

中信建投量化进取 6 个月持有期混合型证券投资基金

2021 年年度报告

2021 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:2022 年 03 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年3月29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2021年3月9日（基金合同生效日）起至12月31日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	11
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	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	15
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	22
7.4 报表附注	23
§8 投资组合报告	57
8.1 期末基金资产组合情况	57
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	58
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	59
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	72
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	89
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	89
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	90
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	90
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	90
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	90

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	90
8.12 投资组合报告附注.....	90
§9 基金份额持有人信息.....	91
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	91
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	91
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.....	92
§10 开放式基金份额变动.....	92
§11 重大事件揭示.....	92
11.1 基金份额持有人大会决议.....	92
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.....	92
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	93
11.4 基金投资策略的改变.....	93
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	93
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.....	93
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	93
11.8 其他重大事件.....	94
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	101
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.....	101
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	101
§13 备查文件目录.....	101
13.1 备查文件目录.....	101
13.2 存放地点.....	101
13.3 查阅方式.....	101

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中信建投量化进取6个月持有期混合型证券投资基金	
基金简称	中信建投量化进取	
基金主代码	011410	
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03月09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	1,049,588,509.43份	
基金合同存续期	不定期	
下属各类别基金的基金简称	中信建投量化进取A	中信建投量化进取C
下属各类别基金的交易代码	011410	011411
报告期末下属各类别基金的份额总额	789,713,905.85份	259,874,603.58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	中证500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	姜敏
	联系电话	010-59100208	4006800000
	电子邮箱	zhuweibj@csc.com.cn	jiangmin@citicbank.com
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	朱鹤新

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	本期2021年03月09日（基金合同生效日）－ 2021年12月31日	
	中信建投量化进取A	中信建投量化进取C
本期已实现收益	110,878,184.25	46,231,618.42
本期利润	111,137,581.28	49,144,732.14
加权平均基金份额本期利润	0.1174	0.1321
本期加权平均净值利润率	11.04%	12.46%
本期基金份额净值增长率	9.81%	9.46%
3.1.2 期末数据和指标	2021年末	
期末可供分配利润	77,506,016.62	24,577,665.14
期末可供分配基金份额利润	0.0981	0.0946
期末基金资产净值	867,219,922.47	284,452,268.72
期末基金份额净值	1.0981	1.0946
3.1.3 累计期末指标	2021年末	
基金份额累计净值增长率	9.81%	9.46%

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

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

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

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

中信建投量化进取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	0.90%	0.92%	3.16%	0.60%	-2.26%	0.32%
过去六个月	2.91%	1.15%	7.15%	0.77%	-4.24%	0.38%
自基金合同 生效起至今	9.81%	0.94%	15.07%	0.73%	-5.26%	0.21%

中信建投量化进取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	0.80%	0.92%	3.16%	0.60%	-2.36%	0.32%
过去六个月	2.70%	1.15%	7.15%	0.77%	-4.45%	0.38%
自基金合同 生效起至今	9.46%	0.94%	15.07%	0.73%	-5.61%	0.21%

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

中信建投量化进取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03月09日-2021年12月31日)



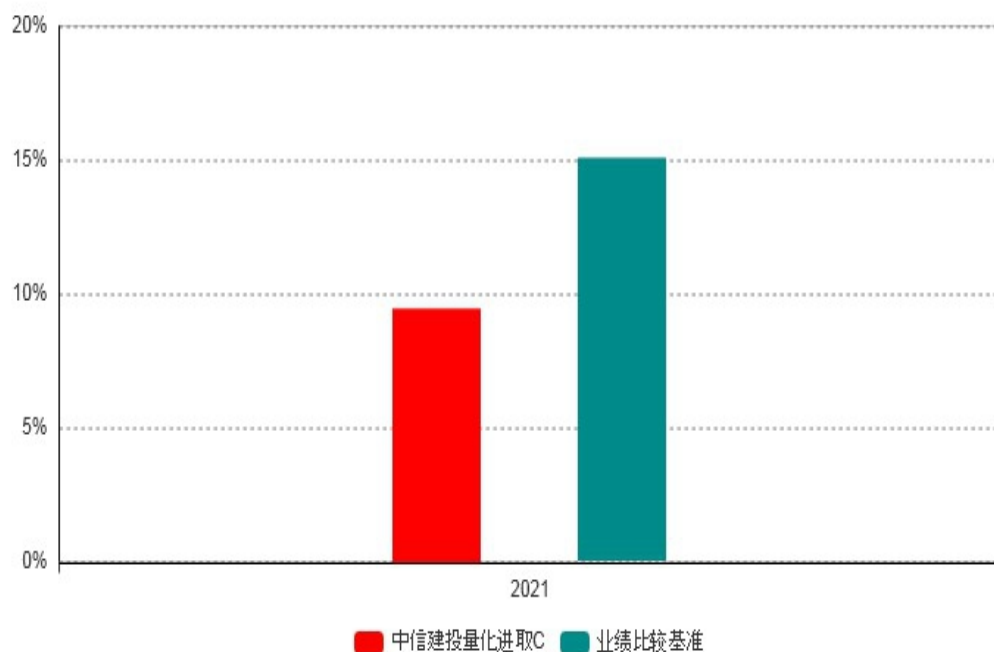
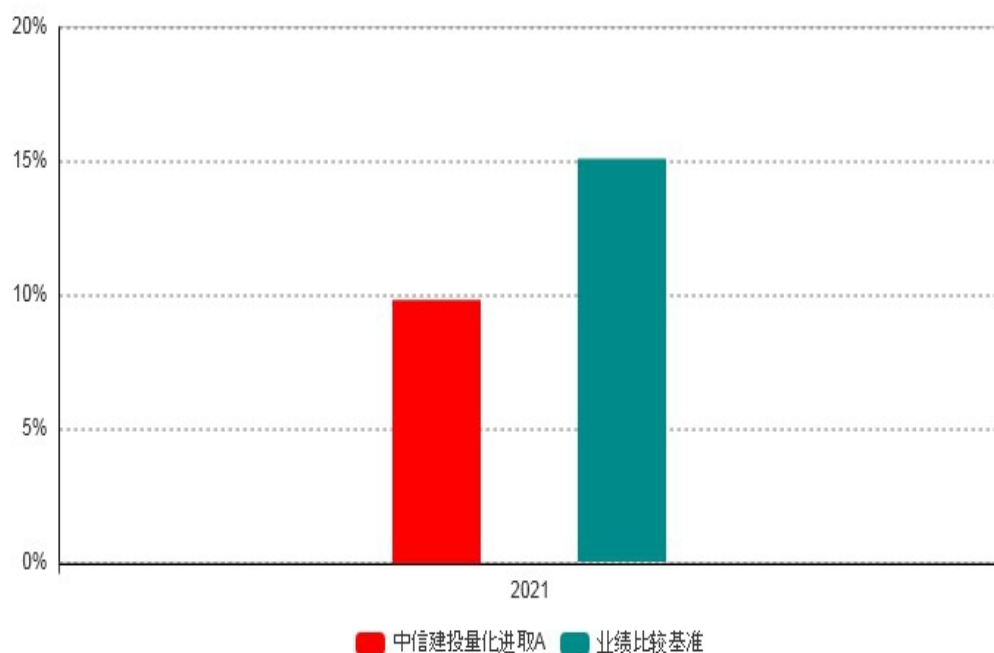
中信建投量化进取C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2021年03月09日-2021年12月31日)



注：1、本基金基金合同生效于 2021 年 3 月 9 日，截至报告期末本基金基金合同生效未
满一年。

2、根据本基金基金合同的约定，本基金自基金合同生效之日起 6 个月为建仓期，建仓
期结束后本基金的投资组合比例符合基金合同的相关约定。

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日在北京注册成立，注册资本3亿元，主要经营基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务。中信建投基金全资子公司元达信资本管理（北京）有限公司于2015年6月8日成立，主要经营特定客户资产管理业务和中国证监会许可的其他业务。

中信建投基金积极回归公募基金业务本源，加强投研体系建设，注重核心投资人才的积累、培养，公司主动投资管理能力大幅提升。同时，中信建投基金加强客户体系建设、积极拓展渠道，加大了与国有大行、股份制银行及证券公司的合作力度。公司各项业务有序开展，为进一步发展奠定了良好的基础。

中信建投基金作为资产管理公司，秉承“忠于信，健于投”，追求以稳健的投资，回馈客户的信任；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	2021-03-09	-	6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、CIB C 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基金经理。
--	--	--	--	--	---

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

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《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，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金持有人利益。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

今年上半年，随着增量入场资金，一致性上涨预期驱动大量博弈资金入场，博弈性资金退潮导致市场结构性波动有所加大，机构重仓股票在年初经历了大幅回撤。进入到二季度，随着市场对流动性及通胀预期变的乐观，市场总体走势为震荡上行。本产品于三月上旬成立，我们根据量化择时信号，于二季度市场上行之时进行了建仓。进入到三季度，通胀预期持续升温，海外股市波动增大，海外地缘冲突加剧，国内散发疫情增多叠加春节效应导致多方信心不足。

本基金所采用的量化模型在报告期内整体表现稳健，我们在依据量化模型进行股票投资决策之外，还积极参与了科创板、创业板新股申购，获取较为确定性的收益增厚机会。

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进取A基金份额净值为1.0981元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为9.81%，同期业绩比较基准收益率为15.07%；截至报告期末中信建投量化进取C基金份额净值为1.0946元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为9.46%，同期业绩比较基准收益率为15.07%。

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2022年，我国经济中长期稳中向好的趋势没有变，各项稳增长政策措施渐次落地，货币财政等宏观政策还有很大空间，近期央行加大公开市场操作力度，市场流动性较为宽裕。经过近几年全面深化资本市场改革，A股市场内在结构已发生深刻变化，经过年前的持续大跌，估值水平已较为合理，赛道风险逐步释放，随着各大机构开始自购，稳增长带动的春季行情预计将逐步开启，持续调整的可能性不大，市场向下的空间有限。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金本报告期末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，中信银行股份有限公司（以下称“本托管人”）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，对中信建投量化进取6个月持有期混合型证券投资基金（以下称“本基金”）2021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进取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。

报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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2021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(2022)第23043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	中信建投量化进取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进取6个月持有期混合型证券投资基金(以下简称“中信建投量化进取基金”)的财务报表,包括2021年12月31日的资产负债表,2021年3月9日(基金合同生效日)至2021年12月31日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。 (二) 我们的意见 我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中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进取基金2021年12月31日的财务状况以及2021年3月9日(基金合同生效日)至2021年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。 按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于中信建投量化进取基金,并履行了职业道德方面的其他责任。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	中信建投量化进取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”)管理层对其他信息负责。其他信息包括中信建投量化进取基金2021年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结

	论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。基于我们已经执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	中信建投量化进取基金的基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估中信建投量化进取基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算中信建投量化进取基金、终止运营或别无其他现实的选择。 基金管理人治理层负责监督中信建投量化进取基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： (一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报

	表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 （二）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 （三）评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 （四）对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对中信建投量化进取基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而未来的事项或情况可能导致中信建投量化进取基金不能持续经营。 （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。 我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	薛竞	郭蕙心
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	2022-03-29	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：中信建投量化进取6个月持有期混合型证券投资基金

报告截止日：2021年12月31日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2021年12月31日
资 产：		
银行存款	7.4.7.1	73,885,900.98
结算备付金		1,220,222.79
存出保证金		—
交易性金融资产	7.4.7.2	1,087,003,391.23
其中：股票投资		1,087,003,391.23
基金投资		—
债券投资		—
资产支持证券投资		—
贵金属投资		—
衍生金融资产	7.4.7.3	—
买入返售金融资产	7.4.7.4	—
应收证券清算款		—
应收利息	7.4.7.5	11,004.93
应收股利		—
应收申购款		332,890.38
递延所得税资产		—
其他资产	7.4.7.6	—
资产总计		1,162,453,410.31
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年12月31日
负 债：		
短期借款		—

交易性金融负债		—
衍生金融负债	7.4.7.3	—
卖出回购金融资产款		—
应付证券清算款		—
应付赎回款		8,829,155.42
应付管理人报酬		1,518,412.34
应付托管费		253,068.71
应付销售服务费		100,582.65
应付交易费用	7.4.7.7	—
应交税费		—
应付利息		—
应付利润		—
递延所得税负债		—
其他负债	7.4.7.8	80,000.00
负债合计		10,781,219.12
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	1,049,588,509.43
未分配利润	7.4.7.10	102,083,681.76
所有者权益合计		1,151,672,191.19
负债和所有者权益总计		1,162,453,410.31

注：1、报告截止日2021年12月31日，基金份额总额1,049,588,509.43份，其中A类基金份额净值1.0981元，基金份额789,713,905.85份；C类基金份额净值1.0946元，基金份额259,874,603.58份。

2、本财务报表的实际编制期间为2021年3月9日（基金合同生效日）至2021年12月31日止期间。

7.2 利润表

会计主体：中信建投量化进取6个月持有期混合型证券投资基金

本报告期：2021年03月09日（基金合同生效日）至2021年12月31日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021年03月09日（基金合同
-----	-----	------------------------

		生效日) 至2021年12月31 日
一、收入		221, 240, 848. 89
1. 利息收入		1, 944, 710. 01
其中：存款利息收入	7. 4. 7. 11	1, 944, 710. 01
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		-
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		216, 123, 628. 13
其中：股票投资收益	7. 4. 7. 12	204, 335, 562. 17
基金投资收益		-
债券投资收益	7. 4. 7. 13	-
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	7. 4. 7. 14	-
股利收益	7. 4. 7. 15	11, 788, 065. 96
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7. 4. 7. 16	3, 172, 510. 75
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7. 4. 7. 17	-
减：二、费用		60, 958, 535. 47
1. 管理人报酬	7. 4. 10. 2. 1	17, 083, 366. 53
2. 托管费	7. 4. 10. 2. 2	2, 847, 227. 78
3. 销售服务费	7. 4. 10. 2. 3	1, 281, 454. 76
4. 交易费用	7. 4. 7. 18	39, 561, 828. 11
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		-
7. 其他费用	7. 4. 7. 19	184, 658. 29

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		160,282,313.42
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		160,282,313.42

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：中信建投量化进取6个月持有期混合型证券投资基金

本报告期：2021年03月09日（基金合同生效日）至2021年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2021年03月09日（基金合同生效日）至2021年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	1,301,115,484.97	-	1,301,115,484.97
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	160,282,313.42	160,282,313.42
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-251,526,975.54	-58,198,631.66	-309,725,607.20
其中：1. 基金申购款	489,613,247.16	52,549,194.71	542,162,441.87
2. 基金赎回款	-741,140,222.70	-110,747,826.37	-851,888,049.07
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权	1,049,588,509.43	102,083,681.76	1,151,672,191.19

益（基金净值）			
---------	--	--	--

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

黄凌

谭淼

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

中信建投量化进取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〕127号《关于准予中信建投量化进取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《中信建投量化进取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。本基金的运作方式为契约型开放式、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1,300,908,856.52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0262号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《中信建投量化进取6个月持有期混合型证券投资基金基金合同》于2021年3月9日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为1,301,115,484.97份基金份额，其中认购资金利息折合206,628.45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《中信建投量化进取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、申购费用而不收取销售服务费，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不收取认购、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。本基金A类基金份额和C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中信建投量化进取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（含中小板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、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、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。本基金的业绩比较基准为:中证500指数收益率*80%+中证综合债指数收益率*20%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、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》、《中信建投量化进取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2021年3月9日(基金合同生效日)至2021年12月31日止期间财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2021年12月31日的财务状况以及2021年3月9日(基金合同生效日)至2021年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2021年3月9日(基金合同生效日)至2021年12月31日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

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

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

(2) 金融负债的分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、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基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本

基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

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2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、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。

(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。

(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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日
活期存款	18,244,696.26
定期存款	-
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	55,641,204.72
合计	73,885,900.98

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2021年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		1,083,830,880.48	1,087,003,391.23	3,172,510.75
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	1,083,830,880.48	1,087,003,391.23	3,172,510.75
----	------------------	------------------	--------------

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日
应收活期存款利息	4,685.28
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	5,612.26
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	-
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	5.97
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	701.42
合计	11,004.93

7.4.7.6 其他资产

无余额。

7.4.7.7 应付交易费用

无余额。

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021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	-
预提费用	80,000.00
合计	80,000.00

7.4.7.9 实收基金

7.4.7.9.1 中信建投量化进取A

金额单位：人民币元

项目 (中信建投量化进取A)	本期 2021年03月09日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	927,254,063.16	927,254,063.16
本期申购	368,143,285.10	368,143,285.10
本期赎回（以“-”号填列）	-505,683,442.41	-505,683,442.41
本期末	789,713,905.85	789,713,905.85

7.4.7.9.2 中信建投量化进取C

金额单位：人民币元

项目 (中信建投量化进取C)	本期 2021年03月09日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	373,861,421.81	373,861,421.81

本期申购	121,469,962.06	121,469,962.06
本期赎回（以“-”号填列）	-235,456,780.29	-235,456,780.29
本期末	259,874,603.58	259,874,603.58

注：1、本基金自2021年2月22日至2021年3月5日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币1,300,908,856.52元，折合为1,300,908,856.52份基金份额（其中A类基金份额927,095,708.11份，C类基金份额373,813,148.41份）。根据《中信建投量化进取6个月持有期混合型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币206,628.45元，在本基金成立后，折合为206,628.45份基金份额（其中A类基金份额158,355.05份，C类基金份额48,273.40份），划入基金份额持有人账户。

2、根据《中信建投量化进取6个月持有期混合型证券投资基金基金合同》、《中信建投量化进取6个月持有期混合型证券投资基金招募说明书》及《中信建投量化进取6个月持有期混合型证券投资基金开放日常申购业务公告》的相关规定，本基金于2021年3月9日（基金合同生效日）至2021年3月24日止期间暂不向投资人开放，基金交易申购业务自2021年3月25日起开始办理。

7.4.7.10 未分配利润

7.4.7.10.1 中信建投量化进取A

单位：人民币元

项目 (中信建投量化进取A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	110,878,184.25	259,397.03	111,137,581.28
本期基金份额交易产生的变动数	-26,693,171.83	-6,938,392.83	-33,631,564.66
其中：基金申购款	35,667,204.64	7,253,556.54	42,920,761.18
基金赎回款	-62,360,376.47	-14,191,949.37	-76,552,325.84
本期已分配利润	-	-	-
本期末	84,185,012.42	-6,678,995.80	77,506,016.62

7.4.7.10.2 中信建投量化进取C

单位：人民币元

项目 (中信建投量化进取C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计

基金合同生效日	-	-	-
本期利润	46,231,618.42	2,913,113.72	49,144,732.14
本期基金份额交易产生的变动数	-19,462,914.38	-5,104,152.62	-24,567,067.00
其中：基金申购款	8,599,269.78	1,029,163.75	9,628,433.53
基金赎回款	-28,062,184.16	-6,133,316.37	-34,195,500.53
本期已分配利润	-	-	-
本期末	26,768,704.04	-2,191,038.90	24,577,665.14

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年03月09日（基金合同生效日）至2021年12月31日
活期存款利息收入	565,895.77
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	157,884.06
结算备付金利息收入	1,220,924.21
其他	5.97
合计	1,944,710.01

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年03月09日（基金合同生效日）至2021年12月31日
卖出股票成交总额	17,571,413,117.58
减：卖出股票成本总额	17,367,077,555.41
买卖股票差价收入	204,335,562.17

7.4.7.13 债券投资收益

无。

7.4.7.14 衍生工具收益

无。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年03月09日（基金合同生效日）至2021年12月31日
股票投资产生的股利收益	11,788,065.96
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	11,788,065.96

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年03月09日（基金合同生效日）至2021年12月31日
1. 交易性金融资产	3,172,510.75
——股票投资	3,172,510.75
——债券投资	-
——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	3,172,510.75

7.4.7.17 其他收入

无。

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年03月09日（基金合同生效日）至2021年12月31日
交易所市场交易费用	39,561,828.11
银行间市场交易费用	-
合计	39,561,828.11

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年03月09日（基金合同生效日）至2021年12月31日
审计费用	80,000.00
信息披露费	100,000.00
证券出借违约金	-
汇划手续费	3,858.29
其他	800.00
合计	184,658.29

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无重大资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
-------	---------

中信建投基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中信银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
中信建投证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构
江苏广传广播传媒有限公司	基金管理人的原股东
航天科技财务有限责任公司	基金管理人的股东
中信建投期货有限公司	与基金管理人同一股东、基金销售机构
元达信资本管理（北京）有限公司	基金管理人的子公司

注：1、经基金管理人股东会2020年度第四次临时会议决议，并经中国证券监督管理委员会证监许可〔2021〕1012号文批准，本公司股东江苏广传广播传媒有限公司将其持有的本公司20%的股权转让给中信建投证券股份有限公司。于2021年4月9日，基金管理人已完成前述股东变更事项的工商变更登记，本次股东变更完成后，基金管理人股权结构为：中信建投证券股份有限公司75%，航天科技财务有限责任公司25%。上述事项基金管理人已于2021年4月10日在证监会规定媒介披露。

2、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年03月09日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中信建投证券股份 有限公司	36,004,613,564.31	100.00%

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年03月09日（基金合同生效日）至2021年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中信建投证券股份有限公司	21,603,033.74	100.00%	-	-

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取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。

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 2021年03月09日（基金合同生效日）至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	17,083,366.53
其中：支付销售机构的客户维护费	8,370,130.32

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1.50%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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年03月09日（基金合同生效日）至2021年12月 31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,847,227.78

注：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。

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 2021年03月09日（基金合同生效日）至2021年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中信建投量化进取A	中信建投量化进取C	合计
中信建投 基金管理 有限公司	0.00	570.14	570.14
中信建投 证券股份 有限公司	0.00	1,218,539.81	1,218,539.81
中信建投 期货有限 公司	0.00	162.87	162.87
中信银行 股份有限 公司	0.00	11,904.01	11,904.01
合计	0.00	1,231,176.83	1,231,176.83

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 2021年03月09日（基金合同生效日）至2021年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中信银行股份有限公司-托管户	18,244,696.26	565,895.77
中信建投证券股份有限公司-证券户	55,641,204.72	157,884.06

注：本基金托管户的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。
本基金证券户的存款由中信建投证券股份有限公司保管，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 2021年03月09日（基金合同生效日）至2021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	688167	炬光科技	网下配售	2,014	158,481.66
中信建投 证券股份 有限公司	301100	风光股份	网下配售	5,985	166,442.85
中信建投 证券股份 有限公司	600927	永安期货	网下配售	1,859	33,406.23
中信建投 证券股份 有限公司	301177	迪阿股份	网下配售	6,732	786,836.16
中信建投 证券股份 有限公司	301090	华润材料	网下配售	27,635	288,785.75
中信建投 证券股份 有限公司	688553	汇宇制药	网下配售	8,928	347,031.36
中信建投 证券股份 有限公司	688707	振华新材	网下配售	8,130	95,527.50
中信建投 证券股份 有限公司	688728	格科微	网下配售	23,033	331,214.54
中信建投 证券股份 有限公司	688385	复旦微电	网下配售	8,986	55,982.78
中信建投 证券股份 有限公司	300774	倍杰特	网下配售	4,435	20,267.95
中信建投 证券股份 有限公司	001210	金房节能	网下配售	311	8,711.11

中信建投 证券股份 有限公司	301025	读客文化	网下配售	4,027	6,241.85
中信建投 证券股份 有限公司	301018	申菱环境	网下配售	7,811	64,753.19
中信建投 证券股份 有限公司	688625	呈和科技	网下配售	2,672	44,034.56
中信建投 证券股份 有限公司	603511	爱慕股份	网下配售	553	11,607.47
中信建投 证券股份 有限公司	605305	中际联合	网下配售	368	13,961.92

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2021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243,344.54元。于2021年度，本基金当期的中信建投期货结算备付金利息收入为247,885.19元。

7.4.11 利润分配情况—按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

无。

7.4.12 期末（2021年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券 代码	证券 名称	成功 认购 日	可流 通日	流通 受限 类型	认购 价格	期末 估值 单价	数量 （单 位：股）	期末 成本 总额	期末 估值 总额	备注
6887 67	博拓 生物	2021 -09-	2022 -03-	科创 板打	34.5 5	66.3 8	2,220	76,7 01.0	147, 363.	-

		01	08	新限售				0	60	
688737	中自科技	2021-10-14	2022-04-22	科创板打新限售	70.90	55.06	2,186	154,987.40	120,361.16	-
301155	海力风电	2021-11-17	2022-05-24	创业板打新限售	60.66	96.75	1,054	63,935.64	101,974.50	-
301177	迪阿股份	2021-12-08	2022-06-15	创业板打新限售	116.88	116.08	674	78,777.12	78,237.92	-
688071	华依科技	2021-07-21	2022-02-07	科创板打新限售	13.73	62.31	1,101	15,116.73	68,603.31	-
301087	可孚医疗	2021-10-15	2022-04-25	创业板打新限售	93.09	75.34	815	75,868.35	61,402.10	-
301050	雷电微力	2021-08-17	2022-02-24	创业板打新限售	60.64	234.74	233	14,129.12	54,694.42	-
688272	富吉瑞	2021-10-08	2022-04-18	科创板打新限售	22.56	39.09	1,263	28,493.28	49,370.67	-
301029	怡合达	2021-07-14	2022-01-24	创业板打新限售	14.14	89.87	462	6,532.68	41,519.94	-

301035	润丰股份	2021-07-21	2022-01-28	创业板打新限售	22.04	56.28	644	14,193.76	36,244.32	-
301090	华润材料	2021-10-19	2022-04-26	创业板打新限售	10.45	11.22	2,764	28,883.80	31,012.08	-
301099	雅创电子	2021-11-10	2022-05-23	创业板打新限售	21.99	71.36	351	7,718.49	25,047.36	-
301189	奥尼电子	2021-12-21	2022-06-28	创业板打新限售	66.18	56.62	435	28,788.30	24,629.70	-
301166	优宁维	2021-12-21	2022-06-28	创业板打新限售	86.06	94.50	253	21,773.18	23,908.50	-
301069	凯盛新材	2021-09-16	2022-03-28	创业板打新限售	5.17	44.21	539	2,786.63	23,829.19	-
301096	百诚医药	2021-12-13	2022-06-20	创业板打新限售	79.60	78.53	272	21,651.20	21,360.16	-
301093	华兰股份	2021-10-21	2022-05-05	创业板打新限售	58.08	49.85	409	23,754.72	20,388.65	-
301018	申菱环境	2021-06-	2022-01-	创业板打	8.29	26.06	782	6,482.78	20,378.9	-

		28	07	新限售					2	
301082	久盛电气	2021-10-14	2022-04-27	创业板打新限售	15.48	21.53	915	14,164.20	19,699.95	-
300994	久祺股份	2021-08-02	2022-02-14	创业板打新限售	11.90	45.45	420	4,998.00	19,089.00	-
301100	风光股份	2021-12-10	2022-06-17	创业板打新限售	27.81	31.14	599	16,658.19	18,652.86	-
301060	兰卫医学	2021-09-06	2022-03-14	创业板打新限售	4.17	30.94	587	2,447.79	18,161.78	-
301088	戎美股份	2021-10-19	2022-04-28	创业板打新限售	33.16	24.67	704	23,344.64	17,367.68	-
301118	恒光股份	2021-11-09	2022-05-18	创业板打新限售	22.70	49.02	315	7,150.50	15,441.30	-
301089	拓新药业	2021-10-20	2022-04-27	创业板打新限售	19.11	67.93	220	4,204.20	14,944.60	-
301046	能辉科技	2021-08-10	2022-02-17	创业板打新限售	8.34	48.99	290	2,418.60	14,207.10	-

301111	粤万年青	2021-11-30	2022-06-07	创业板打新限售	10.48	36.68	379	3,971.92	13,901.72	-
301017	漱玉平民	2021-06-23	2022-01-05	创业板打新限售	8.86	23.80	555	4,917.30	13,209.00	-
301199	迈赫股份	2021-11-30	2022-06-07	创业板打新限售	29.28	32.00	402	11,770.56	12,864.00	-
301020	密封科技	2021-06-28	2022-01-06	创业板打新限售	10.64	30.44	421	4,479.44	12,815.24	-
301138	华研精机	2021-12-08	2022-06-15	创业板打新限售	26.17	44.86	285	7,458.45	12,785.10	-
301185	鸥玛软件	2021-11-11	2022-05-19	创业板打新限售	11.88	21.16	578	6,866.64	12,230.48	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2022-01-06	创业板打新限售	9.46	41.43	290	2,743.40	12,014.70	-
301092	争光股份	2021-10-21	2022-05-05	创业板打新限售	36.31	35.52	323	11,728.13	11,472.96	-
301048	金鹰重工	2021-08-	2022-02-	创业板打	4.13	12.96	843	3,481.59	10,925.2	-

		11	28	新限售					8	
301028	东亚机械	2021-07-12	2022-01-20	创业板打新限售	5.31	13.50	733	3,892.23	9,895.50	-
300774	倍杰特	2021-07-26	2022-02-16	创业板打新限售	4.57	21.08	444	2,029.08	9,359.52	-
301040	中环海陆	2021-07-26	2022-02-07	创业板打新限售	13.57	38.51	241	3,270.37	9,280.91	-
301078	孩子王	2021-09-30	2022-04-14	创业板打新限售	5.77	12.14	756	4,362.12	9,177.84	-
301025	读客文化	2021-07-06	2022-01-24	创业板打新限售	1.55	20.88	403	624.65	8,414.64	-
300814	中富电路	2021-08-04	2022-02-14	创业板打新限售	8.40	23.88	328	2,755.20	7,832.64	-
301055	张小泉	2021-08-26	2022-03-07	创业板打新限售	6.90	21.78	355	2,449.50	7,731.90	-
301030	仕净科技	2021-07-15	2022-01-24	创业板打新限售	6.10	31.52	242	1,476.20	7,627.84	-

301081	严牌股份	2021-10-13	2022-04-20	创业板打新限售	12.95	17.44	403	5,218.85	7,028.32	-
301098	金埔园林	2021-11-04	2022-05-12	创业板打新限售	12.36	22.17	307	3,794.52	6,806.19	-
301033	迈普医学	2021-07-15	2022-01-26	创业板打新限售	15.14	59.97	108	1,635.12	6,476.76	-
301049	超越科技	2021-08-17	2022-02-24	创业板打新限售	19.34	32.92	196	3,790.64	6,452.32	-
301032	新柴股份	2021-07-15	2022-01-24	创业板打新限售	4.97	12.51	513	2,549.61	6,417.63	-
301056	森赫股份	2021-08-27	2022-03-07	创业板打新限售	3.93	11.09	572	2,247.96	6,343.48	-
301036	双乐股份	2021-07-21	2022-02-16	创业板打新限售	23.38	29.93	205	4,792.90	6,135.65	-
301041	金百泽	2021-08-02	2022-02-11	创业板打新限售	7.31	28.21	215	1,571.65	6,065.15	-
301072	中捷精工	2021-09-	2022-03-	创业板打	7.46	33.41	181	1,350.26	6,047.21	-

		22	29	新限售						
301083	百胜智能	2021-10-13	2022-04-21	创业板打新限售	9.08	14.21	416	3,777.28	5,911.36	-
300854	中兰环保	2021-09-08	2022-03-16	创业板打新限售	9.96	27.29	203	2,021.88	5,539.87	-
301063	海锅股份	2021-09-09	2022-03-24	创业板打新限售	17.40	36.11	153	2,662.20	5,524.83	-
001234	泰慕士	2021-12-31	2022-01-11	新股未上市	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-
301038	深水规院	2021-07-22	2022-02-07	创业板打新限售	6.68	20.23	266	1,776.88	5,381.18	-
301059	金三江	2021-09-03	2022-03-14	创业板打新限售	8.09	19.30	259	2,095.31	4,998.70	-
301037	保立佳	2021-07-21	2022-02-07	创业板打新限售	14.82	24.26	193	2,860.26	4,682.18	-
301073	君亭酒店	2021-09-22	2022-03-30	创业板打新限售	12.24	32.00	144	1,762.56	4,608.00	-
3010	汇隆	2021	2022	创业	8.03	19.0	218	1,75	4,14	-

57	新材	-08-31	-03-09	板打 新限售		2		0.54	6.36	
301068	大地 海洋	2021-09-16	2022-03-28	创业 板打 新限售	13.98	28.38	144	2,013.12	4,086.72	-
301079	邵阳 液压	2021-10-11	2022-04-19	创业 板打 新限售	11.92	24.82	140	1,668.80	3,474.80	-

注：1、根据中国证监会《上市公司证券发行管理办法》、《创业板上市公司证券发行管理暂行办法》以及《上市公司非公开发行股票实施细则》，本基金作为特定投资者所认购的2020年2月14日前发行完毕的非公开发行股票，自发行结束之日起12个月内不得转让。根据《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》，本基金持有的上市公司非公开发行股票，采取集中竞价交易方式的，在任意连续90日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的1%，且自股份解除限售之日起12个月内，通过集中竞价交易减持的数量不得超过本基金持有该次非公开发行股票数量的50%；采取大宗交易方式的，在任意连续90日内，减持股份的总数不得超过公司股份总数的2%。本基金通过大宗交易方式受让的原上市公司大股东减持或者特定股东减持的股份，在受让后6个月内，不得转让所受让的股份。

根据中国证监会《关于修改〈上市公司证券发行管理办法〉的决定》、《关于修改〈创业板上市公司证券发行管理暂行办法〉的决定》以及《关于修改〈上市公司非公开发行股票实施细则〉的决定》，本基金所认购的2020年2月14日(含)后发行完毕的非公开发行股票，自发行结束之日起6个月内不得转让。此外，本基金减持上述非公开发行股票不适用《上市公司股东、董监高减持股份的若干规定》及《深圳/上海证券交易所上市公司股东及董事、监事、高级管理人员减持股份实施细则》的有关规定。

2、基金还可作为特定投资者，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。

3、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起6个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后6个月内不得转让。

4、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于6个月的限售期。

5、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。

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。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风

险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履约责任，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，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，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

于2021年12月31日，本基金无债券投资。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场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2021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约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（所有者权益）无固定到期日且不计息，因此账面余额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时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%（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2021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2021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和结算备付金等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年1 2月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	73,885,900.98	-	-	-	73,885,900.98
结算备付金	1,220,222.79	-	-	-	1,220,222.79
交易性金融资产	-	-	-	1,087,003,391.23	1,087,003,391.23
应收利息	-	-	-	11,004.93	11,004.93
应收申购款	-	-	-	332,890.38	332,890.38
资产总计	75,106,123.77	-	-	1,087,347,286.54	1,162,453,410.31
负债					
应付赎回款	-	-	-	8,829,155.42	8,829,155.42
应付管理人报酬	-	-	-	1,518,412.34	1,518,412.34
应付托管费	-	-	-	253,068.71	253,068.71
应付销售服务费	-	-	-	100,582.65	100,582.65
其他负债	-	-	-	80,000.00	80,000.00
负债总计	-	-	-	10,781,219.12	10,781,219.12
利率敏感度缺口	75,106,123.77	-	-	1,076,566,067.42	1,151,672,191.19

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2021年12月31日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，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 2021年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投	1,087,003,391.23	94.38

资		
交易性金融资产—基金投资	—	—
交易性金融资产—贵金属投资	—	—
衍生金融资产—权证投资	—	—
其他	—	—
合计	1,087,003,391.23	94.38

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于2021年12月31日，本基金成立未满一年，尚无足够经验数据。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2021年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为1,085,622,329.99元，属于第二层次的余额为5,504.49元，属于第三层次的余额为1,375,556.75元。

(ii) 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，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

于2021年12月31日，本基金持有公允价值归属于第三层次的金融工具1,375,556.75元。其中，于本会计期间购买第三层次金融工具金额为0元，转入第三层次金融工具金额为873,577.42元，计入损益的利得或损失金额为501,979.33元，均为2021年12月31日仍持有的资产计入未实现利得或损失的变动(公允价值变动损益)。

于2021年12月31日，本基金持有的第三层次交易性金融资产均为股票投资，采用平均价格亚式期权模型进行估值，不可观察输入值为预期波动率，与公允价值之间为负相关关系。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2021年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 根据财政部发布的《企业会计准则第22号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第23号—金融资产转移》、《企业会计准则第24号—套期会计》和《企业会计准则第37号—金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关衔接规定，以及财政部、银保监会于2020年12月30日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金应当自2022年1月1日起执行新金融工具准则。截至2021年12月31日，本基金已完成了执行新金融工具准则对财务报表潜在影响的评估。鉴于本基金业务的性质，新金融工具准则预期不会对本基金的财务状况和经营成果产生重大影响。

本基金将自2022年1月1日起追溯执行相关新规定，并采用准则允许的实务简便方法，调整期初所有者权益，2021年的比较数据将不作重述。

(3) 除公允价值和执行新金融工具准则外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,087,003,391.23	93.51
	其中：股票	1,087,003,391.23	93.51
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—

	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	75,106,123.77	6.46
8	其他各项资产	343,895.31	0.03
9	合计	1,162,453,410.31	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	1,192,194.00	0.10
B	采矿业	53,269,093.05	4.63
C	制造业	754,032,719.44	65.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	21,868,941.10	1.90
E	建筑业	24,741,015.61	2.15
F	批发和零售业	37,581,808.92	3.26
G	交通运输、仓储和邮政业	29,177,782.40	2.53
H	住宿和餐饮业	4,608.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	41,797,661.58	3.63
J	金融业	18,010,171.92	1.56
K	房地产业	21,303,304.46	1.85
L	租赁和商务服务业	26,656,857.00	2.31
M	科学研究和技术服务业	15,061,316.95	1.31
N	水利、环境和公共设施管理业	9,112,206.51	0.79
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	2,429,090.52	0.21

Q	卫生和社会工作	11,147,826.78	0.97
R	文化、体育和娱乐业	14,597,150.99	1.27
S	综合	5,019,642.00	0.44
	合计	1,087,003,391.23	94.38

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。

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	603599	广信股份	337,700	13,170,300.00	1.14
2	002129	中环股份	313,300	13,080,275.00	1.14
3	600057	厦门象屿	1,500,600	12,740,094.00	1.11
4	601882	海天精工	513,600	12,721,872.00	1.10
5	600765	中航重机	237,300	11,981,277.00	1.04
6	300755	华致酒行	237,700	11,904,016.00	1.03
7	600884	杉杉股份	361,900	11,859,463.00	1.03
8	000657	中钨高新	729,700	11,733,576.00	1.02
9	000988	华工科技	416,400	11,600,904.00	1.01
10	603198	迎驾贡酒	166,787	11,583,357.15	1.01
11	600141	兴发集团	298,500	11,307,180.00	0.98
12	688357	建龙微纳	52,600	10,096,044.00	0.88
13	688200	华峰测控	18,900	9,674,910.00	0.84
14	002850	科达利	57,500	9,219,550.00	0.80
15	300409	道氏技术	357,300	8,664,525.00	0.75
16	002648	卫星化学	207,400	8,302,222.00	0.72
17	603456	九洲药业	140,300	7,893,278.00	0.69
18	002254	泰和新材	389,300	7,634,173.00	0.66
19	300672	国科微	40,300	7,475,650.00	0.65

20	002472	双环传动	269,100	7,421,778.00	0.64
21	600436	片仔癀	16,900	7,387,835.00	0.64
22	300573	兴齐眼药	54,000	7,387,200.00	0.64
23	002212	天融信	381,500	7,313,355.00	0.64
24	002407	多氟多	160,200	7,207,398.00	0.63
25	300260	新莱应材	152,600	7,198,142.00	0.63
26	000519	中兵红箭	268,100	7,150,227.00	0.62
27	300316	晶盛机电	102,600	7,130,700.00	0.62
28	605111	新洁能	39,600	7,052,760.00	0.61
29	000498	山东路桥	1,139,600	7,042,728.00	0.61
30	601919	中远海控	376,500	7,036,785.00	0.61
31	300772	运达股份	159,500	7,014,810.00	0.61
32	688301	奕瑞科技	14,100	7,006,290.00	0.61
33	002517	恺英网络	1,201,200	6,990,984.00	0.61
34	600183	生益科技	296,100	6,973,155.00	0.61
35	600887	伊利股份	168,100	6,969,426.00	0.61
36	002709	天赐材料	60,500	6,936,325.00	0.60
37	300474	景嘉微	45,200	6,879,440.00	0.60
38	603613	国联股份	63,100	6,783,250.00	0.59
39	002601	龙佰集团	236,900	6,772,971.00	0.59
40	603008	喜临门	172,038	6,714,643.14	0.58
41	600030	中信证券	247,800	6,544,398.00	0.57
42	300503	昊志机电	500,000	6,430,000.00	0.56
43	603833	欧派家居	43,200	6,372,000.00	0.55
44	603886	元祖股份	265,400	6,250,170.00	0.54
45	300358	楚天科技	238,200	6,209,874.00	0.54
46	601339	百隆东方	1,046,794	6,165,616.66	0.54
47	300268	佳沃食品	329,700	6,112,638.00	0.53
48	002573	清新环境	833,900	6,070,792.00	0.53
49	300073	当升科技	69,300	6,020,091.00	0.52
50	002206	海利得	674,100	5,986,008.00	0.52

51	600438	通威股份	132,300	5,948,208.00	0.52
52	603517	绝味食品	87,000	5,944,710.00	0.52
53	601615	明阳智能	226,700	5,916,870.00	0.51
54	300911	亿田智能	72,100	5,906,432.00	0.51
55	300852	四会富仕	101,020	5,901,588.40	0.51
56	300271	华宇软件	463,000	5,880,100.00	0.51
57	600325	华发股份	968,992	5,833,331.84	0.51
58	002539	云图控股	436,600	5,793,682.00	0.50
59	000039	中集集团	336,100	5,767,476.00	0.50
60	002687	乔治白	815,200	5,763,464.00	0.50
61	600456	宝钛股份	79,100	5,677,798.00	0.49
62	603882	金域医学	50,500	5,624,185.00	0.49
63	002727	一心堂	144,000	5,545,440.00	0.48
64	300781	因赛集团	233,150	5,544,307.00	0.48
65	300244	迪安诊断	164,000	5,505,480.00	0.48
66	002449	国星光电	509,900	5,496,722.00	0.48
67	000877	天山股份	352,600	5,398,306.00	0.47
68	000937	冀中能源	978,100	5,389,331.00	0.47
69	002597	金禾实业	104,600	5,371,210.00	0.47
70	601666	平煤股份	635,700	5,320,809.00	0.46
71	601699	潞安环能	469,500	5,310,045.00	0.46
72	600248	延长化建	1,104,900	5,303,520.00	0.46
73	600779	水井坊	44,006	5,280,279.94	0.46
74	000938	紫光股份	229,600	5,246,360.00	0.46
75	605169	洪通燃气	307,800	5,177,196.00	0.45
76	002003	伟星股份	400,900	5,139,538.00	0.45
77	300587	天铁股份	256,300	5,118,311.00	0.44
78	300327	中颖电子	75,285	5,111,851.50	0.44
79	603369	今世缘	93,800	5,102,720.00	0.44
80	603610	麒盛科技	197,300	5,102,178.00	0.44
81	002008	大族激光	93,838	5,067,252.00	0.44

82	002760	凤形股份	193,900	5,064,668.00	0.44
83	600295	鄂尔多斯	214,586	5,062,083.74	0.44
84	600787	中储股份	806,600	5,033,184.00	0.44
85	000833	粤桂股份	753,700	5,019,642.00	0.44
86	600176	中国巨石	275,300	5,010,460.00	0.44
87	300363	博腾股份	56,000	5,009,200.00	0.43
88	600873	梅花生物	652,500	5,004,675.00	0.43
89	601088	中国神华	222,100	5,001,692.00	0.43
90	000733	振华科技	40,176	4,993,073.28	0.43
91	600373	中文传媒	403,000	4,981,080.00	0.43
92	601233	桐昆股份	233,700	4,949,766.00	0.43
93	000732	泰禾集团	2,236,400	4,942,444.00	0.43
94	603836	海程邦达	186,100	4,885,125.00	0.42
95	600970	中材国际	424,774	4,855,166.82	0.42
96	601668	中国建筑	970,300	4,851,500.00	0.42
97	601156	东航物流	221,205	4,839,965.40	0.42
98	002545	东方铁塔	529,200	4,826,304.00	0.42
99	000929	兰州黄河	490,800	4,814,748.00	0.42
100	603986	兆易创新	27,300	4,800,705.00	0.42
101	603816	顾家家居	61,700	4,760,772.00	0.41
102	002790	瑞尔特	501,468	4,743,887.28	0.41
103	000983	山西焦煤	570,000	4,713,900.00	0.41
104	000598	兴蓉环境	745,440	4,711,180.80	0.41
105	603225	新凤鸣	317,100	4,708,935.00	0.41
106	002932	明德生物	63,620	4,707,880.00	0.41
107	600089	特变电工	220,700	4,672,219.00	0.41
108	000063	中兴通讯	139,400	4,669,900.00	0.41
109	600803	新奥股份	253,100	4,646,916.00	0.40
110	002978	安宁股份	109,700	4,638,116.00	0.40
111	600188	兖州煤业	196,400	4,621,292.00	0.40
112	300416	苏试试验	135,972	4,616,249.40	0.40

113	002765	蓝黛科技	549,400	4,614,960.00	0.40
114	002064	华峰化学	436,800	4,560,192.00	0.40
115	002867	周大生	255,600	4,544,568.00	0.39
116	000887	中鼎股份	207,900	4,534,299.00	0.39
117	300009	安科生物	346,001	4,529,153.09	0.39
118	002185	华天科技	354,300	4,503,153.00	0.39
119	300514	友讯达	353,800	4,479,108.00	0.39
120	002156	通富微电	230,500	4,478,615.00	0.39
121	002430	杭氧股份	148,000	4,441,480.00	0.39
122	600885	宏发股份	59,400	4,433,616.00	0.38
123	002806	华锋股份	295,300	4,414,735.00	0.38
124	000069	华侨城 A	621,100	4,372,544.00	0.38
125	002128	电投能源	293,900	4,364,415.00	0.38
126	002557	洽洽食品	71,101	4,362,757.36	0.38
127	601000	唐山港	1,581,800	4,349,950.00	0.38
128	300623	捷捷微电	137,400	4,322,604.00	0.38
129	300059	东方财富	116,400	4,319,604.00	0.38
130	000725	京东方 A	850,800	4,296,540.00	0.37
131	600123	兰花科创	458,400	4,295,208.00	0.37
132	002223	鱼跃医疗	113,400	4,286,520.00	0.37
133	002180	纳思达	89,500	4,274,520.00	0.37
134	601225	陕西煤业	349,900	4,268,780.00	0.37
135	300171	东富龙	84,300	4,260,522.00	0.37
136	603589	口子窖	60,100	4,259,287.00	0.37
137	600348	阳泉煤业	358,153	4,244,113.05	0.37
138	600546	山煤国际	510,700	4,192,847.00	0.36
139	000568	泸州老窖	16,500	4,188,855.00	0.36
140	300012	华测检测	154,800	4,159,476.00	0.36
141	000977	浪潮信息	115,400	4,134,782.00	0.36
142	300750	宁德时代	7,000	4,116,000.00	0.36
143	300118	东方日升	125,776	4,083,946.72	0.35

144	603115	海星股份	152,200	3,987,640.00	0.35
145	300035	中科电气	131,700	3,983,925.00	0.35
146	002738	中矿资源	54,400	3,827,584.00	0.33
147	300027	华谊兄弟	625,575	2,477,277.00	0.22
148	600293	三峡新材	629,734	2,449,665.26	0.21
149	603377	东方时尚	270,700	2,428,179.00	0.21
150	000623	吉林敖东	130,200	2,404,794.00	0.21
151	600018	上港集团	436,900	2,394,212.00	0.21
152	600335	国机汽车	275,800	2,393,944.00	0.21
153	300296	利亚德	233,200	2,390,300.00	0.21
154	600499	科达制造	96,300	2,390,166.00	0.21
155	002585	双星新材	88,200	2,388,456.00	0.21
156	601881	中国银河	213,400	2,387,946.00	0.21
157	601658	邮储银行	467,800	2,385,780.00	0.21
158	601598	中国外运	530,200	2,375,296.00	0.21
159	600837	海通证券	193,500	2,372,310.00	0.21
160	300652	雷迪克	107,600	2,365,048.00	0.21
161	000897	津滨发展	865,910	2,355,275.20	0.20
162	002752	昇兴股份	348,600	2,353,050.00	0.20
163	002328	新朋股份	379,700	2,278,200.00	0.20
164	688596	正帆科技	87,500	2,261,875.00	0.20
165	000949	新乡化纤	401,600	2,252,976.00	0.20
166	600710	苏美达	342,300	2,238,642.00	0.19
167	300873	海晨股份	44,900	2,204,590.00	0.19
168	603283	赛腾股份	74,900	2,202,060.00	0.19
169	002286	保龄宝	162,800	2,201,056.00	0.19
170	300404	博济医药	157,300	2,175,459.00	0.19
171	002748	世龙实业	191,000	2,148,750.00	0.19
172	002732	燕塘乳业	80,000	2,147,200.00	0.19
173	300639	凯普生物	72,235	2,131,654.85	0.19
174	600979	广安爱众	588,430	2,130,116.60	0.18

175	603458	勘设股份	156,920	2,079,190.00	0.18
176	000793	华闻集团	701,100	2,061,234.00	0.18
177	000823	超声电子	150,379	2,048,161.98	0.18
178	301052	果麦文化	56,800	2,024,920.00	0.18
179	688378	奥来德	25,100	2,010,510.00	0.17
180	300398	飞凯材料	83,200	2,010,112.00	0.17
181	300215	电科院	198,217	1,988,116.51	0.17
182	300250	初灵信息	154,700	1,984,801.00	0.17
183	600633	浙数文化	220,800	1,945,248.00	0.17
184	000034	神州数码	122,000	1,931,260.00	0.17
185	603279	景津环保	41,500	1,924,770.00	0.17
186	300638	广和通	35,300	1,923,850.00	0.17
187	603399	吉翔股份	287,500	1,900,375.00	0.17
188	002833	弘亚数控	59,005	1,898,780.90	0.16
189	000062	深圳华强	110,100	1,897,023.00	0.16
190	601952	苏垦农发	159,000	1,893,690.00	0.16
191	600511	国药股份	59,400	1,872,882.00	0.16
192	300739	明阳电路	96,900	1,871,139.00	0.16
193	300418	昆仑万维	80,800	1,870,520.00	0.16
194	603588	高能环境	105,500	1,853,635.00	0.16
195	603236	移远通信	9,030	1,841,217.00	0.16
196	600251	冠农股份	194,300	1,836,135.00	0.16
197	600861	北京城乡	79,200	1,822,392.00	0.16
198	300643	万通智控	140,800	1,817,728.00	0.16
199	600153	建发股份	200,200	1,815,814.00	0.16
200	601928	凤凰传媒	224,000	1,812,160.00	0.16
201	002416	爱施德	158,000	1,798,040.00	0.16
202	000061	农产品	281,000	1,795,590.00	0.16
203	688399	硕世生物	13,000	1,787,500.00	0.16
204	600116	三峡水利	151,000	1,760,660.00	0.15
205	601199	江南水务	275,500	1,757,690.00	0.15

206	000830	鲁西化工	115,067	1,755,922.42	0.15
207	600735	新华锦	263,800	1,754,270.00	0.15
208	300821	东岳硅材	95,963	1,754,203.64	0.15
209	688598	金博股份	4,900	1,739,696.00	0.15
210	000423	东阿阿胶	35,600	1,735,500.00	0.15
211	600582	天地科技	394,800	1,729,224.00	0.15
212	000917	电广传媒	254,000	1,717,040.00	0.15
213	605399	晨光新材	42,900	1,703,559.00	0.15
214	002611	东方精工	303,400	1,692,972.00	0.15
215	603300	华铁应急	125,780	1,691,741.00	0.15
216	002759	天际股份	57,700	1,690,610.00	0.15
217	688558	国盛智科	37,400	1,690,480.00	0.15
218	603155	新亚强	31,200	1,688,232.00	0.15
219	600867	通化东宝	153,700	1,684,552.00	0.15
220	601985	中国核电	202,943	1,684,426.90	0.15
221	688135	利扬芯片	40,100	1,675,779.00	0.15
222	300117	嘉寓股份	451,700	1,671,290.00	0.15
223	300505	川金诺	54,000	1,654,560.00	0.14
224	688689	银河微电	39,200	1,638,952.00	0.14
225	000761	本钢板材	389,960	1,637,832.00	0.14
226	300390	天华超净	20,200	1,636,200.00	0.14
227	601155	新城控股	48,800	1,421,544.00	0.12
228	001979	招商蛇口	106,400	1,419,376.00	0.12
229	603899	晨光文具	21,301	1,374,127.51	0.12
230	300457	赢合科技	40,600	1,247,232.00	0.11
231	300115	长盈精密	62,100	1,232,064.00	0.11
232	300413	芒果超媒	21,000	1,201,620.00	0.10
233	603982	泉峰汽车	25,400	1,193,800.00	0.10
234	300498	温氏股份	61,900	1,192,194.00	0.10
235	603707	健友股份	27,886	1,171,212.00	0.10
236	002453	华软科技	63,700	1,155,518.00	0.10

237	300203	聚光科技	40,000	1,130,400.00	0.10
238	002493	荣盛石化	61,700	1,120,472.00	0.10
239	603505	金石资源	30,400	1,101,392.00	0.10
240	603876	鼎胜新材	28,900	1,088,085.00	0.09
241	603288	海天味业	10,300	1,082,633.00	0.09
242	300476	胜宏科技	35,400	1,070,850.00	0.09
243	002555	三七互娱	39,000	1,053,780.00	0.09
244	603737	三棵树	7,492	1,042,511.80	0.09
245	300319	麦捷科技	67,900	1,038,870.00	0.09
246	603985	恒润股份	19,300	1,031,006.00	0.09
247	300604	长川科技	17,880	1,028,100.00	0.09
248	603568	伟明环保	28,000	1,022,840.00	0.09
249	300253	卫宁健康	60,574	1,015,220.24	0.09
250	603098	森特股份	21,400	1,005,158.00	0.09
251	300365	恒华科技	93,000	999,750.00	0.09
252	300311	任子行	121,800	995,106.00	0.09
253	603027	千禾味业	41,300	994,504.00	0.09
254	002368	太极股份	35,900	988,686.00	0.09
255	603398	邦宝益智	48,900	967,242.00	0.08
256	300568	星源材质	26,259	964,493.07	0.08
257	603305	旭升股份	19,300	962,684.00	0.08
258	300207	欣旺达	22,800	961,248.00	0.08
259	603507	振江股份	23,500	961,150.00	0.08
260	601137	博威合金	40,700	960,520.00	0.08
261	600246	万通地产	89,900	958,334.00	0.08
262	002624	完美世界	46,900	952,539.00	0.08
263	002756	永兴材料	6,400	947,328.00	0.08
264	601866	中远海发	290,400	943,800.00	0.08
265	300408	三环集团	21,000	936,600.00	0.08
266	300447	全信股份	41,300	932,967.00	0.08
267	688567	孚能科技	27,700	932,105.00	0.08

268	300450	先导智能	12,500	929,625.00	0.08
269	603978	深圳新星	33,800	926,796.00	0.08
270	301185	鸥玛软件	5,776	151,069.06	0.01
271	688767	博拓生物	2,220	147,363.60	0.01
272	688737	中自科技	2,186	120,361.16	0.01
273	301155	海力风电	1,054	101,974.50	0.01
274	300774	倍杰特	4,435	97,161.52	0.01
275	301177	迪阿股份	674	78,237.92	0.01
276	301083	百胜智能	4,160	70,270.72	0.01
277	688071	华依科技	1,101	68,603.31	0.01
278	301087	可孚医疗	815	61,402.10	0.01
279	300854	中兰环保	2,026	58,735.01	0.01
280	301050	雷电微力	233	54,694.42	0.00
281	688272	富吉瑞	1,263	49,370.67	0.00
282	301029	怡合达	462	41,519.94	0.00
283	300896	爱美客	77	41,280.47	0.00
284	301035	润丰股份	644	36,244.32	0.00
285	301090	华润材料	2,764	31,012.08	0.00
286	603230	内蒙新华	1,140	29,491.80	0.00
287	301099	雅创电子	351	25,047.36	0.00
288	301189	奥尼电子	435	24,629.70	0.00
289	301166	优宁维	253	23,908.50	0.00
290	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.00
291	301096	百诚医药	272	21,360.16	0.00
292	301093	华兰股份	409	20,388.65	0.00
293	301018	申菱环境	782	20,378.92	0.00
294	301082	久盛电气	915	19,699.95	0.00
295	300994	久祺股份	420	19,089.00	0.00
296	301100	风光股份	599	18,652.86	0.00
297	001296	长江材料	310	18,376.80	0.00
298	301060	兰卫医学	587	18,161.78	0.00

299	301088	戎美股份	704	17,367.68	0.00
300	301118	恒光股份	315	15,441.30	0.00
301	301089	拓新药业	220	14,944.60	0.00
302	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.00
303	301111	粤万年青	379	13,901.72	0.00
304	301017	漱玉平民	555	13,209.00	0.00
305	301199	迈赫股份	402	12,864.00	0.00
306	301020	密封科技	421	12,815.24	0.00
307	301138	华研精机	285	12,785.10	0.00
308	301021	英诺激光	290	12,014.70	0.00
309	301092	争光股份	323	11,472.96	0.00
310	300661	圣邦股份	36	11,124.00	0.00
311	301048	金鹰重工	843	10,925.28	0.00
312	301028	东亚机械	733	9,895.50	0.00
313	301040	中环海陆	241	9,280.91	0.00
314	301078	孩子王	756	9,177.84	0.00
315	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00
316	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
317	301055	张小泉	355	7,731.90	0.00
318	301030	仕净科技	242	7,627.84	0.00
319	301081	严牌股份	403	7,028.32	0.00
320	301098	金埔园林	307	6,806.19	0.00
321	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
322	301049	超越科技	196	6,452.32	0.00
323	301032	新柴股份	513	6,417.63	0.00
324	301056	森赫股份	572	6,343.48	0.00
325	301036	双乐股份	205	6,135.65	0.00
326	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00
327	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
328	300747	锐科激光	95	5,615.45	0.00
329	301063	海锅股份	153	5,524.83	0.00

330	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
331	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00
332	301059	金三江	259	4,998.70	0.00
333	603176	汇通集团	1,924	4,713.80	0.00
334	301037	保立佳	193	4,682.18	0.00
335	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
336	301011	华立科技	75	4,515.00	0.00
337	301057	汇隆新材	218	4,146.36	0.00
338	300986	志特新材	64	4,096.64	0.00
339	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00
340	300979	华利集团	45	4,007.25	0.00
341	301012	扬电科技	70	3,544.80	0.00
342	301079	邵阳液压	140	3,474.80	0.00
343	603520	司太立	40	2,600.00	0.00
344	300995	奇德新材	91	2,521.61	0.00
345	300992	泰福泵业	96	2,376.00	0.00
346	300948	冠中生态	95	2,329.40	0.00
347	603213	镇洋发展	99	2,292.84	0.00
348	001219	青岛食品	72	2,203.20	0.00
349	300433	蓝思科技	84	1,930.32	0.00
350	301015	百洋医药	62	1,878.60	0.00
351	300500	启迪设计	80	1,877.60	0.00
352	603048	浙江黎明	64	1,856.00	0.00
353	301013	利和兴	71	1,824.70	0.00
354	001212	中旗新材	54	1,744.74	0.00
355	300640	德艺文创	170	1,207.00	0.00
356	601966	玲珑轮胎	29	1,059.95	0.00
357	600111	北方稀土	23	1,053.40	0.00
358	603010	万盛股份	40	1,047.20	0.00
359	002643	万润股份	41	969.24	0.00
360	605577	龙版传媒	65	953.55	0.00

361	002832	比音勒芬	36	916.20	0.00
362	000526	学大教育	48	911.52	0.00
363	600285	羚锐制药	56	884.80	0.00
364	300232	洲明科技	90	804.60	0.00
365	000722	湖南发展	85	754.80	0.00
366	603071	物产环能	27	682.02	0.00
367	001288	运机集团	37	658.97	0.00
368	603219	富佳股份	28	554.12	0.00
369	603216	梦天家居	20	505.80	0.00
370	000682	东方电子	55	465.85	0.00
371	603527	众源新材	36	433.80	0.00
372	605183	确成股份	18	353.70	0.00
373	300917	特发服务	10	326.90	0.00
374	002309	中利集团	45	304.20	0.00
375	300993	玉马遮阳	10	287.10	0.00
376	300201	海伦哲	64	245.76	0.00
377	002042	华孚时尚	50	228.50	0.00
378	600808	马钢股份	57	210.33	0.00
379	002034	旺能环境	12	207.24	0.00
380	000510	新金路	33	195.03	0.00
381	600742	一汽富维	15	179.40	0.00
382	600986	科达股份	20	168.60	0.00
383	002094	青岛金王	37	167.24	0.00
384	300735	光弘科技	10	150.70	0.00
385	000898	鞍钢股份	39	146.25	0.00
386	601665	齐鲁银行	24	133.92	0.00
387	600502	安徽建工	32	132.80	0.00
388	600466	蓝光发展	63	128.52	0.00
389	600935	华塑股份	11	84.04	0.00
390	600845	宝信软件	1	60.83	0.00
391	605507	国邦医药	2	57.66	0.00

392	600010	包钢股份	20	55.80	0.00
393	300958	建工修复	2	54.02	0.00
394	301002	崧盛股份	1	53.80	0.00
395	600782	新钢股份	1	5.28	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	300750	宁德时代	72,708,676.44	6.31
2	002648	卫星化学	69,787,322.71	6.06
3	603613	国联股份	63,515,123.51	5.52
4	002601	龙佰集团	63,276,013.03	5.49
5	600141	兴发集团	62,458,491.76	5.42
6	600426	华鲁恒升	61,590,586.37	5.35
7	603816	顾家家居	60,582,537.92	5.26
8	600309	万华化学	59,753,276.51	5.19
9	688357	建龙微纳	59,102,064.22	5.13
10	600809	山西汾酒	58,519,646.56	5.08
11	603612	索通发展	57,621,482.25	5.00
12	300316	晶盛机电	57,302,369.75	4.98
13	601636	旗滨集团	56,360,114.00	4.89
14	002241	歌尔股份	56,243,706.12	4.88
15	300755	华致酒行	56,067,954.01	4.87
16	000683	远兴能源	55,412,115.40	4.81
17	603156	养元饮品	54,543,663.88	4.74
18	603225	新凤鸣	53,766,723.30	4.67
19	300413	芒果超媒	53,487,204.25	4.64
20	000733	振华科技	53,487,133.38	4.64
21	300059	东方财富	52,856,694.78	4.59

22	600600	青岛啤酒	52,845,412.70	4.59
23	000100	TCL科技	51,920,307.50	4.51
24	300146	汤臣倍健	51,842,289.17	4.50
25	600884	杉杉股份	51,667,402.28	4.49
26	603659	璞泰来	51,614,771.80	4.48
27	002585	双星新材	51,471,832.38	4.47
28	603456	九洲药业	51,040,253.16	4.43
29	000898	鞍钢股份	50,932,429.81	4.42
30	600808	马钢股份	50,923,589.20	4.42
31	603882	金域医学	50,603,051.99	4.39
32	601899	紫金矿业	50,367,911.00	4.37
33	603198	迎驾贡酒	50,340,158.12	4.37
34	300073	当升科技	49,757,669.91	4.32
35	601598	中国外运	49,567,408.76	4.30
36	601898	中煤能源	48,255,482.08	4.19
37	000933	神火股份	47,906,260.00	4.16
38	603599	广信股份	47,723,964.57	4.14
39	601881	中国银河	47,686,585.55	4.14
40	603833	欧派家居	47,647,685.56	4.14
41	601985	中国核电	47,569,641.63	4.13
42	601128	常熟银行	47,342,382.99	4.11
43	002738	中矿资源	47,335,462.19	4.11
44	601857	中国石油	47,281,430.88	4.11
45	000830	鲁西化工	47,241,990.52	4.10
46	601668	中国建筑	47,099,375.30	4.09
47	300035	中科电气	46,492,776.29	4.04
48	002064	华峰化学	46,418,549.00	4.03
49	600584	长电科技	46,277,560.02	4.02
50	600438	通威股份	46,127,855.13	4.01
51	300196	长海股份	46,013,266.40	4.00
52	600997	开滦股份	45,995,438.91	3.99

53	605399	晨光新材	45,779,626.24	3.98
54	002415	海康威视	45,645,570.68	3.96
55	000725	京东方 A	45,640,164.00	3.96
56	600887	伊利股份	45,466,060.00	3.95
57	601919	中远海控	45,313,651.83	3.93
58	002129	中环股份	45,046,166.65	3.91
59	601677	明泰铝业	44,084,418.86	3.83
60	603877	太平鸟	43,669,497.22	3.79
61	002156	通富微电	42,987,412.49	3.73
62	600018	上港集团	42,802,589.75	3.72
63	688200	华峰测控	42,716,063.83	3.71
64	600176	中国巨石	42,479,691.56	3.69
65	688188	柏楚电子	42,457,436.20	3.69
66	000039	中集集团	41,933,212.08	3.64
67	002850	科达利	41,867,000.08	3.64
68	002727	一心堂	41,778,720.16	3.63
69	600845	宝信软件	41,772,582.68	3.63
70	600782	新钢股份	41,689,289.44	3.62
71	002745	木林森	41,640,416.00	3.62
72	600765	中航重机	41,636,645.65	3.62
73	603008	喜临门	41,589,347.54	3.61
74	000568	泸州老窖	41,576,555.42	3.61
75	300358	楚天科技	41,531,378.60	3.61
76	000825	太钢不锈	41,264,104.00	3.58
77	600188	兖州煤业	41,067,923.45	3.57
78	002858	力盛赛车	40,869,441.00	3.55
79	000949	新乡化纤	40,853,483.16	3.55
80	600057	厦门象屿	40,851,503.24	3.55
81	601211	国泰君安	40,540,886.18	3.52
82	002833	弘亚数控	39,883,879.25	3.46
83	000983	山西焦煤	39,460,642.72	3.43

84	000887	中鼎股份	39,445,754.80	3.43
85	300747	锐科激光	39,314,743.94	3.41
86	300587	天铁股份	39,188,669.80	3.40
87	601117	中国化学	39,095,878.66	3.39
88	600282	南钢股份	38,968,648.96	3.38
89	603260	合盛硅业	38,966,298.94	3.38
90	603279	景津环保	38,890,661.92	3.38
91	002867	周大生	38,637,838.74	3.35
92	002185	华天科技	38,592,591.22	3.35
93	002254	泰和新材	38,347,674.22	3.33
94	600873	梅花生物	38,204,309.34	3.32
95	002557	洽洽食品	38,201,573.84	3.32
96	601233	桐昆股份	38,136,984.00	3.31
97	002080	中材科技	37,846,499.28	3.29
98	000425	徐工机械	37,736,415.00	3.28
99	601088	中国神华	37,639,117.58	3.27
100	601155	新城控股	37,621,596.54	3.27
101	002309	中利集团	37,578,225.15	3.26
102	600409	三友化工	37,550,234.57	3.26
103	300037	新宙邦	37,185,866.71	3.23
104	600293	三峡新材	37,030,328.32	3.22
105	601699	潞安环能	36,855,670.85	3.20
106	601882	海天精工	36,680,483.19	3.18
107	603259	药明康德	36,426,562.80	3.16
108	603588	高能环境	36,413,652.45	3.16
109	600123	兰花科创	36,004,468.59	3.13
110	600810	神马股份	35,778,068.51	3.11
111	002027	分众传媒	35,745,417.98	3.10
112	600028	中国石化	35,662,784.00	3.10
113	603377	东方时尚	35,608,771.43	3.09
114	600089	特变电工	35,489,391.77	3.08

115	600707	彩虹股份	35,355,808.13	3.07
116	603010	万盛股份	35,137,277.04	3.05
117	300373	扬杰科技	34,882,805.83	3.03
118	002832	比音勒芬	34,749,792.52	3.02
119	002493	荣盛石化	34,707,002.98	3.01
120	300737	科顺股份	34,706,452.40	3.01
121	601339	百隆东方	34,290,803.50	2.98
122	002312	川发龙蟒	34,208,497.00	2.97
123	601003	柳钢股份	34,119,832.71	2.96
124	003016	欣贺股份	33,865,053.64	2.94
125	688368	晶丰明源	33,564,377.13	2.91
126	002756	永兴材料	33,438,069.50	2.90
127	600582	天地科技	33,418,585.39	2.90
128	603517	绝味食品	33,373,392.88	2.90
129	002345	潮宏基	33,323,627.00	2.89
130	601689	拓普集团	33,292,616.26	2.89
131	002430	杭氧股份	32,963,950.00	2.86
132	000507	珠海港	32,706,446.62	2.84
133	000012	南玻A	32,680,440.74	2.84
134	002932	明德生物	32,635,367.60	2.83
135	002568	百润股份	32,434,142.82	2.82
136	000063	中兴通讯	32,415,457.00	2.81
137	300294	博雅生物	32,339,225.62	2.81
138	300124	汇川技术	32,245,481.50	2.80
139	300783	三只松鼠	32,140,662.00	2.79
140	600803	新奥股份	31,787,183.00	2.76
141	601666	平煤股份	31,765,077.45	2.76
142	300350	华鹏飞	31,675,222.40	2.75
143	002179	中航光电	31,666,658.38	2.75
144	002092	中泰化学	31,621,997.95	2.75
145	002765	蓝黛科技	31,554,153.00	2.74

146	600019	宝钢股份	31,489,027.92	2.73
147	603466	风语筑	31,209,180.05	2.71
148	300363	博腾股份	31,060,126.37	2.70
149	300369	绿盟科技	31,050,631.00	2.70
150	600606	绿地控股	30,945,348.65	2.69
151	001979	招商蛇口	30,837,107.80	2.68
152	600039	四川路桥	30,816,162.92	2.68
153	603986	兆易创新	30,784,297.34	2.67
154	300568	星源材质	30,481,987.43	2.65
155	300327	中颖电子	30,474,252.33	2.65
156	002138	顺络电子	30,408,292.60	2.64
157	002110	三钢闽光	30,406,734.48	2.64
158	002709	天赐材料	30,402,667.76	2.64
159	300627	华测导航	30,343,830.20	2.63
160	000786	北新建材	30,312,032.28	2.63
161	000977	浪潮信息	30,228,357.48	2.62
162	002747	埃斯顿	30,090,400.00	2.61
163	002022	科华生物	30,090,188.94	2.61
164	002536	飞龙股份	30,039,595.00	2.61
165	002472	双环传动	29,940,951.00	2.60
166	002876	三利谱	29,896,586.76	2.60
167	002541	鸿路钢构	29,862,937.27	2.59
168	601166	兴业银行	29,802,297.57	2.59
169	002806	华锋股份	29,729,633.34	2.58
170	300458	全志科技	29,668,042.00	2.58
171	600795	国电电力	29,660,173.76	2.58
172	603566	普莱柯	29,436,896.00	2.56
173	002382	蓝帆医疗	29,363,605.91	2.55
174	300450	先导智能	29,215,638.80	2.54
175	000776	广发证券	29,137,499.00	2.53
176	603236	移远通信	29,001,943.30	2.52

177	000799	酒鬼酒	28,990,884.26	2.52
178	300679	电连技术	28,974,530.14	2.52
179	300638	广和通	28,906,210.33	2.51
180	000807	云铝股份	28,817,750.64	2.50
181	600966	博汇纸业	28,756,895.00	2.50
182	300772	运达股份	28,686,336.94	2.49
183	002230	科大讯飞	28,474,488.80	2.47
184	300415	伊之密	28,391,360.40	2.47
185	600483	福能股份	28,300,598.95	2.46
186	601225	陕西煤业	28,297,170.00	2.46
187	300219	鸿利智汇	28,280,443.56	2.46
188	300639	凯普生物	28,254,989.74	2.45
189	603115	海星股份	28,130,074.00	2.44
190	605169	洪通燃气	28,121,472.05	2.44
191	603801	志邦家居	28,043,944.63	2.44
192	300094	国联水产	28,015,762.00	2.43
193	002042	华孚时尚	27,970,796.50	2.43
194	600715	文投控股	27,904,717.00	2.42
195	600885	宏发股份	27,818,562.20	2.42
196	000917	电广传媒	27,750,748.00	2.41
197	601186	中国铁建	27,690,992.00	2.40
198	002258	利尔化学	27,583,346.25	2.40
199	300382	斯莱克	27,468,579.00	2.39
200	688536	思瑞浦	27,407,928.30	2.38
201	601678	滨化股份	27,407,741.74	2.38
202	002614	奥佳华	27,372,644.11	2.38
203	600315	上海家化	27,294,872.09	2.37
204	600500	中化国际	27,178,507.10	2.36
205	600036	招商银行	27,078,908.30	2.35
206	300593	新雷能	27,078,415.76	2.35
207	600755	厦门国贸	27,074,571.60	2.35

208	002286	保龄宝	27,006,427.00	2.34
209	601618	中国中冶	26,992,655.00	2.34
210	600063	皖维高新	26,986,845.60	2.34
211	000001	平安银行	26,902,467.45	2.34
212	002094	青岛金王	26,715,222.04	2.32
213	600690	海尔智家	26,688,990.45	2.32
214	000069	华侨城 A	26,522,809.94	2.30
215	603897	长城科技	26,506,060.88	2.30
216	600132	重庆啤酒	26,487,596.94	2.30
217	605006	山东玻纤	26,408,006.00	2.29
218	600096	云天化	26,407,671.47	2.29
219	600298	安琪酵母	26,392,959.02	2.29
220	300408	三环集团	26,286,671.98	2.28
221	002274	华昌化工	26,258,157.00	2.28
222	002978	安宁股份	26,244,334.00	2.28
223	600546	山煤国际	26,147,165.00	2.27
224	002206	海利得	26,140,927.00	2.27
225	000988	华工科技	26,139,172.00	2.27
226	600323	瀚蓝环境	25,980,207.70	2.26
227	002479	富春环保	25,901,392.62	2.25
228	300769	德方纳米	25,844,382.00	2.24
229	601838	成都银行	25,709,035.00	2.23
230	000657	中钨高新	25,590,913.40	2.22
231	002649	博彦科技	25,562,526.71	2.22
232	002739	万达电影	25,454,923.66	2.21
233	002013	中航机电	25,431,764.70	2.21
234	300390	天华超净	25,425,405.00	2.21
235	603168	莎普爱思	25,316,723.44	2.20
236	002402	和而泰	25,278,074.96	2.19
237	002636	金安国纪	25,270,351.00	2.19
238	605168	三人行	25,213,031.00	2.19

239	605111	新洁能	24,946,585.80	2.17
240	603185	上机数控	24,929,220.50	2.16
241	603876	鼎胜新材	24,917,767.00	2.16
242	601928	凤凰传媒	24,828,693.66	2.16
243	600008	首创股份	24,790,796.75	2.15
244	601615	明阳智能	24,767,583.26	2.15
245	600710	苏美达	24,731,523.10	2.15
246	603039	泛微网络	24,587,774.40	2.13
247	300740	水羊股份	24,542,608.96	2.13
248	600581	八一钢铁	24,511,497.00	2.13
249	603128	华贸物流	24,418,525.14	2.12
250	003012	东鹏控股	24,203,551.00	2.10
251	600869	智慧能源	24,186,156.00	2.10
252	603799	华友钴业	24,149,048.60	2.10
253	601918	新集能源	24,107,066.88	2.09
254	002139	拓邦股份	24,019,399.25	2.09
255	600779	水井坊	24,017,088.30	2.09
256	600183	生益科技	23,886,225.76	2.07
257	601390	中国中铁	23,873,339.00	2.07
258	000526	学大教育	23,847,471.40	2.07
259	300034	钢研高纳	23,726,853.06	2.06
260	601168	西部矿业	23,625,954.00	2.05
261	600569	安阳钢铁	23,611,922.00	2.05
262	000519	中兵红箭	23,558,553.71	2.05
263	603737	三棵树	23,539,221.64	2.04
264	300724	捷佳伟创	23,515,792.49	2.04
265	603589	口子窖	23,460,145.00	2.04
266	300661	圣邦股份	23,424,561.48	2.03
267	002068	黑猫股份	23,395,095.00	2.03
268	000822	山东海化	23,299,366.00	2.02
269	002236	大华股份	23,273,893.00	2.02

270	603606	东方电缆	23,212,565.80	2.02
271	300416	苏试试验	23,176,694.96	2.01
272	000498	山东路桥	23,163,516.52	2.01
273	300623	捷捷微电	23,111,427.00	2.01
274	300911	亿田智能	23,083,250.36	2.00

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	300750	宁德时代	71,763,422.04	6.23
2	002648	卫星化学	63,502,270.43	5.51
3	600426	华鲁恒升	62,474,947.04	5.42
4	600141	兴发集团	61,561,074.37	5.35
5	000683	远兴能源	60,179,744.29	5.23
6	600809	山西汾酒	59,405,967.16	5.16
7	603612	索通发展	59,394,467.34	5.16
8	600309	万华化学	58,549,227.26	5.08
9	603613	国联股份	58,194,801.81	5.05
10	002241	歌尔股份	57,793,240.86	5.02
11	002601	龙佰集团	56,889,439.15	4.94
12	601636	旗滨集团	56,564,970.01	4.91
13	603659	璞泰来	55,530,257.25	4.82
14	603816	顾家家居	55,202,214.94	4.79
15	603156	养元饮品	54,901,639.74	4.77
16	600600	青岛啤酒	53,953,737.34	4.68
17	300316	晶盛机电	53,551,997.74	4.65
18	002585	双星新材	51,888,109.71	4.51
19	600808	马钢股份	51,453,212.76	4.47
20	000898	鞍钢股份	50,908,047.40	4.42
21	000733	振华科技	50,694,197.19	4.40

22	300413	芒果超媒	50,041,778.27	4.35
23	601899	紫金矿业	49,879,006.00	4.33
24	688357	建龙微纳	49,449,706.69	4.29
25	000933	神火股份	49,143,274.04	4.27
26	300146	汤臣倍健	49,068,162.92	4.26
27	000100	TCL科技	48,832,729.18	4.24
28	300059	东方财富	48,761,469.20	4.23
29	601598	中国外运	48,330,047.99	4.20
30	601857	中国石油	48,126,150.80	4.18
31	601898	中煤能源	48,074,819.15	4.17
32	002738	中矿资源	48,041,858.78	4.17
33	601128	常熟银行	47,359,798.27	4.11
34	300035	中科电气	47,026,274.43	4.08
35	000830	鲁西化工	46,955,649.35	4.08
36	605399	晨光新材	46,784,118.20	4.06
37	600997	开滦股份	46,386,626.70	4.03
38	300073	当升科技	46,164,901.83	4.01
39	601677	明泰铝业	45,651,282.52	3.96
40	601985	中国核电	45,496,615.82	3.95
41	601881	中国银河	45,443,405.78	3.95
42	300196	长海股份	45,260,660.95	3.93
43	603225	新凤鸣	45,011,488.73	3.91
44	600584	长电科技	44,951,708.68	3.90
45	300755	华致酒行	44,717,650.66	3.88
46	600845	宝信软件	44,536,559.15	3.87
47	002415	海康威视	44,423,326.06	3.86
48	603882	金域医学	43,898,568.00	3.81
49	603456	九洲药业	43,553,782.72	3.78
50	603260	合盛硅业	43,015,976.38	3.74
51	600438	通威股份	42,965,817.47	3.73
52	000825	太钢不锈	42,670,348.50	3.71

53	603877	太平鸟	42,397,455.47	3.68
54	601668	中国建筑	42,351,948.78	3.68
55	601117	中国化学	41,940,935.38	3.64
56	603198	迎驾贡酒	41,701,720.55	3.62
57	688188	柏楚电子	41,620,467.22	3.61
58	002745	木林森	41,425,460.66	3.60
59	002080	中材科技	41,203,213.12	3.58
60	601211	国泰君安	41,164,984.86	3.57
61	002064	华峰化学	41,004,749.68	3.56
62	603833	欧派家居	40,779,434.13	3.54
63	600782	新钢股份	40,482,095.64	3.52
64	002858	力盛赛车	40,404,466.08	3.51
65	601919	中远海控	40,072,616.60	3.48
66	300587	天铁股份	39,618,752.42	3.44
67	002309	中利集团	39,613,369.20	3.44
68	000949	新乡化纤	39,582,390.61	3.44
69	300747	锐科激光	39,541,261.18	3.43
70	000725	京东方 A	39,381,398.41	3.42
71	603599	广信股份	39,268,743.49	3.41
72	600018	上港集团	39,229,756.00	3.41
73	600409	三友化工	39,125,392.68	3.40
74	600884	杉杉股份	39,056,923.31	3.39
75	600887	伊利股份	38,664,219.13	3.36
76	603279	景津环保	38,624,710.20	3.35
77	000425	徐工机械	38,624,013.18	3.35
78	600282	南钢股份	38,342,942.36	3.33
79	000568	泸州老窖	38,313,114.00	3.33
80	002156	通富微电	38,276,160.40	3.32
81	603008	喜临门	38,164,580.00	3.31
82	000983	山西焦煤	38,152,734.89	3.31
83	600188	兖州煤业	38,032,935.78	3.30

84	600293	三峡新材	38,003,450.54	3.30
85	600176	中国巨石	37,961,429.71	3.30
86	000887	中鼎股份	37,843,551.13	3.29
87	300037	新宙邦	37,756,470.08	3.28
88	002312	川发龙蟒	37,717,369.50	3.28
89	000039	中集集团	37,304,823.36	3.24
90	300373	扬杰科技	36,855,190.40	3.20
91	002833	弘亚数控	36,760,251.24	3.19
92	002850	科达利	36,423,977.40	3.16
93	603259	药明康德	36,407,824.68	3.16
94	300358	楚天科技	36,372,361.40	3.16
95	603588	高能环境	35,800,622.05	3.11
96	600028	中国石化	35,672,216.00	3.10
97	600810	神马股份	35,392,496.81	3.07
98	002727	一心堂	35,227,651.72	3.06
99	600123	兰花科创	35,143,300.50	3.05
100	603010	万盛股份	35,055,317.12	3.04
101	002832	比音勒芬	35,053,338.11	3.04
102	600707	彩虹股份	35,048,967.71	3.04
103	002756	永兴材料	35,043,874.19	3.04
104	601155	新城控股	34,985,751.83	3.04
105	002185	华天科技	34,663,670.27	3.01
106	300737	科顺股份	34,536,458.07	3.00
107	600089	特变电工	34,309,457.60	2.98
108	601699	潞安环能	34,143,108.26	2.96
109	002027	分众传媒	34,133,500.93	2.96
110	601689	拓普集团	34,080,709.64	2.96
111	601003	柳钢股份	33,940,142.88	2.95
112	600873	梅花生物	33,854,055.58	2.94
113	000012	南玻 A	33,572,247.71	2.92
114	000507	珠海港	33,489,469.88	2.91

115	002493	荣盛石化	33,428,244.17	2.90
116	002867	周大生	33,396,439.45	2.90
117	300350	华鹏飞	33,347,621.80	2.90
118	002179	中航光电	33,161,129.10	2.88
119	002557	洽洽食品	32,944,929.86	2.86
120	600765	中航重机	32,820,298.08	2.85
121	002345	潮宏基	32,795,011.73	2.85
122	601088	中国神华	32,680,470.50	2.84
123	601233	桐昆股份	32,612,540.00	2.83
124	600582	天地科技	32,458,502.00	2.82
125	300294	博雅生物	32,346,820.04	2.81
126	002568	百润股份	32,339,899.15	2.81
127	688368	晶丰明源	32,322,857.40	2.81
128	300124	汇川技术	32,216,661.54	2.80
129	300627	华测导航	31,890,121.14	2.77
130	003016	欣贺股份	31,861,014.17	2.77
131	603377	东方时尚	31,839,908.59	2.76
132	600039	四川路桥	31,130,264.75	2.70
133	002747	埃斯顿	30,981,980.55	2.69
134	600057	厦门象屿	30,833,559.31	2.68
135	600019	宝钢股份	30,702,071.21	2.67
136	002254	泰和新材	30,663,050.53	2.66
137	601678	滨化股份	30,608,221.18	2.66
138	002129	中环股份	30,556,988.56	2.65
139	002932	明德生物	30,426,690.82	2.64
140	001979	招商蛇口	30,415,442.38	2.64
141	603466	风语筑	30,376,051.76	2.64
142	002876	三利谱	30,316,214.04	2.63
143	300568	星源材质	30,228,376.10	2.62
144	600606	绿地控股	30,141,470.95	2.62
145	002092	中泰化学	30,014,974.27	2.61

146	600096	云天化	29,941,820.00	2.60
147	300679	电连技术	29,919,211.16	2.60
148	002430	杭氧股份	29,903,520.70	2.60
149	300450	先导智能	29,838,120.07	2.59
150	002138	顺络电子	29,793,998.92	2.59
151	688200	华峰测控	29,706,555.99	2.58
152	000807	云铝股份	29,672,935.88	2.58
153	300783	三只松鼠	29,595,652.78	2.57
154	600795	国电电力	29,563,488.80	2.57
155	300369	绿盟科技	29,451,936.74	2.56
156	600483	福能股份	29,384,847.01	2.55
157	601166	兴业银行	29,279,259.00	2.54
158	000776	广发证券	29,271,695.00	2.54
159	002541	鸿路钢构	29,258,624.00	2.54
160	002022	科华生物	29,254,912.79	2.54
161	300593	新雷能	28,980,724.19	2.52
162	600063	皖维高新	28,953,891.20	2.51
163	002536	飞龙股份	28,936,158.50	2.51
164	300219	鸿利智汇	28,931,577.53	2.51
165	601339	百隆东方	28,909,116.12	2.51
166	000786	北新建材	28,897,569.97	2.51
167	002382	蓝帆医疗	28,774,601.93	2.50
168	000063	中兴通讯	28,755,873.59	2.50
169	300458	全志科技	28,742,181.60	2.50
170	603566	普莱柯	28,663,682.00	2.49
171	002230	科大讯飞	28,580,530.70	2.48
172	600715	文投控股	28,443,675.00	2.47
173	300415	伊之密	28,433,841.84	2.47
174	002110	三钢闽光	28,269,284.17	2.45
175	002765	蓝黛科技	28,159,185.00	2.45
176	601618	中国中冶	28,106,458.00	2.44

177	600966	博汇纸业	28,063,515.06	2.44
178	601666	平煤股份	27,899,784.19	2.42
179	603236	移远通信	27,813,154.24	2.42
180	600803	新奥股份	27,802,198.20	2.41
181	300390	天华超净	27,745,533.32	2.41
182	603517	绝味食品	27,712,365.00	2.41
183	600500	中化国际	27,687,690.25	2.40
184	002042	华孚时尚	27,686,493.30	2.40
185	002274	华昌化工	27,572,796.24	2.39
186	603897	长城科技	27,567,323.11	2.39
187	300382	斯莱克	27,545,572.48	2.39
188	002258	利尔化学	27,503,402.03	2.39
189	000799	酒鬼酒	27,490,109.00	2.39
190	601186	中国铁建	27,480,197.00	2.39
191	300094	国联水产	27,444,396.00	2.38
192	300769	德方纳米	27,406,258.00	2.38
193	002614	奥佳华	27,032,902.83	2.35
194	605006	山东玻纤	26,997,669.00	2.34
195	600690	海尔智家	26,970,864.15	2.34
196	600036	招商银行	26,960,860.00	2.34
197	002013	中航机电	26,933,179.50	2.34
198	000977	浪潮信息	26,894,331.56	2.34
199	002636	金安国纪	26,690,221.00	2.32
200	688536	思瑞浦	26,618,522.74	2.31
201	300638	广和通	26,500,925.60	2.30
202	300327	中颖电子	26,462,765.93	2.30
203	601882	海天精工	26,320,987.00	2.29
204	600755	厦门国贸	26,263,443.74	2.28
205	002479	富春环保	26,213,051.57	2.28
206	603168	莎普爱思	26,132,805.71	2.27
207	600315	上海家化	26,060,769.16	2.26

208	603876	鼎胜新材	26,036,631.00	2.26
209	601838	成都银行	26,014,579.15	2.26
210	603185	上机数控	25,985,567.00	2.26
211	300363	博腾股份	25,812,575.67	2.24
212	603986	兆易创新	25,803,343.04	2.24
213	002094	青岛金王	25,752,263.32	2.24
214	000001	平安银行	25,751,786.25	2.24
215	002739	万达电影	25,727,595.56	2.23
216	603606	东方电缆	25,634,822.18	2.23
217	300408	三环集团	25,582,631.99	2.22
218	600298	安琪酵母	25,570,486.19	2.22
219	300639	凯普生物	25,565,933.95	2.22
220	600132	重庆啤酒	25,457,252.72	2.21
221	601918	新集能源	25,430,187.68	2.21
222	603026	石大胜华	25,387,782.16	2.20
223	000917	电广传媒	25,344,440.00	2.20
224	600323	瀚蓝环境	25,314,048.62	2.20
225	300724	捷佳伟创	25,279,490.77	2.20
226	002286	保龄宝	25,264,841.80	2.19
227	603801	志邦家居	25,252,283.41	2.19
228	603115	海星股份	25,098,868.00	2.18
229	002139	拓邦股份	25,055,255.64	2.18
230	603098	森特股份	25,053,156.80	2.18
231	002649	博彦科技	24,967,435.83	2.17
232	600008	首创股份	24,911,329.50	2.16
233	002806	华锋股份	24,744,332.56	2.15
234	300740	水羊股份	24,730,055.56	2.15
235	002402	和而泰	24,714,701.73	2.15
236	603100	川仪股份	24,672,744.60	2.14
237	601390	中国中铁	24,655,515.98	2.14
238	603799	华友钴业	24,529,703.26	2.13

239	002206	海 利 得	24,527,346.04	2.13
240	605168	三人行	24,506,801.88	2.13
241	600581	八一钢铁	24,357,233.00	2.11
242	600885	宏发股份	24,250,483.52	2.11
243	600869	智慧能源	24,185,509.00	2.10
244	300410	正业科技	24,109,927.73	2.09
245	002068	黑猫股份	23,813,113.00	2.07
246	603128	华贸物流	23,800,773.60	2.07
247	300034	钢研高纳	23,629,513.47	2.05
248	601225	陕西煤业	23,613,827.81	2.05
249	601168	西部矿业	23,567,344.00	2.05
250	000526	学大教育	23,472,508.00	2.04
251	003012	东鹏控股	23,444,273.80	2.04
252	603039	泛微网络	23,402,594.10	2.03
253	300366	创意信息	23,385,998.72	2.03
254	300661	圣邦股份	23,298,412.00	2.02
255	603688	石英股份	23,241,013.12	2.02
256	300457	赢合科技	23,227,825.50	2.02
257	603906	龙蟠科技	23,141,384.36	2.01
258	002236	大华股份	23,094,664.56	2.01
259	002048	宁波华翔	23,081,059.86	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	18,450,908,435.89
卖出股票收入（成交）总额	17,571,413,117.58

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无余额。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

无余额。

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

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

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

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
无。

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	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	11,004.93
5	应收申购款	332,890.38
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	343,895.31

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
中信建投量化进取A	15,900	49,667.54	15,416,076.03	1.9521%	774,297,829.82	98.0479%
中信建投量化进取C	5,050	51,460.32	6,603,381.20	2.5410%	253,271,222.38	97.4590%
合计	20,654	50,817.69	22,019,457.23	2.0979%	1,027,569,052.20	97.9021%

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	中信建投量化进取A	1,809,807.95	0.2292%
	中信建投量化进取C	133,996.91	0.0516%
	合计	1,943,804.86	0.1852%

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	中信建投量化进取A	>100
	中信建投量化进取C	0
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	中信建投量化进取A	0
	中信建投量化进取C	0
	合计	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

	中信建投量化进取A	中信建投量化进取C
基金合同生效日(2021年03月09日)基金份额总额	927,254,063.16	373,861,421.81
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	368,143,285.10	121,469,962.06
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	505,683,442.41	235,456,780.29
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	789,713,905.85	259,874,603.58

§ 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

2021年2月26日，黄凌先生担任基金管理人董事长、法定代表人，蒋月勤先生不再担任基金管理人董事长、法定代表人。

2021年6月11日，方俊才先生担任基金管理人副总经理。

2021年9月17日，张乐久先生不再担任基金管理人督察长，总经理金强先生代行督察长职务。

2021年11月18日，朱伟先生担任基金管理人督察长，总经理金强先生不再代行督察长职务。

2021年3月15日，基金托管人对外公告，李庆萍女士因工作安排原因，辞去基金托管人董事长、执行董事及董事会战略发展委员会主席和委员职务。

2021年6月23日，基金托管人收到《中国银保监会关于中信银行朱鹤新任职资格的批复》（银保监[2021]492号），中国银行保险监督管理委员会（简称“银保监会”）已核准朱鹤新先生担任基金托管人非执行董事、董事长的任职资格。

2021年9月4日，基金托管人收到已完成法定代表人变更的工商登记手续的通知，自2021年9月2日起，法定代表人由李庆萍女士变更为朱鹤新先生。

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80,000.00元整，该审计机构自2021年3月9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

本报告期内，基金管理人、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

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	2	36,004,613,564.31	100.00%	21,603,033.74	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（60%）+特别研究服务（20%）+综合研究服务（20%）。基础研究服务占60%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；特别研究服务占20%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。

11.8 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	中信建投量化进取6个月持有期混合型证券投资基金基金合同	规定网站	2021-02-04
2	中信建投量化进取6个月持有期混合型证券投资基金托管协议	规定网站	2021-02-04
3	中信建投量化进取6个月持有期混合型证券投资基金招募说明书	规定网站	2021-02-04
4	中信建投量化进取6个月持有期混合型证券投资基金基金产品资料概要	规定网站	2021-02-04
5	中信建投量化进取6个月持有期混合型证券投资基金基金份额发售公告	规定报刊、规定网站	2021-02-04
6	中信建投量化进取6个月持	规定报刊	2021-02-04

	有期混合型证券投资基金基金合同及招募说明书提示性公告		
7	关于中信建投量化进取6个月持有期混合型证券投资基金开展直销机构认购、申购费率优惠活动的公告	规定报刊、规定网站	2021-02-19
8	关于中信建投量化进取6个月持有期混合型证券投资基金增加代销机构的公告	规定报刊、规定网站	2021-02-22
9	关于中信建投量化进取6个月持有期混合型证券投资基金增加中信建投期货有限公司为代销机构的公告	规定报刊、规定网站	2021-02-24
10	中信建投基金管理有限公司高级管理人员变更公告	规定报刊、规定网站	2021-02-27
11	中信建投量化进取6个月持有期混合型证券投资基金基金合同生效公告	规定报刊、规定网站	2021-03-10
12	中信建投基金管理有限公司关于中信建投量化进取6个月持有期混合型证券投资基金投资科创板上市股票及相关风险揭示的公告	规定报刊、规定网站	2021-03-12
13	中信建投量化进取6个月持有期混合型证券投资基金开放日常申购业务公告	规定报刊、规定网站	2021-03-24
14	关于中信建投量化进取6个月持有期混合型证券投资基金增加上海基煜基金销售有限公司为代销机构并参加费率优惠活动的公告	规定报刊、规定网站	2021-03-25
15	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金在东方财富	规定报刊、规定网站	2021-03-26

	富证券股份有限公司开通定期定额投资业务并参加费率优惠活动的公告		
16	关于中信建投量化进取6个月持有期混合型证券投资基金在中信建投证券股份有限公司开通定期定额投资业务并参加费率优惠活动的公告	规定报刊、规定网站	2021-04-01
17	中信建投基金管理有限公司关于公司股东变更的公告	规定报刊、规定网站	2021-04-07
18	中信建投基金管理有限公司关于完成股东变更工商变更登记的公告	规定报刊、规定网站	2021-04-10
19	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	规定报刊、规定网站	2021-04-28
20	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加海银基金销售有限公司为代销机构并开通定期定额投资业务的公告	规定报刊、规定网站	2021-05-12
21	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	规定报刊、规定网站	2021-05-20
22	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加蚂蚁（杭州）基金销售有限公司为代销机构、开通定期定额投资业务并调整申购起点金额的公告	规定报刊、规定网站	2021-05-20
23	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	规定报刊、规定网站	2021-06-02
24	中信建投基金管理有限公司	规定报刊、规定网站	2021-06-12

	高级管理人员变更公告		
25	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加北京唐鼎耀华基金销售有限公司为代销机构并开通定期定额投资业务的公告	规定报刊、规定网站	2021-06-15
26	关于中信建投量化进取6个月持有期混合型证券投资基金在中信银行股份有限公司开通定期定额投资业务的公告	规定报刊、规定网站	2021-06-24
27	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	规定报刊、规定网站	2021-06-30
28	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	规定报刊、规定网站	2021-07-08
29	中信建投基金管理有限公司旗下部分基金2021年第2季度报告提示性公告	规定报刊	2021-07-21
30	中信建投量化进取6个月持有期混合型证券投资基金2021年第2季度报告	规定网站	2021-07-21
31	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加联储证券有限责任公司为代销机构并开通定期定额投资业务的公告	规定报刊、规定网站	2021-07-22
32	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	规定报刊、规定网站	2021-07-22
33	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调整定	规定报刊、规定网站	2021-07-24

	投起点金额的公告		
34	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	规定报刊、规定网站	2021-07-28
35	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	规定报刊、规定网站	2021-07-29
36	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加上海利得基金销售有限公司为代销机构并开通定期定额投资业务的公告	规定报刊、规定网站	2021-08-05
37	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	规定报刊、规定网站	2021-08-13
38	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加珠海盈米基金销售有限公司为代销机构并开通定期定额投资业务的公告	规定报刊、规定网站	2021-08-19
39	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金在上海天天基金销售有限公司开通定期定额投资业务的公告	规定报刊、规定网站	2021-08-30
40	中信建投基金管理有限公司旗下部分基金2021年中期报告提示性公告	规定报刊	2021-08-31
41	中信建投量化进取6个月持有期混合型证券投资基金2021年中期报告	规定网站	2021-08-31
42	中信建投量化进取6个月持有期混合型证券投资基金开放日常赎回业务公告	规定报刊、规定网站	2021-09-06

43	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	规定报刊、规定网站	2021-09-08
44	中信建投基金管理有限公司关于调整旗下部分基金在上海天天基金销售有限公司认、申购及定投金额起点的公告	规定报刊、规定网站	2021-09-14
45	中信建投基金管理有限公司高级管理人员变更公告	规定报刊、规定网站	2021-09-18
46	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加上海长量基金销售有限公司为代销机构并调整申购起点金额、开通定期定额投资业务的公告	规定报刊、规定网站	2021-09-27
47	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加北京广源达信基金销售有限公司为代销机构并调整认购、申购起点金额、开通定期定额投资业务的公告	规定报刊、规定网站	2021-10-15
48	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	规定报刊、规定网站	2021-10-16
49	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	规定报刊、规定网站	2021-10-21
50	中信建投基金管理有限公司旗下部分基金2021年第3季度报告提示性公告	规定报刊	2021-10-27
51	中信建投量化进取6个月持有期混合型证券投资基金2021年第3季度报告	规定网站	2021-10-27

52	关于中信建投量化进取6个月持有期混合型证券投资基金增加招商银行股份有限公司为代销机构并开通定期定额投资业务的公告	规定报刊、规定网站	2021-11-19
53	中信建投基金管理有限公司高级管理人员变更公告	规定报刊、规定网站	2021-11-19
54	中信建投量化进取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	2021-12-03
55	中信建投量化进取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	2021-12-03
56	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	规定报刊、规定网站	2021-12-10
57	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（一）	规定报刊、规定网站	2021-12-11
58	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（二）	规定报刊、规定网站	2021-12-11
59	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加腾安基金销售（深圳）有限公司为代销机构并开通定期定额投资业务的公告	规定报刊、规定网站	2021-12-13
60	中信建投基金管理有限公司关于变更客服邮箱的公告	规定报刊、规定网站	2021-12-18
61	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	规定报刊、规定网站	2021-12-18

§ 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、《中信建投量化进取6个月持有期混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《中信建投量化进取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
二〇二二年三月三十一日