

信诚量化阿尔法股票型证券投资基金

2022 年第 4 季度报告

2022 年 12 月 31 日

基金管理人：中信保诚基金管理有限公司

基金托管人：中国建设银行股份有限公司

报告送出日期：2023 年 01 月 17 日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 01 月 16 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2022 年 10 月 01 日起至 2022 年 12 月 31 日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

| | |
|------------|--------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| 基金简称 | 信诚量化阿尔法 |
| 基金主代码 | 004716 |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2017 年 07 月 12 日 |
| 报告期末基金份额总额 | 412,901,581.25 份 |
| 投资目标 | 本基金通过量化模型精选股票, 在严格控制风险的前提下, 力争获取超越业绩比较基准的投资回报, 谋求基金资产的长期增值。 |
| 投资策略 | <p>(1) 大类资产：本基金作为较高仓位的股票基金，将从宏观面、政策面、基本面和资金面等纬度进行综合分析，根据市场情况在本基金的投资范围内进行适度动态配置，在控制风险的前提下，通过定性与定量的研究来构建基金资产的配置。</p> <p>(2) 股票资产：以沪深 300 指数为基准指数，基金股票投资方面将主要采用多因子模型量化投资策略，在适度控制跟踪误差的同时，追求更高的超额收益；并以套利、事件驱动等辅助策略，增强基金整体收益。基金将根据投资组合相对业绩比较基准的暴露度等因素的分析，对组合收益进行预估，及时调整投资组合，力求获得更大的超额收益。主策略模型的基本逻辑</p> |

| | |
|--------|-------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| | <p>是用基本面因子和市场因子建立量化模型选择股票，并控制风险，以期构建投资组合跑赢市场基准。即：</p> <p>1) 从公司基本面出发，构建量化指标从财务状况、经营情况等角度选择公司股票，作为量化模型的备选池；</p> <p>2) 综合基本面因子、市场因子，选取标的作为待选组合。</p> <p>3) 构建组合时适度控制规模因子、行业偏离，减小风险暴露。</p> <p>(3) 债券资产：本基金基于流动性管理及策略性投资的需要，将投资于债券、货币市场工具和资产支持证券，以保证基金资产流动性，有效利用基金资产，提高基金资产的投资收益。</p> <p>(4) 股指期货和权证资产</p> <p>本基金可投资股指期货、权证和其他经中国证监会允许的金融衍生产品。</p> <p>基金管理人可运用股指期货，以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中将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，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。此外，本基金还将运用股指期货来对冲诸如预期大额申购赎回、大量分红等特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理。</p> <p>本基金将按照相关法律法规通过利用权证进行套利、避险交易，控制基金组合风险，获取超额收益。本基金进行权证投资时，将在对权证标的证券进行基本面研究及估值的基础上，结合股价波动率等参数，运用数量化定价模型，确定其合理内在价值，构建交易组合。</p> <p>(5) 资产支持证券投资策略</p> <p>对于资产支持证券，本基金将综合考虑市场利率、发行条款、支持资产的构成和质量等因素，研究资产支持证券的收益和风险匹配情况，采用数量化的定价模型跟踪债券的价格走势，在严格控制投资风险的基础上选择合适的投资对象以获得稳定收益。</p> <p>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，本基金可以相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书更新或相关公告中公告。</p> <p>(6) 存托凭证投资策略</p> <p>本基金将根据本基金的投资目标和股票投资策略，深入研究基础证券投资价值，选择投资价值较高的存托凭证进行投资。</p> |
| 业绩比较基准 | 沪深 300 指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5% |
| 风险收益特征 | 本基金为股票型基金,属于高预期风险、高预期收益的证券投资基金品种,其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金 |

| | | |
|-----------------|------------------|-----------------|
| | 与货币市场基金。 | |
| 基金管理人 | 中信保诚基金管理有限公司 | |
| 基金托管人 | 中国建设银行股份有限公司 | |
| 下属分级基金的基金简称 | 信诚量化阿尔法 A | 信诚量化阿尔法 C |
| 下属分级基金的交易代码 | 004716 | 011295 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 376,635,899.18 份 | 36,265,682.07 份 |

注：本基金管理人法定名称于 2017 年 12 月 18 日起变更为“中信保诚基金管理有限公司”。

本基金管理人已于 2017 年 12 月 20 日在中国证监会指定媒介以及公司网站上刊登了公司法定名称变更的公告。

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2022 年 10 月 01 日-2022 年 12 月 31 日） | |
|-----------------|----------------------------------------|---------------|
| | 信诚量化阿尔法 A | 信诚量化阿尔法 C |
| 1. 本期已实现收益 | -4,494,872.43 | -233,920.74 |
| 2. 本期利润 | 14,513,339.07 | 632,129.64 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | 0.0384 | 0.0200 |
| 4. 期末基金资产净值 | 553,214,555.02 | 31,189,738.93 |
| 5. 期末基金份额净值 | 1.4688 | 0.8600 |

注：1、上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。

2、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。

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

信诚量化阿尔法 A

| 阶段 | 净值增长率 ① | 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 | 2.69% | 1.22% | 1.69% | 1.23% | 1.00% | -0.01% |
| 过去六个月 | -10.47% | 1.03% | -13.00% | 1.05% | 2.53% | -0.02% |

| | | | | | | |
|------------|---------|-------|---------|-------|--------|--------|
| 过去一年 | -17.89% | 1.19% | -20.58% | 1.22% | 2.69% | -0.03% |
| 过去三年 | 27.42% | 1.22% | -4.89% | 1.24% | 32.31% | -0.02% |
| 过去五年 | 44.59% | 1.23% | -3.20% | 1.23% | 47.79% | 0.00% |
| 自基金合同生效起至今 | 54.41% | 1.19% | 5.83% | 1.19% | 48.58% | 0.00% |

信诚量化阿尔法 C

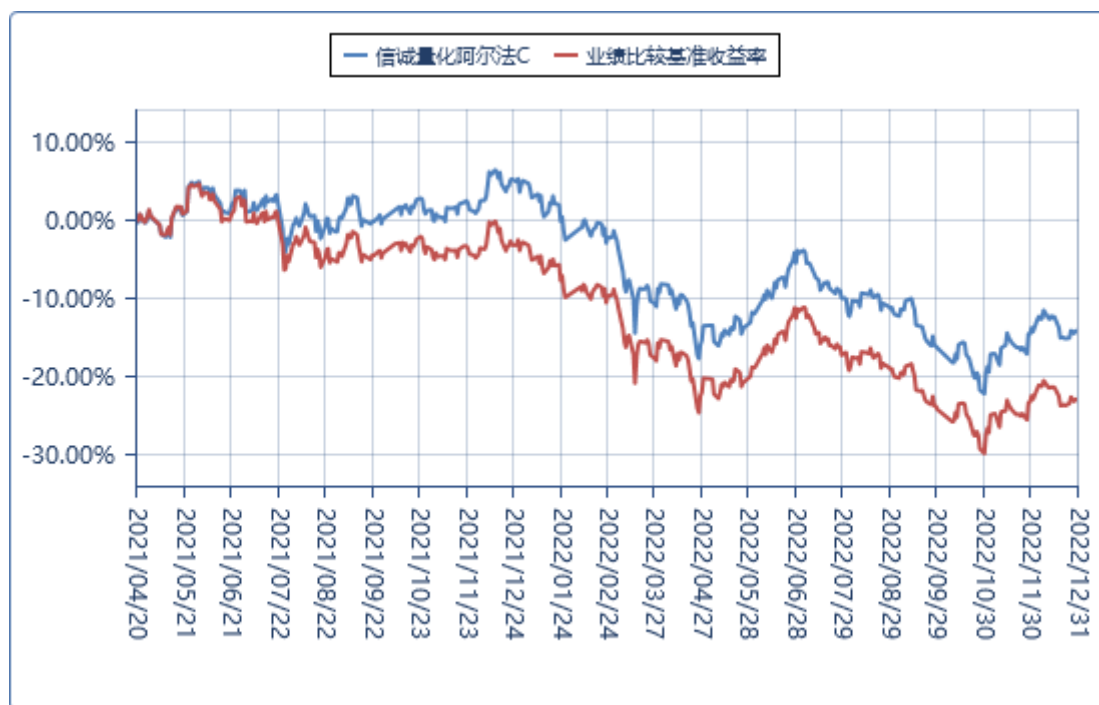
| 阶段 | 净值增长率 ① | 净值增长率 标准差② | 业绩比较基 准收益率③ | 业绩比较基 准收益率标 准差④ | ①-③ | ②-④ |
|------------|------------|---------------|----------------|-----------------------|-------|--------|
| 过去三个月 | 2.59% | 1.22% | 1.69% | 1.23% | 0.90% | -0.01% |
| 过去六个月 | -10.65% | 1.03% | -13.00% | 1.05% | 2.35% | -0.02% |
| 过去一年 | -18.22% | 1.19% | -20.58% | 1.22% | 2.36% | -0.03% |
| 自基金合同生效起至今 | -14.00% | 1.10% | -22.72% | 1.11% | 8.72% | -0.01% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

信诚量化阿尔法 A



信诚量化阿尔法 C



§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|-----|-------------|-------------|------|--------|------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 提云涛 | 量化投资总监、基金经理 | 2017年07月12日 | - | 22 | 提云涛先生，经济学博士。曾任职于大鹏证券股份有限公司上海分公司，担任研究部分析师；于东方证券有限责任公司，担任研究所所长助理；于上海申银万国证券研究所，历任宏观策略部副总监、金融工程部总监；于平安资产管理有限责任公司，担任量化投研部总经理；于中信证券股份有限公司，担任研究部金融工程总监。2015年6月加入中信保诚基金管理有限公司，担任量化投资 |

| | | | | | |
|----|------|------------------|---|---|----------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------------|
| | | | | | 总监。现兼任信诚至瑞灵活配置混合型证券投资基金、信诚至选灵活配置混合型证券投资基金、信诚新选回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚新旺回报灵活配置混合型证券投资基金 (LOF)、信诚量化阿尔法股票型证券投资基金、中信保诚红利精选混合型证券投资基金的基金经理。 |
| 王颖 | 基金经理 | 2022 年 03 月 24 日 | - | 9 | 王颖女士，经济学硕士。曾任职于平安资产管理有限责任公司，担任研究经理。2016 年 9 月加入中信保诚基金管理有限公司，历任助理投资经理、基金经理助理。现任信诚至利灵活配置混合型证券投资基金、信诚新锐回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚至诚灵活配置混合型证券投资基金、信诚新选回报灵活配置混合型证券投资基金、信诚量化阿尔法股票型证券投资基金的基金经理。 |

注：1. 上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2. 证券从业年限计算标准遵从中国证监会《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》中关于证券基金从业人员范围的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

在本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》和其他相关法律法规的规定以及《信诚量化阿尔法股票型证券投资基金基金合同》、《信诚量化阿尔法股票型证券投资基金招募说明书》的约定，本

着诚实信用、勤勉尽职的原则管理和运用基金财产。本基金管理人通过不断完善法人治理结构和内部控制制度,加强内部管理,规范基金运作。本报告期内,基金运作合法合规,没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》,以及公司拟定的《信诚基金管理有限公司公平交易及异常交易管理制度》,公司采取了一系列的行动落实公平交易管理的各项要求。各部门在公平交易执行中各司其职,研究分析方面,公司通过统一的研究平台发布研究成果,并构建投资备选库、交易对手库、风格维度库等,确保所有投资经理在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会;在交易端,公司管理的不同投资组合执行集中交易制度,不同投资组合同时同向交易同一证券时需通过交易系统内的公平交易程序,确保各投资组合享有公平的交易执行机会;对于债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义进行的交易,按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配;同时,公司每个季度对旗下所有投资组合同向交易、反向交易以及债券一级市场申购、非公开发行股票申购等交易进行统计分析,并要求相关投资组合经理对异常交易情况进行合理性解释。

本期公司整体公平交易制度执行情况良好,未发现违背公平交易的相关情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

公司对旗下所有产品的交易价格、产品投资杠杆、集中度、反向交易等进行控制,事后根据《信诚基金管理有限公司公平交易及异常交易管理制度》定期对相关情况进行汇总和统计分析,相关情况由投资经理出具情况说明后签字确认。报告期内,本基金与公司旗下管理的其它产品之间未出现参与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%的交易(完全复制的指数基金除外)。未发生主动投资杠杆超标情况。对于债券交易价格监控结果,每日、每周对现券、回购交易价格偏离及回购投资情况按照要求进行统计,并对需要上报的情况按时进行上报。

本报告期内,未发现投资组合之间有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

四季度,经济景气水平总体回落。制造业 PMI 指数低于 50, 10、11、12 月份分别为 49.2%、48.0%、

47.0%；非制造业商务活动指数也均低于 50，分别为 48.7%、46.7%、41.6%。从经济各部分看，工业生产有所回落，服务业生产放缓，市场销售略减。在经济活动有所回落背景下，政策更趋向积极。中央经济工作会议提出“稳增长、稳就业、稳物价”，提振市场信心。货币政策，央行采取积极稳健的货币政策，虽然资金利率中枢在 11 月有所波动，但基本保持平稳。海外经济，美联储的加息效果有所显现，通胀有所放缓，经济活跃度下降。虽然美联储在 12 月份加息 50BP，较之前放缓了加息步伐，但因为普通就业市场仍然较高，预期后续仍将维持偏紧的政策。后续经济活动将继续下降。

股票市场，先抑后扬之后盘整，沪深 300、中证 500、中证 1000 均下跌、反弹、盘整。沪深 300、中证 500、中证 1000 分别涨 1.75%、2.63%、2.56%。从行业看，各行业同样表现不一，休闲服务、计算机、传媒、医药生物、商业贸易等涨幅居前；采掘、电气设备、有色金属等下跌。债券市场，因为对利率向常态回归和资金的调整，在 11 月有所调整，之后企稳回归常态。

四季度，我们认为投资价值而不是交易价格更有助基金获取收益。本基金继续综合盈利能力、偿债能力、盈利增长、估值和交易等多种因素来考察标的，力求从长期统计规律和金融逻辑的交集构建股票组合，并适当控制行业暴露和规模因子暴露，在交易频率上继续保持低换手率特征。同时，以阿尔法因子和风控因子并重来控制可能的出现的风险，以期获得相对稳定的超额收益。同时，本基金用股指期货多头套保管理流动性，并参与网下新股申购。

展望 2023 年一季度，海外，预计美国欧洲的经济增长将继续放缓。国内，随着稳经济政策和持续政策效能释放，预期经济活动将恢复。货币政策方面，出口放缓叠加海外流动性收紧对人民币汇率形成一定压力，可能影响短期央行进一步宽松，但预期后续货币政策将继续保持稳健态势以维护经济增长。股票市场，预期后续将更乐观。一方面，虽然海外需求可能下降，但随着国内社会经济活动的进一步恢复，受影响的企业的盈利也将恢复，经济增长将回归常态，传统行业将有所表现。另一面，部分代表未来经济和产业方向新兴产业公司的营收和利润也将保持增长，同时经过调整估值也更趋合理，也可能有所表现。债券市场，预期稳增长政策将继续，在外部经济不佳的情况下，预期货币政策仍将相对积极。

从投资看，我们认为投资价值而不是交易价格更有助基金获取收益。继续以稳定跑赢业绩基准为目标。本基金继续综合盈利能力、偿债能力、盈利增长、估值和交易等多种因素来考察标的，力求从长期统计规律和金融逻辑的交集构建选股模型，并适当控制行业暴露和规模因子暴露，在交易频率上继续保持低换手率特征。同时，以阿尔法因子和风控因子并重来控制可能的出现的风险。同时，本基金用股指期货多头套保管理流动性，适当参与网下新股申购等提高收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内，信诚量化阿尔法 A 份额净值增长率为 2.69%，同期业绩比较基准收益率为 1.69%；信诚量化阿尔法 C 份额净值增长率为 2.59%，同期业绩比较基准收益率为 1.69%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内，本基金未出现连续 20 个工作日基金资产净值低于五千万元（基金份额持有人数量不满二百人）的情形。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额（元） | 占基金总资产的比例（%） |
|----|-------------------|----------------|--------------|
| 1 | 权益投资 | 543,925,271.96 | 92.85 |
| | 其中：股票 | 543,925,271.96 | 92.85 |
| 2 | 基金投资 | - | - |
| 3 | 固定收益投资 | 30,671,251.26 | 5.24 |
| | 其中：债券 | 30,671,251.26 | 5.24 |
| | 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 | 10,093,477.95 | 1.72 |
| 8 | 其他资产 | 1,122,110.43 | 0.19 |
| 9 | 合计 | 585,812,111.60 | 100.00 |

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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 | 5,066,984.00 | 0.87 |
| B | 采矿业 | 19,157,282.00 | 3.28 |
| C | 制造业 | 310,959,402.13 | 53.21 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 17,164,095.00 | 2.94 |
| E | 建筑业 | 7,476,600.00 | 1.28 |
| F | 批发和零售业 | 7,761,715.00 | 1.33 |

| | | | |
|---|-----------------|----------------|-------|
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | 18,585,129.00 | 3.18 |
| H | 住宿和餐饮业 | - | - |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 21,684,667.76 | 3.71 |
| J | 金融业 | 113,649,075.00 | 19.45 |
| K | 房地产业 | 10,555,940.00 | 1.81 |
| L | 租赁和商务服务业 | 6,413,896.68 | 1.10 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 4,055,361.19 | 0.69 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 38,283.70 | 0.01 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 1,351,236.00 | 0.23 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 5,604.50 | 0.00 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 543,925,271.96 | 93.07 |

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

| 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 | 600519 | 贵州茅台 | 20,400 | 35,230,800.00 | 6.03 |
| 2 | 600036 | 招商银行 | 458,400 | 17,079,984.00 | 2.92 |
| 3 | 000858 | 五粮液 | 79,000 | 14,274,510.00 | 2.44 |
| 4 | 601166 | 兴业银行 | 698,400 | 12,284,856.00 | 2.10 |
| 5 | 601318 | 中国平安 | 231,600 | 10,885,200.00 | 1.86 |
| 6 | 600309 | 万华化学 | 101,400 | 9,394,710.00 | 1.61 |
| 7 | 600900 | 长江电力 | 418,900 | 8,796,900.00 | 1.51 |
| 8 | 000568 | 泸州老窖 | 37,500 | 8,410,500.00 | 1.44 |
| 9 | 300059 | 东方财富 | 432,700 | 8,394,380.00 | 1.44 |
| 10 | 601601 | 中国太保 | 335,400 | 8,224,008.00 | 1.41 |

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

| 序号 | 债券品种 | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|------|---------------|--------------|
| 1 | 国家债券 | 30,671,251.26 | 5.25 |
| 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） | - | - |
| 8 | 同业存单 | - | - |
| 9 | 其他 | - | - |
| 10 | 合计 | 30,671,251.26 | 5.25 |

5.5 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债券投资明细

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 数量（张） | 公允价值（元） | 占基金资产净值比例（%） |
|----|--------|----------|---------|---------------|--------------|
| 1 | 019629 | 20 国债 03 | 207,000 | 21,091,927.56 | 3.61 |
| 2 | 019663 | 21 国债 15 | 95,000 | 9,579,323.70 | 1.64 |

注：本基金本报告期末仅持有上述债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

| 代码 | 名称 | 持仓量（买/卖） | 合约市值（元） | 公允价值变动（元） | 风险说明 |
|-------------------|--------|----------|--------------|-----------|---------------|
| IF2301 | IF2301 | 3 | 3,497,400.00 | 7,740.00 | - |
| IF2303 | IF2303 | 3 | 3,513,780.00 | -2,486.66 | - |
| IF2306 | IF2306 | 1 | 1,168,560.00 | 25,920.00 | - |
| 公允价值变动总额合计（元） | | | | | 31,173.34 |
| 股指期货投资本期收益（元） | | | | | -1,324,537.73 |
| 股指期货投资本期公允价值变动（元） | | | | | 1,440,813.34 |

注：按照股指期货每日无负债结算的结算规则、《证券投资基金股指期货投资会计业务核算细则(试行)》及《企业会计准则-金融工具列报》的相关规定，“其他衍生工具-股指期货投资”与“证券清算款-股指期货每日无负债结算暂收暂付款”，符合金融资产与金融负债相抵销的条件，故将“其他衍生工具-股指期货投资”的期末公允价值以抵销后的净额列报，净额为零。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

基金管理人可运用股指期货,以提高投资效率更好地达到本基金的投资目标。本基金在股指期货投资中将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,本着谨慎原则,参与股指期货的投资,以管理投资组合的系统性风险,改善组合的风险收益特性。此外,本基金还将运用股指期货来对冲诸如预期大额申购赎回、大量分红等特殊情况下的流动性风险以进行有效的现金管理。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金投资范围不包括国债期货投资。

5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期内未进行国债期货投资。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未进行国债期货投资。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 基金投资前十名证券的发行主体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、处罚说明

本基金投资的前十名证券的发行主体中,报告编制日前一年内,招商银行股份有限公司受到中国银行保险监督管理委员会、中国人民银行处罚(银保监罚决字[2022]21号、银保监罚决字[2022]48号、银罚决字[2022]1号);兴业银行股份有限公司受到中国银行保险监督管理委员会处罚(银保监罚决字[2022]22号、银保监罚决字[2022]41号、银保监罚决字[2022]50号);中国平安保险(集团)股份有限公司受到国家外汇管理局深圳市分局处罚(深外管检[2022]23号)。

对前述发行主体发行证券的投资决策程序的说明：本基金管理人定期回顾、长期跟踪研究相关投资标的的经营情况，我们认为，该处罚事项未对前述发行主体的长期企业经营和投资价值产生实质性影响。我们对相关投资标的的投资严格执行内部投资决策流程，符合法律法规和公司制度的规定。

除此之外，其余本基金投资的前十名证券的发行主体没有被中国人民银行及分支机构、中国证券监督管理委员会及其派出机构、中国银行保险监督管理委员会及其派出机构、国家外汇管理局及其分支机构立案调查，或在报告编制日前一年内受到前述监管机构公开谴责、处罚。

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定备选库之外的股票。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额（元） |
|----|---------|--------------|
| 1 | 存出保证金 | 1,013,198.95 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | - |
| 4 | 应收利息 | - |
| 5 | 应收申购款 | 108,911.48 |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 1,122,110.43 |

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末持有的前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| 项目 | 信诚量化阿尔法 A | 信诚量化阿尔法 C |
|----|-----------|-----------|
|----|-----------|-----------|

| | | |
|---------------------------|----------------|---------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 377,362,883.30 | 29,506,444.05 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 7,524,884.28 | 10,927,967.76 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 8,251,868.40 | 4,168,729.74 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 376,635,899.18 | 36,265,682.07 |

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期，基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

无

§ 9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、信诚量化阿尔法股票型证券投资基金相关批准文件
- 2、中信保诚基金管理有限公司营业执照
- 3、信诚量化阿尔法股票型证券投资基金基金合同
- 4、信诚量化阿尔法股票型证券投资基金招募说明书
- 5、本报告期内按照规定披露的各项公告

10.2 存放地点

基金管理人和/或基金托管人住所。

10.3 查阅方式

投资者可在营业时间至公司办公地点免费查阅，也可按工本费购买复印件。

亦可通过公司网站查阅，公司网址为 www.citicprufunds.com.cn。

中信保诚基金管理有限公司

2023 年 01 月 17 日