世运电路	23,500	429,580.00	0.13
161	600941	中国移动	4,300	427,764.00	0.13
162	000333	美的集团	7,800	426,114.00	0.13
163	600028	中国石化	76,200	425,196.00	0.13
164	300750	宁德时代	2,600	424,476.00	0.13
165	300999	金龙鱼	12,700	423,926.00	0.13
166	601816	京沪高铁	86,100	423,612.00	0.13
167	600938	中国海油	20,200	423,594.00	0.13
168	601318	中国平安	10,500	423,150.00	0.13
169	600886	国投电力	32,100	423,078.00	0.13
170	601628	中国人寿	14,900	422,415.00	0.13
171	601899	紫金矿业	33,900	422,394.00	0.13
172	601985	中国核电	56,300	422,250.00	0.13
173	600104	上汽集团	31,200	422,136.00	0.13
174	000895	双汇发展	15,800	422,018.00	0.13
175	600008	首创环保	156,800	421,792.00	0.13
176	600048	保利发展	42,600	421,740.00	0.13
177	601939	建设银行	64,700	421,197.00	0.13
178	601988	中国银行	105,500	420,945.00	0.13
179	000858	五粮液	3,000	420,930.00	0.13
180	601601	中国太保	17,700	420,906.00	0.13
180	600285	羚锐制药	24,600	420,906.00	0.13
182	601390	中国中铁	74,100	420,888.00	0.13
183	601818	光大银行	145,100	420,790.00	0.13
184	600837	海通证券	44,900	420,713.00	0.13
185	601658	邮储银行	96,700	420,645.00	0.13
186	600276	恒瑞医药	9,300	420,639.00	0.13
187	601319	中国人保	86,900	420,596.00	0.13

188	002475	立讯精密	12,200	420,290.00	0.13
189	601398	工商银行	87,900	420,162.00	0.13
190	603993	洛阳钼业	80,800	420,160.00	0.13
191	600036	招商银行	15,100	420,082.00	0.13
192	601288	农业银行	115,300	419,692.00	0.13
193	601211	国泰君安	28,200	419,616.00	0.13
194	600009	上海机场	12,800	419,584.00	0.13
195	002865	钧达股份	5,400	418,392.00	0.13
196	000568	泸州老窖	2,300	412,666.00	0.13
197	600754	锦江酒店	13,700	409,630.00	0.13
198	603111	康尼机电	73,300	408,281.00	0.12
199	300760	迈瑞医疗	1,400	406,840.00	0.12
200	002687	乔治白	75,600	402,948.00	0.12
201	603989	艾华集团	18,500	398,120.00	0.12
202	002372	伟星新材	27,500	397,925.00	0.12
203	603979	金诚信	10,500	396,480.00	0.12
204	603067	振华股份	38,700	394,353.00	0.12
205	601865	福莱特	14,700	392,490.00	0.12
206	688219	会通股份	35,700	391,629.00	0.12
207	603859	能科科技	10,300	388,619.00	0.12
208	000589	贵州轮胎	63,100	386,172.00	0.12
209	603167	渤海轮渡	43,400	385,392.00	0.12
210	300743	天地数码	27,500	381,700.00	0.12
211	301160	翔楼新材	9,000	380,070.00	0.12
212	603611	诺力股份	19,700	372,921.00	0.11
213	600558	大西洋	90,900	369,963.00	0.11
214	688589	力合微	9,200	367,172.00	0.11
215	600261	阳光照明	112,200	366,894.00	0.11
216	603801	志邦家居	21,800	365,586.00	0.11
217	600582	天地科技	65,500	356,320.00	0.11
218	601989	中国重工	85,400	352,702.00	0.11

219	002393	力生制药	13,300	347,130.00	0.11
220	600900	长江电力	14,800	345,432.00	0.11
221	600519	贵州茅台	200	345,200.00	0.11
222	600483	福能股份	41,700	344,859.00	0.11
223	601888	中国中免	4,100	343,129.00	0.10
224	300708	聚灿光电	30,200	340,656.00	0.10
225	603300	华铁应急	53,000	339,200.00	0.10
226	003012	东鹏控股	41,100	339,075.00	0.10
227	000597	东北制药	63,300	338,655.00	0.10
228	300411	金盾股份	48,300	337,617.00	0.10
229	688398	赛特新材	10,600	334,960.00	0.10
230	600479	千金药业	31,100	334,947.00	0.10
231	688208	道通科技	14,000	332,500.00	0.10
232	603180	金牌厨柜	13,100	328,679.00	0.10
233	603602	纵横通信	22,200	327,228.00	0.10
234	000778	新兴铸管	85,500	326,610.00	0.10
235	002588	史丹利	50,800	324,104.00	0.10
236	603878	武进不锈	42,800	323,140.00	0.10
237	688484	南芯科技	8,100	322,785.00	0.10
238	000888	峨眉山A	35,600	317,908.00	0.10
239	002003	伟星股份	29,300	317,905.00	0.10
240	300441	鲍斯股份	46,000	316,940.00	0.10
241	600262	北方股份	16,300	313,775.00	0.10
242	601006	大秦铁路	43,300	312,193.00	0.10
243	603187	海容冷链	20,500	310,780.00	0.09
244	600612	老凤祥	4,500	310,500.00	0.09
245	002296	辉煌科技	37,100	306,075.00	0.09
246	000768	中航西飞	13,600	304,232.00	0.09
247	002367	康力电梯	40,100	301,552.00	0.09
248	000650	仁和药业	44,900	297,687.00	0.09
249	002449	国星光电	30,900	292,623.00	0.09

250	002478	常宝股份	53,000	288,850.00	0.09
251	600284	浦东建设	45,400	286,020.00	0.09
252	000685	中山公用	39,100	285,821.00	0.09
253	002142	宁波银行	14,100	283,551.00	0.09
254	688626	翔宇医疗	5,300	282,437.00	0.09
255	300882	万胜智能	11,500	280,140.00	0.09
256	600598	北大荒	23,400	280,098.00	0.09
257	600826	兰生股份	31,400	277,576.00	0.08
258	600587	新华医疗	10,700	275,953.00	0.08
259	600623	华谊集团	42,800	275,632.00	0.08
260	002233	塔牌集团	38,900	275,412.00	0.08
261	300059	东方财富	19,600	275,184.00	0.08
262	301043	绿岛风	8,400	274,932.00	0.08
263	688596	正帆科技	6,900	273,447.00	0.08
264	600269	赣粤高速	66,300	272,493.00	0.08
265	603444	吉比特	1,100	269,632.00	0.08
266	600967	内蒙一机	32,500	268,450.00	0.08
267	603112	华翔股份	22,000	267,300.00	0.08
268	301257	普蕊斯	4,200	266,700.00	0.08
269	601811	新华文轩	19,500	266,370.00	0.08
270	002035	华帝股份	42,600	264,546.00	0.08
271	002913	奥士康	8,600	263,590.00	0.08
272	603365	水星家纺	18,300	263,154.00	0.08
273	688503	聚和材料	4,900	262,640.00	0.08
274	000423	东阿阿胶	5,300	261,396.00	0.08
275	300102	乾照光电	35,200	258,720.00	0.08
276	000902	新洋丰	22,700	258,553.00	0.08
277	603516	淳中科技	11,500	258,405.00	0.08
278	600757	长江传媒	34,600	257,770.00	0.08
279	688768	容知日新	7,000	257,670.00	0.08
280	002594	比亚迪	1,300	257,400.00	0.08

281	000612	焦作万方	44,700	257,025.00	0.08
282	002773	康弘药业	13,800	254,472.00	0.08
283	000887	中鼎股份	20,300	251,111.00	0.08
284	601163	三角轮胎	17,400	250,734.00	0.08
285	600649	城投控股	67,700	250,490.00	0.08
286	300566	激智科技	13,400	250,312.00	0.08
287	300621	维业股份	21,700	249,333.00	0.08
288	003000	劲仔食品	20,300	248,066.00	0.08
289	002443	金洲管道	36,200	247,970.00	0.08
290	688080	映翰通	6,100	247,538.00	0.08
291	688571	杭华股份	32,900	246,092.00	0.08
292	300919	中伟股份	5,000	245,650.00	0.08
293	688620	安凯微	20,700	244,674.00	0.07
294	001207	联科科技	14,200	242,110.00	0.07
295	603367	辰欣药业	16,500	241,560.00	0.07
296	603228	景旺电子	10,700	241,392.00	0.07
297	603283	赛腾股份	3,300	239,448.00	0.07
298	601958	金钼股份	25,300	239,085.00	0.07
299	002130	沃尔核材	31,600	238,580.00	0.07
300	603689	皖天然气	27,300	237,237.00	0.07
301	002484	江海股份	14,700	236,082.00	0.07
302	002918	蒙娜丽莎	17,400	235,596.00	0.07
303	688138	清溢光电	10,400	235,248.00	0.07
304	001229	魅视科技	6,600	234,960.00	0.07
305	300535	达威股份	13,400	234,634.00	0.07
306	301323	新莱福	6,300	233,037.00	0.07
307	603368	柳药集团	12,200	230,824.00	0.07
308	000920	沃顿科技	23,200	230,376.00	0.07
309	300843	胜蓝股份	10,000	229,800.00	0.07
310	688689	银河微电	8,200	228,534.00	0.07
311	002410	广联达	13,300	227,962.00	0.07

312	603076	乐惠国际	8,500	227,800.00	0.07
313	300695	兆丰股份	4,300	227,728.00	0.07
314	603507	振江股份	8,700	225,417.00	0.07
315	002558	巨人网络	20,200	225,028.00	0.07
316	688569	铁科轨道	8,100	223,641.00	0.07
317	301239	普瑞眼科	2,600	223,600.00	0.07
318	001338	永顺泰	18,500	223,110.00	0.07
319	002165	红宝丽	52,700	222,921.00	0.07
320	688566	吉贝尔	7,100	222,869.00	0.07
321	300902	国安达	6,300	222,075.00	0.07
322	300752	隆利科技	12,200	221,674.00	0.07
323	603871	嘉友国际	13,900	220,454.00	0.07
323	300845	捷安高科	12,200	220,454.00	0.07
325	002641	公元股份	43,800	220,314.00	0.07
326	603008	喜临门	12,900	219,429.00	0.07
327	601956	东贝集团	36,600	218,502.00	0.07
328	688171	纬德信息	9,700	218,250.00	0.07
329	000544	中原环保	31,400	217,916.00	0.07
330	300870	欧陆通	4,900	216,923.00	0.07
331	002922	伊戈尔	14,600	216,810.00	0.07
332	603096	新经典	11,000	216,480.00	0.07
333	300243	瑞丰高材	22,100	215,917.00	0.07
334	688368	晶丰明源	2,000	215,880.00	0.07
335	688669	聚石化学	11,500	215,510.00	0.07
336	600795	国电电力	51,800	215,488.00	0.07
337	001330	博纳影业	29,700	213,840.00	0.07
338	002083	孚日股份	42,400	213,696.00	0.07
339	301122	采纳股份	6,300	213,318.00	0.07
340	603136	天目湖	11,600	213,092.00	0.07
341	300563	神宇股份	13,300	212,667.00	0.06
342	605288	凯迪股份	4,500	212,040.00	0.06

343	301026	浩通科技	6,900	210,105.00	0.06
344	000811	冰轮环境	15,400	208,978.00	0.06
345	002572	索菲亚	13,100	208,945.00	0.06
346	600737	中粮糖业	25,300	208,472.00	0.06
347	002981	朝阳科技	6,000	208,320.00	0.06
348	300791	仙乐健康	6,000	207,960.00	0.06
349	300992	泰福泵业	9,600	207,168.00	0.06
350	300251	光线传媒	25,400	207,010.00	0.06
351	603556	海兴电力	7,100	206,113.00	0.06
352	300514	友讯达	12,600	205,380.00	0.06
353	300415	伊之密	11,600	204,508.00	0.06
354	301170	锡南科技	6,700	203,881.00	0.06
355	300389	艾比森	11,700	202,878.00	0.06
356	603050	科林电气	11,300	202,835.00	0.06
357	002783	凯龙股份	17,500	202,825.00	0.06
358	002827	高争民爆	12,100	202,675.00	0.06
359	300145	中金环境	67,100	202,642.00	0.06
360	688687	凯因科技	5,800	202,188.00	0.06
361	600845	宝信软件	4,100	200,080.00	0.06
362	002521	齐峰新材	24,100	199,307.00	0.06
363	300476	胜宏科技	10,800	199,260.00	0.06
364	603329	上海雅仕	12,500	199,250.00	0.06
365	603093	南华期货	16,600	199,200.00	0.06
366	002899	英派斯	12,000	198,600.00	0.06
367	601801	皖新传媒	28,500	198,075.00	0.06
368	002737	葵花药业	7,600	197,448.00	0.06
369	603039	泛微网络	4,200	196,980.00	0.06
370	002469	三维化学	32,500	196,950.00	0.06
371	002841	视源股份	4,300	196,768.00	0.06
372	002452	长高电新	27,700	196,670.00	0.06
373	688332	中科蓝讯	2,600	196,092.00	0.06

374	000009	中国宝安	16,700	196,058.00	0.06
375	002970	锐明技术	6,400	195,904.00	0.06
376	301096	百诚医药	3,000	195,300.00	0.06
377	688616	西力科技	14,300	195,052.00	0.06
378	300866	安克创新	2,200	194,920.00	0.06
379	600699	均胜电子	10,800	193,968.00	0.06
380	300194	福安药业	44,100	193,158.00	0.06
381	688531	日联科技	1,900	192,052.00	0.06
382	301503	智迪科技	5,700	191,748.00	0.06
383	001380	华纬科技	5,500	191,620.00	0.06
384	688593	新相微	13,000	191,360.00	0.06
385	601789	宁波建工	46,200	191,268.00	0.06
386	301127	天源环保	17,400	191,226.00	0.06
387	300900	广联航空	7,700	190,036.00	0.06
388	603758	秦安股份	16,600	189,904.00	0.06
389	300908	仲景食品	4,600	189,842.00	0.06
390	301373	凌玮科技	6,400	189,760.00	0.06
391	603319	湘油泵	10,800	189,432.00	0.06
392	002448	中原内配	28,500	189,240.00	0.06
393	688083	中望软件	1,900	189,126.00	0.06
394	002998	优彩资源	23,700	188,415.00	0.06
395	603080	新疆火炬	11,300	188,258.00	0.06
396	002357	富临运业	24,900	187,995.00	0.06
397	603029	天鹅股份	9,200	187,680.00	0.06
398	603788	宁波高发	12,500	186,625.00	0.06
399	002835	同为股份	10,400	186,576.00	0.06
400	600062	华润双鹤	10,000	186,000.00	0.06
401	605116	奥锐特	7,200	185,904.00	0.06
402	603326	我乐家居	19,700	185,771.00	0.06
403	600488	津药药业	37,900	185,710.00	0.06
404	300645	正元智慧	10,200	185,538.00	0.06

405	300440	运达科技	24,900	185,505.00	0.06
406	600158	中体产业	23,800	185,164.00	0.06
407	002595	豪迈科技	6,200	184,574.00	0.06
408	300543	朗科智能	16,900	184,548.00	0.06
409	605066	天正电气	20,100	184,518.00	0.06
410	603886	元祖股份	10,100	184,123.00	0.06
411	301070	开勒股份	4,100	183,926.00	0.06
412	600455	博通股份	7,400	183,890.00	0.06
413	300280	紫天科技	4,300	183,739.00	0.06
414	300562	乐心医疗	16,100	183,701.00	0.06
415	300963	中洲特材	14,000	183,680.00	0.06
416	601139	深圳燃气	26,600	183,274.00	0.06
417	003041	真爱美家	11,000	183,150.00	0.06
418	301277	新天地	8,800	183,128.00	0.06
419	600664	哈药股份	54,500	182,575.00	0.06
420	300319	麦捷科技	18,900	182,196.00	0.06
421	002983	芯瑞达	5,900	182,074.00	0.06
422	300143	盈康生命	17,100	181,773.00	0.06
423	300550	和仁科技	12,100	181,379.00	0.06
424	600977	中国电影	14,800	181,152.00	0.06
425	600368	五洲交通	45,800	180,910.00	0.06
426	002611	东方精工	36,200	179,552.00	0.05
427	603233	大参林	7,200	179,280.00	0.05
428	688651	盛邦安全	3,800	178,828.00	0.05
429	688588	凌志软件	15,000	178,500.00	0.05
430	002782	可立克	12,700	178,435.00	0.05
431	688439	振华风光	2,000	178,220.00	0.05
432	002791	坚朗五金	4,400	178,156.00	0.05
433	301149	隆华新材	14,400	178,128.00	0.05
434	300749	顶固集创	19,200	177,984.00	0.05
435	600959	江苏有线	56,600	177,724.00	0.05

436	002850	科达利	2,100	177,366.00	0.05
437	300985	致远新能	4,700	177,237.00	0.05
438	688239	航宇科技	3,700	176,749.00	0.05
439	300622	博士眼镜	8,900	176,487.00	0.05
440	688592	司南导航	3,400	176,460.00	0.05
441	603897	长城科技	8,600	176,128.00	0.05
442	603617	君禾股份	19,100	175,720.00	0.05
443	605377	华旺科技	9,200	175,628.00	0.05
444	300739	明阳电路	11,400	174,534.00	0.05
445	603833	欧派家居	2,500	174,025.00	0.05
446	300638	广和通	9,100	173,173.00	0.05
447	688003	天准科技	4,600	172,592.00	0.05
448	600637	东方明珠	22,800	171,456.00	0.05
449	600037	歌华有线	22,100	170,833.00	0.05
450	603713	密尔克卫	3,200	170,272.00	0.05
451	600846	同济科技	18,300	170,190.00	0.05
452	002223	鱼跃医疗	4,900	169,442.00	0.05
453	301456	盘古智能	5,500	169,400.00	0.05
454	002243	力合科创	21,300	169,335.00	0.05
455	688218	江苏北人	8,500	168,895.00	0.05
456	688561	奇安信	4,200	168,378.00	0.05
457	000951	中国重汽	12,600	168,336.00	0.05
458	600346	恒力石化	12,700	167,259.00	0.05
459	002048	宁波华翔	12,700	165,227.00	0.05
460	600831	广电网络	31,500	165,060.00	0.05
461	688661	和林微纳	3,600	164,952.00	0.05
462	002111	威海广泰	18,200	164,892.00	0.05
463	002057	中钢天源	20,500	164,820.00	0.05
464	688022	瀚川智能	7,500	164,550.00	0.05
465	688667	菱电电控	2,000	164,080.00	0.05
466	600986	浙文互联	30,000	163,800.00	0.05

467	002787	华源控股	17,800	163,226.00	0.05
468	603258	电魂网络	7,100	163,158.00	0.05
469	688581	安杰思	1,300	162,253.00	0.05
470	600131	国网信通	10,700	162,105.00	0.05
471	603927	中科软	5,400	161,892.00	0.05
472	603279	景津装备	7,300	161,403.00	0.05
473	002085	万丰奥威	32,600	161,044.00	0.05
474	603199	九华旅游	6,200	160,890.00	0.05
475	000090	天健集团	34,700	159,620.00	0.05
476	688115	思林杰	4,600	159,482.00	0.05
477	301051	信濠光电	2,500	159,175.00	0.05
478	603659	璞泰来	7,600	159,068.00	0.05
479	300012	华测检测	11,200	159,040.00	0.05
480	002846	英联股份	14,500	158,775.00	0.05
481	600054	黄山旅游	14,500	157,760.00	0.05
482	603737	三棵树	3,300	157,113.00	0.05
483	688662	富信科技	4,300	156,735.00	0.05
484	300956	英力股份	8,400	156,492.00	0.05
485	002033	丽江股份	19,300	156,137.00	0.05
486	600936	广西广电	42,500	155,975.00	0.05
487	300386	飞天诚信	14,500	155,585.00	0.05
488	688023	安恒信息	1,400	155,246.00	0.05
489	603990	麦迪科技	11,900	153,748.00	0.05
490	688699	明微电子	3,800	153,330.00	0.05
491	603881	数据港	7,700	152,614.00	0.05
492	300025	华星创业	15,900	152,481.00	0.05
493	002971	和远气体	5,500	152,460.00	0.05
494	301178	天亿马	4,700	152,421.00	0.05
495	600225	卓朗科技	40,100	152,380.00	0.05
496	605168	三人行	2,400	152,064.00	0.05
497	603058	永吉股份	16,700	151,469.00	0.05

498	688020	方邦股份	3,100	150,288.00	0.05
499	300349	金卡智能	12,100	150,282.00	0.05
500	688006	杭可科技	6,400	150,272.00	0.05
501	002541	鸿路钢构	6,900	149,937.00	0.05
502	301181	标榜股份	5,300	149,619.00	0.05
503	603687	大胜达	13,000	149,370.00	0.05
504	300662	科锐国际	5,400	149,148.00	0.05
505	002517	恺英网络	13,300	148,561.00	0.05
506	688602	康鹏科技	13,200	148,236.00	0.05
507	603105	芯能科技	12,800	148,224.00	0.05
508	688365	光云科技	13,600	148,104.00	0.05
509	002283	天润工业	25,300	148,005.00	0.05
510	600643	爱建集团	29,000	147,900.00	0.05
511	301029	怡合达	5,700	146,946.00	0.04
512	300940	南极光	7,600	146,528.00	0.04
513	000026	飞亚达	13,300	145,768.00	0.04
514	300998	宁波方正	6,300	145,404.00	0.04
515	301162	国能日新	2,800	145,264.00	0.04
516	600215	派斯林	17,000	145,180.00	0.04
517	603486	科沃斯	3,500	145,040.00	0.04
518	300819	聚杰微纤	9,300	144,615.00	0.04
519	688066	航天宏图	3,400	143,616.00	0.04
520	688031	星环科技	2,200	143,154.00	0.04
521	300286	安科瑞	5,500	142,615.00	0.04
522	688486	龙迅股份	1,200	142,524.00	0.04
523	688392	骄成超声	1,700	141,797.00	0.04
524	600611	大众交通	47,400	141,252.00	0.04
525	600446	金证股份	12,200	141,154.00	0.04
526	688499	利元亨	3,700	140,896.00	0.04
527	300795	米奥会展	3,800	140,106.00	0.04
528	300627	华测导航	4,500	139,590.00	0.04

529	600345	长江通信	7,200	139,464.00	0.04
530	001322	箭牌家居	11,700	138,762.00	0.04
531	688258	卓易信息	2,800	138,600.00	0.04
532	688515	裕太微	1,400	138,334.00	0.04
533	002135	东南网架	23,900	138,142.00	0.04
534	000652	泰达股份	35,400	137,706.00	0.04
535	600237	铜峰电子	17,700	136,998.00	0.04
536	688711	宏微科技	3,300	136,917.00	0.04
537	688358	祥生医疗	3,600	136,008.00	0.04
538	603203	快克智能	4,700	135,877.00	0.04
539	002277	友阿股份	33,700	135,811.00	0.04
540	688516	奥特维	1,500	135,750.00	0.04
541	688159	有方科技	3,600	135,540.00	0.04
542	688416	恒烁股份	2,300	134,757.00	0.04
543	605068	明新旭腾	6,000	134,640.00	0.04
544	002912	中新赛克	4,800	134,352.00	0.04
545	688371	菲沃泰	7,600	133,836.00	0.04
546	688627	精智达	1,500	133,770.00	0.04
547	603690	至纯科技	5,200	133,640.00	0.04
548	688570	天玛智控	4,900	133,329.00	0.04
549	600880	博瑞传播	26,600	133,266.00	0.04
550	600827	百联股份	14,000	132,860.00	0.04
551	605376	博迁新材	4,700	132,540.00	0.04
552	000089	深圳机场	20,600	132,458.00	0.04
553	300211	亿通科技	13,100	132,441.00	0.04
554	002969	嘉美包装	32,100	132,252.00	0.04
555	603125	常青科技	4,400	132,088.00	0.04
556	688099	晶晨股份	2,100	131,523.00	0.04
557	301302	华如科技	5,200	130,572.00	0.04
558	688232	新点软件	3,600	130,320.00	0.04
559	002131	利欧股份	56,900	129,732.00	0.04

560	600563	法拉电子	1,400	129,640.00	0.04
561	688249	晶合集成	7,500	129,375.00	0.04
562	600655	豫园股份	20,800	129,168.00	0.04
563	000883	湖北能源	30,500	129,015.00	0.04
564	688568	中科星图	2,600	127,556.00	0.04
565	300766	每日互动	8,200	126,526.00	0.04
566	000928	中钢国际	21,700	126,511.00	0.04
567	300384	三联虹普	7,900	126,084.00	0.04
568	600663	陆家嘴	14,400	126,000.00	0.04
568	300113	顺网科技	9,000	126,000.00	0.04
570	002112	三变科技	12,000	125,760.00	0.04
571	688095	福昕软件	1,800	125,730.00	0.04
572	600848	上海临港	12,500	125,625.00	0.04
573	688229	博睿数据	2,600	124,982.00	0.04
574	600859	王府井	7,800	124,566.00	0.04
575	002624	完美世界	10,500	124,320.00	0.04
576	688697	纽威数控	6,600	124,278.00	0.04
577	300706	阿石创	4,800	124,224.00	0.04
578	002080	中材科技	7,800	124,176.00	0.04
579	603122	合富中国	15,400	123,970.00	0.04
580	603899	晨光股份	3,300	123,915.00	0.04
581	000030	富奥股份	23,200	123,888.00	0.04
582	688018	乐鑫科技	1,200	123,540.00	0.04
583	688121	卓然股份	6,100	123,403.00	0.04
584	300454	深信服	1,700	122,893.00	0.04
585	301515	港通医疗	4,264	122,035.68	0.04
586	688293	奥浦迈	2,200	121,374.00	0.04
587	688419	耐科装备	3,400	120,870.00	0.04
588	600496	精工钢构	39,300	119,865.00	0.04
589	300137	先河环保	21,100	117,316.00	0.04
590	002226	江南化工	25,700	112,566.00	0.03

591	600958	东方证券	12,800	111,360.00	0.03
592	601766	中国中车	20,800	109,408.00	0.03
593	600323	瀚蓝环境	6,300	109,179.00	0.03
594	603896	寿仙谷	3,200	103,168.00	0.03
595	600529	山东药玻	3,800	97,280.00	0.03
596	601991	大唐发电	39,500	95,590.00	0.03
597	600692	亚通股份	14,600	90,958.00	0.03
598	002722	物产金轮	5,900	90,919.00	0.03
599	000973	佛塑科技	18,400	89,976.00	0.03
600	002179	中航光电	2,300	89,700.00	0.03
601	002365	永安药业	9,000	88,020.00	0.03
602	603060	国检集团	10,300	86,520.00	0.03
603	002299	圣农发展	4,500	77,310.00	0.02
604	002320	海峡股份	12,900	75,207.00	0.02
605	600798	宁波海运	20,200	73,932.00	0.02
606	002673	西部证券	11,500	73,255.00	0.02
607	600020	中原高速	19,900	73,232.00	0.02
608	300146	汤臣倍健	4,300	73,229.00	0.02
609	600628	新世界	10,400	72,904.00	0.02
610	600135	乐凯胶片	9,000	72,630.00	0.02
611	002396	星网锐捷	4,000	72,280.00	0.02
612	300926	博俊科技	1,900	55,727.00	0.02

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600998	九州通	37,208,690.57	7.90
2	601669	中国电建	25,128,427.13	5.34

3	300274	阳光电源	23,203,755.83	4.93
4	600027	华电国际	22,412,428.87	4.76
5	000538	云南白药	20,962,410.47	4.45
6	600755	厦门国贸	20,825,234.00	4.42
7	600971	恒源煤电	20,005,234.00	4.25
8	600398	海澜之家	18,816,832.00	4.00
9	300433	蓝思科技	15,968,892.00	3.39
10	300896	爱美客	15,764,865.00	3.35
11	300207	欣旺达	15,345,411.00	3.26
12	600985	淮北矿业	15,259,355.00	3.24
13	600566	济川药业	14,842,692.00	3.15
14	601668	中国建筑	14,333,765.00	3.04
15	300316	晶盛机电	14,237,936.06	3.02
16	600846	同济科技	14,197,051.40	3.02
17	600886	国投电力	14,187,097.00	3.01
18	300142	沃森生物	14,176,544.00	3.01
19	600582	天地科技	13,602,136.70	2.89
20	000895	双汇发展	13,378,371.00	2.84
21	300750	宁德时代	13,094,447.00	2.78
22	000157	中联重科	13,078,711.00	2.78
23	000921	海信家电	12,997,587.00	2.76
24	300015	爱尔眼科	12,988,236.27	2.76
25	300450	先导智能	12,899,141.04	2.74
26	600048	保利发展	12,714,094.00	2.70
27	000338	潍柴动力	11,700,472.00	2.49
28	600066	宇通客车	11,590,922.38	2.46
29	688009	中国通号	11,583,809.66	2.46
30	600820	隧道股份	11,419,737.00	2.43
31	601319	中国人保	11,325,042.00	2.41
32	600710	苏美达	11,175,718.60	2.37
33	600598	北大荒	11,138,720.00	2.37

34	601186	中国铁建	11,116,626.00	2.36
35	600704	物产中大	10,928,631.28	2.32
36	601006	大秦铁路	10,596,930.00	2.25
37	601098	中南传媒	10,521,594.76	2.24
38	300413	芒果超媒	10,380,364.00	2.21
39	300349	金卡智能	10,333,281.00	2.20
40	002299	圣农发展	9,816,807.00	2.09
41	300454	深信服	9,810,741.00	2.08
42	300957	贝泰妮	9,720,275.81	2.06
43	600926	杭州银行	9,697,192.00	2.06
44	300999	金龙鱼	9,678,840.00	2.06
45	600919	江苏银行	9,565,781.00	2.03
46	600153	建发股份	9,554,749.00	2.03
47	600761	安徽合力	9,489,576.00	2.02

#### 8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600998	九州通	37,297,644.32	7.92
2	601669	中国电建	26,638,333.64	5.66
3	600971	恒源煤电	25,620,021.00	5.44
4	600027	华电国际	23,870,162.93	5.07
5	300274	阳光电源	22,665,111.78	4.81
6	600755	厦门国贸	22,065,212.62	4.69
7	600398	海澜之家	20,197,082.00	4.29
8	000538	云南白药	19,682,785.80	4.18
9	600886	国投电力	18,470,640.60	3.92
10	000895	双汇发展	17,316,225.10	3.68
11	000921	海信家电	17,057,842.24	3.62

12	600846	同济科技	16,883,865.78	3.59
13	600985	淮北矿业	16,432,299.43	3.49
14	300433	蓝思科技	15,790,875.00	3.35
15	300207	欣旺达	15,678,567.70	3.33
16	601668	中国建筑	15,154,219.60	3.22
17	300896	爱美客	15,038,921.91	3.19
18	600566	济川药业	14,840,610.85	3.15
19	600820	隧道股份	14,432,890.53	3.07
20	300316	晶盛机电	14,082,505.90	2.99
21	300750	宁德时代	13,953,272.80	2.96
22	600048	保利发展	13,749,781.00	2.92
23	000157	中联重科	13,281,813.00	2.82
24	300142	沃森生物	13,275,737.42	2.82
25	600582	天地科技	13,267,649.50	2.82
26	600039	四川路桥	13,176,273.40	2.80
27	300450	先导智能	13,088,146.47	2.78
28	002299	圣农发展	12,596,739.00	2.68
29	600704	物产中大	12,385,541.28	2.63
30	601098	中南传媒	12,166,993.01	2.58
31	601766	中国中车	12,095,425.31	2.57
32	601006	大秦铁路	12,066,299.39	2.56
33	688009	中国通号	12,002,565.73	2.55
34	300015	爱尔眼科	11,764,189.94	2.50
35	601319	中国人保	11,592,411.00	2.46
36	600373	中文传媒	11,592,338.00	2.46
37	600057	厦门象屿	11,499,008.00	2.44
38	300418	昆仑万维	10,943,880.70	2.32
39	300413	芒果超媒	10,863,476.88	2.31
40	600598	北大荒	10,813,586.00	2.30
41	600066	宇通客车	10,763,757.38	2.29
42	601186	中国铁建	10,739,443.00	2.28

43	600710	苏美达	10,641,761.24	2.26
44	601088	中国神华	10,429,452.00	2.22
45	000338	潍柴动力	10,407,739.53	2.21
46	300349	金卡智能	10,245,399.00	2.18
47	600028	中国石化	10,222,114.00	2.17
48	600919	江苏银行	10,126,895.00	2.15
49	600188	兖矿能源	10,092,652.50	2.14
50	600761	安徽合力	9,943,823.00	2.11
51	601601	中国太保	9,634,744.00	2.05
52	600282	南钢股份	9,447,137.89	2.01
53	600170	上海建工	9,424,103.00	2.00

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	3,458,112,631.69
卖出股票收入（成交）总额	3,521,752,529.82

### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
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)	254,285.79	0.08
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	254,285.79	0.08

### 8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	118044	赛特转债	1,280	155,622.52	0.05
2	118045	盟升转债	600	91,061.79	0.03
3	111017	蓝天转债	60	7,601.48	0.00

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无余额。

### 8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无余额。

### 8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无余额。

### 8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，综合考虑股指期货不同合约之间的价差关系、流动性等因素，在各股指期货合约之间进行动态配置和临近到期合约的展期操作，以提升组合收益和套期保值的效果。

### 8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

无。

### 8.12 投资组合报告附注

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

8.12.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,008.95
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,008.95

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无余额。

#### 8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无余额。

#### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

### §9 基金份额持有人信息

#### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持有 人户 数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
中信 建投 量化 精选6 个月	2,690	56,072.68	0.00	0.00%	150,835,495.95	100.00%

持有期混合A						
中信建投量化精选6个月持有期混合C	4,360	66,310.98	4,200,016.00	1.4527%	284,915,857.33	98.5473%
合计	6,941	63,384.44	4,200,016.00	0.9547%	435,751,353.28	99.0453%

## 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额 比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	中信建投量化精选6个月持有期混合A	299,503.11	0.1986%
	中信建投量化精选6个月持有期混合C	141,021.10	0.0488%
	合计	440,524.21	0.1001%

## 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	中信建投量化精选6个月持有期混合A	10~50
	中信建投量化精选6个月持有期混合C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	中信建投量化精选6个月持有期混合A	0
	中信建投量化精选6个月持有期混合C	0

	有期混合C	
	合计	0

## §10 开放式基金份额变动

单位：份

	中信建投量化精选6个月持有期混合A	中信建投量化精选6个月持有期混合C
基金合同生效日(2021年07月27日)基金份额总额	242,486,586.62	540,134,151.70
本报告期期初基金份额总额	201,708,270.95	399,354,513.74
本报告期基金总申购份额	729,424.92	1,643,315.31
减：本报告期基金总赎回份额	51,602,199.92	111,881,955.72
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	150,835,495.95	289,115,873.33

## §11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，高翔先生于2023年1月12日离任基金管理人副总经理、首席信息官，王欢女士于2023年3月31日起担任基金管理人财务负责人，张欣宇先生于2023年7月20日起担任基金管理人首席信息官；

本报告期内，基金管理人因第三届董事会任期届满，第四届董事会成员调整变动，基金管理人的董事在2023年3月的最近12个月内变更超过百分之五十。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

## 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内应支付普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用50,000.00元整，该审计机构自2021年7月27日（基金合同生效日）起为本基金提供审计服务。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华创证券（券商柜台）	2	6,978,568,755.38	100.00%	3,707,817.26	100.00%	-

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

（1）证券经纪商的选择由公司权益投资相关部门负责人根据证券经纪商投资研究服务综合评价，作出交易单元开设或撤销的相关决定。经公司分管领导通过后，方可办理相关的交易单元开设或撤销事宜。

（2）权益投资相关部门每季度组织相关部门完成对各往来证券经纪商的研究服务评估。权益投资相关部门根据评估结果调整确定个别证券经纪商的交易金额及比率限制的参考。

(3) 评估实行评分制，具体如下：

分配权重（100分）=基础研究服务（70%）+综合研究服务（20%）+专项研究服务（10%）。基础研究服务占70%权重和综合研究服务占20%权重，由权益投资相关部门组织投研条线相关人员进行打分；专项研究服务占10%权重，由系统跟踪股票涨跌幅后生成得分。

2、根据以上标准进行考察后，基金管理人确定券商，与被选择的券商签订委托协议，并报中国证监会备案及通知基金托管人。

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
华创证券（券商柜台）	537,332.88	100.00%	-	-	-	-	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中信建投基金管理有限公司高级管理人员变更公告	规定网站、规定报刊	2023-01-13
2	中信建投基金管理有限公司旗下部分基金2022年第4季度报告提示性公告	规定报刊	2023-01-20
3	中信建投量化精选6个月持有期混合型证券投资基金2022年第4季度报告	规定网站	2023-01-20
4	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分基金投资关联方承销证券的公告	规定网站、规定报刊	2023-01-21
5	中信建投基金管理有限公司	规定网站、规定报刊	2023-02-03

	关于旗下部分基金投资关联方承销证券的公告		
6	中信建投量化精选6个月持有期混合型证券投资基金招募说明书（更新）	规定网站	2023-02-08
7	中信建投量化精选6个月持有期混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	规定网站	2023-02-08
8	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加深圳众禄基金销售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	2023-02-22
9	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分基金投资关联方承销证券的公告	规定网站、规定报刊	2023-02-25
10	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金在中信建投证券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	2023-03-17
11	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加华宝证券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	2023-03-23
12	中信建投基金管理有限公司董事变更公告	规定网站、规定报刊	2023-03-30
13	中信建投基金管理有限公司旗下部分基金2022年年度报告提示性公告	规定报刊	2023-03-31
14	中信建投量化精选6个月持有期混合型证券投资基金20	规定网站	2023-03-31

	22年年度报告		
15	中信建投基金管理有限公司高级管理人员变更公告	规定网站、规定报刊	2023-04-01
16	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加东方财富证券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	2023-04-12
17	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金在中信建投证券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	2023-04-13
18	中信建投基金管理有限公司旗下部分基金2023年第1季度报告提示性公告	规定报刊	2023-04-21
19	中信建投量化精选6个月持有期混合型证券投资基金2023年第1季度报告	规定网站	2023-04-21
20	中信建投基金管理有限公司关于提请投资者完善税收居民身份信息信息的公告	规定网站	2023-05-10
21	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加玄元保险代理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	2023-05-23
22	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金在中信建投证券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	2023-06-30
23	中信建投基金管理有限公司旗下全部基金2023年第2季度报告提示性公告	规定报刊	2023-07-21

24	中信建投量化精选6个月持有期混合型证券投资基金2023年第2季度报告	规定网站	2023-07-21
25	中信建投基金管理有限公司高级管理人员变更公告	规定网站、规定报刊	2023-07-21
26	中信建投基金管理有限公司关于增加注册资本的公告	规定网站	2023-07-28
27	中信建投基金管理有限公司关于子公司名称及法定代表人变更的公告	规定网站	2023-07-28
28	中信建投基金管理有限公司关于调低旗下部分基金费率并修订基金合同的公告	规定网站、规定报刊	2023-08-26
29	中信建投量化精选6个月持有期混合型证券投资基金基金合同	规定网站	2023-08-26
30	中信建投量化精选7个月持有期混合型证券投资基金托管协议	规定网站	2023-08-26
31	中信建投量化精选6个月持有期混合型证券投资基金招募说明书（更新）	规定网站	2023-08-31
32	中信建投量化精选7个月持有期混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	规定网站	2023-08-31
33	中信建投基金管理有限公司旗下全部基金2023年中期报告提示性公告	规定报刊	2023-08-31
34	中信建投量化精选6个月持有期混合型证券投资基金2023年中期报告	规定网站	2023-08-31
35	中信建投基金管理有限公司旗下部分基金2023年第3季	规定报刊	2023-10-25

	度报告提示性公告		
36	中信建投量化精选6个月持有期混合型证券投资基金2023年第3季度报告	规定网站	2023-10-25

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本报告期内，未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，无影响投资者决策的其他重要信息。

## §13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金注册的文件；
- 2、《中信建投量化精选6个月持有期混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《中信建投量化精选6个月持有期混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照。

### 13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

### 13.3 查阅方式

投资者可以在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

中信建投基金管理有限公司  
二〇二四年三月二十九日