

# 中信建投量化精选 6 个月持有期混合型证券投资基金

## 2022 年年度报告

2022 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:2023 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2023年3月30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2022年1月1日起至12月31日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	11
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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	15
§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	21
7.3 净资产（基金净值）变动表	22
7.4 报表附注	25
§8 投资组合报告	64
8.1 期末基金资产组合情况	64
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	65
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	65
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	81
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	90
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	90
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 本基金投资股指期货的投资政策	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 .....	91
§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 .....	92
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 .....	93
§11 重大事件揭示 .....	93
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	93
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 .....	93
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 .....	94
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	94
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 .....	94
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	94
11.8 其他重大事件 .....	95
§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....	100
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 .....	100
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	100
§13 备查文件目录 .....	100
13.1 备查文件目录 .....	100
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	中信建投量化精选6个月持有期混合型证券投资基金	
基金简称	中信建投量化精选6个月持有期混合	
基金主代码	012878	
基金运作方式	契约型开放式、对每份基金份额设置6个月的最短持有期	
基金合同生效日	2021年07月27日	
基金管理人	中信建投基金管理有限公司	
基金托管人	中信银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	601,062,784.69份	
基金合同存续期	不定期	
下属各类别基金的基金简称	中信建投量化精选6个月持有期混合A	中信建投量化精选6个月持有期混合C
下属各类别基金的交易代码	012878	012879
报告期末下属各类别基金的份额总额	201,708,270.95份	399,354,513.74份

### 2.2 基金产品说明

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

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

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	中信建投基金管理有限公司	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	朱伟
	联系电话	010-59100208
	电子邮箱	zhuweibj@csc.com.cn
客户服务电话	4009-108-108	95558
传真	010-59100298	010-85230024
注册地址	北京市怀柔区桥梓镇八龙桥雅苑3号楼1室	北京市朝阳区光华路10号院1号楼6-30层、32-42层
办公地址	北京市东城区朝阳门内大街2号凯恒中心B座17、19层	北京市朝阳区光华路10号院1号楼6-30层、32-42层
邮政编码	100010	100020
法定代表人	黄凌	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	2022年		2021年07月27日(基金合同生效日)-2021年12月31日	
	中信建投量化精选6个月持有期混合A	中信建投量化精选6个月持有期混合C	中信建投量化精选6个月持有期混合A	中信建投量化精选6个月持有期混合C
本期已实现收益	-40,736,180.17	-86,481,003.76	-9,863,106.02	-22,222,671.34
本期利润	-41,992,146.84	-91,216,946.36	-10,264,293.74	-22,922,283.03
加权平均基金份额本期利润	-0.1847	-0.1957	-0.0405	-0.0410
本期加权平均净值利润率	-21.76%	-23.11%	-4.09%	-4.15%
本期基金份额净值增长率	-18.33%	-18.65%	-3.74%	-3.91%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	2022年末		2021年末	
期末可供分配利润	-43,129,097.56	-87,183,927.44	-9,765,792.08	-22,333,137.66
期末可供分配基金份额利润	-0.2138	-0.2183	-0.0374	-0.0391
期末基金资产净值	158,579,173.39	312,170,586.30	251,066,598.11	548,909,865.22
期末基金份额净值	0.7862	0.7817	0.9626	0.9609
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	2022年末		2021年末	
基金份额累计净值增长率	-21.38%	-21.83%	-3.74%	-3.91%

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

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

分)。

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中信建投量化精选6个月持有期混合A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-2.10%	0.95%	1.48%	1.03%	-3.58%	-0.08%
过去六个月	-11.39%	0.98%	-10.73%	0.88%	-0.66%	0.10%
过去一年	-18.33%	1.27%	-16.91%	1.02%	-1.42%	0.25%
自基金合同生效起至今	-21.38%	1.15%	-16.34%	0.96%	-5.04%	0.19%

中信建投量化精选6个月持有期混合C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-2.20%	0.95%	1.48%	1.03%	-3.68%	-0.08%
过去六个月	-11.57%	0.98%	-10.73%	0.88%	-0.84%	0.10%
过去一年	-18.65%	1.27%	-16.91%	1.02%	-1.74%	0.25%
自基金合同生效起至今	-21.83%	1.15%	-16.34%	0.96%	-5.49%	0.19%

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



中信建投量化精选6个月持有期混合A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2021年07月27日-2022年12月31日)



中信建投量化精选6个月持有期混合C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2021年07月27日-2022年12月31日)



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



注：基金合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中信建投基金管理有限公司（以下简称“中信建投基金”）于2013年9月9日在北京成立，注册资本3亿元，中信建投证券股份有限公司全资控股。中信建投基金主要经营基金募集、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。

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

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

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王鹏	本基金的基金经理、指数与量化投资部行政负责人	2021-07-27	-	7年	中国籍，1984年8月生，哥伦比亚大学统计学硕士。曾任中财期货分析师、LCM Commodities研究员、CIBC World Market期权交易员、中金基金管理有限公司量化投资副总经理、中金睿投投资管理有限公司量化投资副总经理、中信建投证券股份有限公司量化投资总监。2019年2月加

					<p>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、中信建投中证1000指数增强型证券投资基金、中信建投沪深300指数增强型证券投资基金、中信建投红利智选混合型证券投资基金基金经理。</p>
--	--	--	--	--	---

注：1、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《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行，未发现不同投资组合之间存在非公平交易的情况。

### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，未发现本基金有可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

本报告期内，本基金管理人旗下所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，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的5%的交易共1次，为指数量化投资组合因投资策略需要发生的反向交易。

## 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

过去的2022年资本市场经历多重考验，有经济周期因素、美国持续加息因素，更有国内新冠疫情因素，其中新冠因素更是年内多次冲击经济数据和市场表现的核心变量，2022年中小盘波动高于大盘股，随着疫情的彻底放开，风险偏好和流动性逐步回升。本产品在此期间更为严格的控制了产品在行业市值上的风险暴露。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精选6个月持有期混合A基金份额净值为0.7862元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-18.33%，同期业绩比较基准收益率为-16.91%；截至报告期末中信建投量化精选6个月持有期混合C基金份额净值为0.7817元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-18.65%，同期业绩比较基准收益率为-16.91%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2023年1月，在疫情影响边际转向后，经济短周期基本面迎来快速修复。在2023年中国经济触底回升的预期中，A股市场1月份迎来较为强势的“开门红”行情。经济相关复苏板块领涨，外资相对看好中国市场未来前景，1月份外资持续流入规模再创单月新高达1125亿。在此背景下，市场并未受到节前交投清淡影响，走势持续超出市场预期。各大指数单月均录得较为不错的涨幅。我们有理由对国内权益市场继续维持乐观判断。疫

情影响趋弱，经济刺激政策频出，国内权益市场表现值得期待。随着经济见底回升，基本面数据持续得到验证，市场信心或将进一步得到提振。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

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

#### 4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

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

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

### §5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对中信建投量化精选6个月持有期混合型证券投资基金2022年的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

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

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

本托管人认为，中信建投基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的2022年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(2023)第24487号

#### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	中信建投量化精选6个月持有期混合型证券投资

	基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一) 我们审计的内容</p> <p>我们审计了中信建投量化精选6个月持有期混合型证券投资基金(以下简称"中信建投量化精选6个月持有期混合基金")的财务报表,包括2022年12月31日的资产负债表,2022年度的利润表和净资产(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")、中国证券投资基金业协会(以下简称"中国基金业协会")发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了中信建投量化精选6个月持有期混合基金2022年12月31日的财务状况以及2022年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的"注册会计师对财务报表审计的责任"部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于中信建投量化精选6个月持有期混合基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	<p>中信建投量化精选6个月持有期混合基金的基金管理人中信建投基金管理有限公司(以下简称"基金管理人")管理层对其他信息负责。其他信息包括中信建投量化精选6个月持有期混合基金2022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。</p>



	<p>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。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>基金管理人管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估中信建投量化精选6个月持有期混合基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算中信建投量化精选6个月持有期混合基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督中信建投量化精选6个月持有期混合基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这</p>

	<p>些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对中信建投量化精选6个月持有期混合基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致中信建投量化精选6个月持有期混合基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	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	2023-03-31	

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：中信建投量化精选6个月持有期混合型证券投资基金

报告截止日：2022年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	120,384,996.27	86,238,556.74
结算备付金		20,500,527.83	299,642.83
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	331,147,703.49	714,766,212.12
其中：股票投资		331,147,703.49	714,766,212.12
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		2,708.12	137,151.92

递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	16,376.43
资产总计		472,035,935.71	801,457,940.04
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2022年12月31日</b>	<b>上年度末 2021年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		274,611.97	-
应付管理人报酬		618,819.66	1,016,282.38
应付托管费		103,136.61	169,380.39
应付销售服务费		109,607.78	185,813.94
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	180,000.00	110,000.00
负债合计		1,286,176.02	1,481,476.71
<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.7	601,062,784.69	832,075,393.07
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.8	-130,313,025.00	-32,098,929.74
净资产合计		470,749,759.69	799,976,463.33
负债和净资产总计		472,035,935.71	801,457,940.04

注：报告截止日2022年12月31日，基金份额总额601,062,784.69份，其中A类基金份额净值0.7862元，基金份额201,708,270.95份；C类基金份额净值0.7817元，基金份额399,354,513.74份。

## 7.2 利润表

会计主体：中信建投量化精选6个月持有期混合型证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022年01月01日至2 022年12月31日	上年度可比期间 2021年07月27日(基 金合同生效日)至2 021年12月31日
一、营业总收入		-121,116,078.77	-16,364,206.89
1.利息收入		419,047.45	939,260.13
其中：存款利息收入	7.4.7.9	419,047.45	939,260.13
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)		-115,543,216.95	-16,202,667.61
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-125,146,164.93	-17,009,789.71
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	-	-
资产支持证券投资收 益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.12	-	-
股利收益	7.4.7.13	9,602,947.98	807,122.10
以摊余成本计量的金 融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益(损失 以“-”号填列)	7.4.7.14	-5,991,909.27	-1,100,799.41

4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		12,093,014.43	16,822,369.88
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	8,847,799.31	5,192,028.59
2. 托管费	7.4.10.2.2	1,474,633.27	865,338.08
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	1,585,266.78	951,820.52
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.16	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	7.4.7.17	185,315.07	9,813,182.69
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-133,209,093.20	-33,186,576.77
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-133,209,093.20	-33,186,576.77
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		-133,209,093.20	-33,186,576.77

### 7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：中信建投量化精选6个月持有期混合型证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年12月31日

单位：人民币元

项目	本期			
	2022年01月01日至2022年12月31日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净	832,075,393.07	-	-32,098,929.74	799,976,463.33

资产（基金净值）				
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	832,075,393.07	-	-32,098,929.74	799,976,463.33
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-231,012,608.38	-	-98,214,095.26	-329,226,703.64
（一）、综合收益总额	-	-	-133,209,093.20	-133,209,093.20
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-231,012,608.38	-	34,994,997.94	-196,017,610.44
其中：1.基金申购款	11,662,126.30	-	-1,789,796.05	9,872,330.25
2.基金赎回款	-242,674,734.68	-	36,784,793.99	-205,889,940.69
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-

四、本期期末净资产（基金净值）	601,062,784.69	-	-130,313,025.00	470,749,759.69
项目	上年度可比期间			
	2021年07月27日（基金合同生效日）至2021年12月31日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	782,620,738.32	-	-	782,620,738.32
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	49,454,654.75	-	-32,098,929.74	17,355,725.01
（一）、综合收益总额	-	-	-33,186,576.77	-33,186,576.77
（二）、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)	49,454,654.75	-	1,087,647.03	50,542,301.78
其中：1.基金申购款	49,454,654.75	-	1,087,647.03	50,542,301.78
2.基金赎回款	-	-	-	-
（三）、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)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	832,075,393.07	-	-32,098,929.74	799,976,463.33

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

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

根据《中信建投量化精选6个月持有期混合型证券投资基金招募说明书》,本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/申购时收取认购/申购费用的基金份额,称为A类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费、不收取认购/申购费用的基金份额,称为C类基金份额。本基金A类、C

类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中信建投量化精选6个月持有期混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含创业板及其他经中国证监会允许上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、证券公司短期公司债券、公开发行的次级债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为：股票（含存托凭证）资产占基金资产的60%-95%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券；其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率\*80%+中证综合债指数收益率\*20%。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2022年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2022年12月31日的财务状况以及2022年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

## 7.4.4 重要会计政策和会计估计

### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。比较财务报表的实际编制期间为2021年7月27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

#### 新金融工具准则

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

#### (1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

#### 债务工具

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

#### 以摊余成本计量：

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

#### 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

#### 权益工具

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

## (2)金融负债

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

## (3)衍生金融工具

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

原金融工具准则(截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则)

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

### (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。

### (3)衍生金融工具

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

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

##### 新金融工具准则

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

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

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

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

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

原金融工具准则(截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则)

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

##### 新金融工具准则

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

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

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

##### 原金融工具准则(截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则)

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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

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。

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

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。



#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

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

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告〔2017〕13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国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

财政部于2017年颁布了修订后的《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》及《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")，财政部、中国银行保险监督管理委员会于2020年12月30日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自2022年1月1日起执行新金融工具准则。此外，财政部于2022年颁布了《关于印发《资产管理产品相关会计处理规定》的通知》(财会[2022]14号)，中国证监会于2022年颁布了修订后的《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>》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金2022年度财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

##### (a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息和应收申购款，金额分别为 86,238,556.74 元、299,642.83 元、0.00 元、16,376.43 元和 137,151.92 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息和应收申购款，金额分别为 86,254,824.30 元、299,751.65 元、0.00 元、0.00 元和 137,151.97 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 714,766,212.12 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 714,766,212.12 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付管理人报酬、应付托管费和应付销售服务费，金额分别为 1,016,282.38 元、169,380.39 元和 185,813.94 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付管理人报酬、应付托管费和应付销售服务费，金额分别为 1,016,282.38 元、169,380.39 元和 185,813.94 元。

于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

#### (b) 《资产管理产品相关会计处理规定》

根据《资产管理产品相关会计处理规定》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

#### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

#### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税〔2002〕128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税〔2008〕1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税〔2012〕85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税〔2015〕101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税〔2016〕36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税〔2016〕46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税〔2016〕70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税〔2016〕140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税〔2017〕2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税〔2017〕56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税〔2017〕90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

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

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

(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 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
活期存款	14,517,859.49	59,066,915.71
等于：本金	14,514,405.11	59,066,915.71
加：应计利息	3,454.38	-
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
其中：存款期限1个月以 内	-	-
存款期限1-3个 月	-	-
存款期限3个月 以上	-	-
其他存款	105,867,136.78	27,171,641.03
等于：本金	105,861,139.88	27,171,641.03
加：应计利息	5,996.90	-
减：坏账准备	-	-
合计	120,384,996.27	86,238,556.74

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	338,240,412.17	-	331,147,703.49	-7,092,708.68
贵金属投资-金交	-	-	-	-

所黄金合约					
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		338,240,412.17	-	331,147,703.49	-7,092,708.68
项目		上年度末 2021年12月31日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		715,867,011.53	-	714,766,212.12	-1,100,799.41
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		715,867,011.53	-	714,766,212.12	-1,100,799.41

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

### 7.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
应收利息	-	16,376.43
其他应收款	-	-
待摊费用	-	-
合计	-	16,376.43

### 7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日	上年度末 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	-	-
应付交易费用	-	-
其中：交易所市场	-	-
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	180,000.00	110,000.00
合计	180,000.00	110,000.00

### 7.4.7.7 实收基金

#### 7.4.7.7.1 中信建投量化精选6个月持有期混合A

金额单位：人民币元

项目 (中信建投量化精选6个月持有期混合A)	本期 2022年01月01日至2022年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	260,832,390.19	260,832,390.19
本期申购	4,362,523.90	4,362,523.90
本期赎回(以“-”号填列)	-63,486,643.14	-63,486,643.14

本期末	201,708,270.95	201,708,270.95
-----	----------------	----------------

#### 7.4.7.7.2 中信建投量化精选6个月持有期混合C

金额单位：人民币元

项目 (中信建投量化精选6个月持有期混合C)	本期 2022年01月01日至2022年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	571,243,002.88	571,243,002.88
本期申购	7,299,602.40	7,299,602.40
本期赎回（以“-”号填列）	-179,188,091.54	-179,188,091.54
本期末	399,354,513.74	399,354,513.74

#### 7.4.7.8 未分配利润

##### 7.4.7.8.1 中信建投量化精选6个月持有期混合A

单位：人民币元

项目 (中信建投量化精选6个月持有期混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-9,650,427.13	-115,364.95	-9,765,792.08
本期利润	-40,736,180.17	-1,255,966.67	-41,992,146.84
本期基金份额交易产生的变动数	8,156,754.64	472,086.72	8,628,841.36
其中：基金申购款	-585,318.91	-121,521.66	-706,840.57
基金赎回款	8,742,073.55	593,608.38	9,335,681.93
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-42,229,852.66	-899,244.90	-43,129,097.56

##### 7.4.7.8.2 中信建投量化精选6个月持有期混合C

单位：人民币元

项目 (中信建投量化精选6个月持有期混合C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
---------------------------	-------	-------	---------

本期期初	-22,078,821.48	-254,316.18	-22,333,137.66
本期利润	-86,481,003.76	-4,735,942.60	-91,216,946.36
本期基金份额交易产生的变动数	23,162,639.45	3,203,517.13	26,366,156.58
其中：基金申购款	-944,643.99	-138,311.49	-1,082,955.48
基金赎回款	24,107,283.44	3,341,828.62	27,449,112.06
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-85,397,185.79	-1,786,741.65	-87,183,927.44

#### 7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至 2022年12月31日	上年度可比期间 2021年07月27日（基金合同生效 日）至2021年12月31日
活期存款利息收入	91,931.25	431,278.02
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	126,340.02	70,452.63
结算备付金利息收入	200,776.18	437,529.43
其他	-	0.05
合计	419,047.45	939,260.13

#### 7.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至 2022年12月31日	上年度可比期间 2021年07月27日（基金合同生效 日）至2021年12月31日
卖出股票成交总额	9,516,302,563.55	4,121,202,768.30
减：卖出股票成本总额	9,620,352,112.62	4,138,212,558.01
减：交易费用	21,096,615.86	-
买卖股票差价收入	-125,146,164.93	-17,009,789.71



#### 7.4.7.11 债券投资收益

无。

#### 7.4.7.12 衍生工具收益

无。

#### 7.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至 2022年12月31日	上年度可比期间 2021年07月27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	9,602,947.98	807,122.10
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	9,602,947.98	807,122.10

#### 7.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2022年01月01日至20 22年12月31日	上年度可比期间 2021年07月27日（基金合同生效日） 至2021年12月31日
1.交易性金融资产	-5,991,909.27	-1,100,799.41
——股票投资	-5,991,909.27	-1,100,799.41
——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	-5,991,909.27	-1,100,799.41

#### 7.4.7.15 其他收入

无。

#### 7.4.7.16 信用减值损失

无。

#### 7.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至 2022年12月31日	上年度可比期间 2021年07月27日（基金合同生效 日）至2021年12月31日
审计费用	60,000.00	60,000.00
信息披露费	120,000.00	50,000.00
证券出借违约金	-	-
汇划手续费	5,315.07	178.00
其他	-	400.00
交易费用	-	9,702,604.69
合计	185,315.07	9,813,182.69

#### 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

经基金管理人2021年度第六次临时股东会决议，并经中国证券监督管理委员会证监许可〔2022〕169号文批准，基金管理人股东航天科技财务有限责任公司将其持有的基金管理人25%的股权转让给中信建投证券股份有限公司。于2022年2月10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，中信建投证券股份有

限公司持有基金管理人100%股权。基金管理人已于2022年2月11日在规定媒介披露上述事项。

关联方名称	与本基金的关系
航天科技财务有限责任公司	基金管理人的原股东
中信银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
中信建投基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
元达信资本管理（北京）有限公司	基金管理人的子公司
中信建投证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构
中信建投期货有限公司	与基金管理人同一控股股东

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

无。

###### 7.4.10.1.2 权证交易

无。

###### 7.4.10.1.3 债券交易

无。

###### 7.4.10.1.4 债券回购交易

无。

###### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

无。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日	上年度可比期间 2021年07月27日（基金合同
----	-------------------	-----------------------------

	至2022年12月31日	生效日)至2021年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	8,847,799.31	5,192,028.59
其中：支付销售机构的客户维护费	4,382,503.71	2,567,568.29

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 2022年01月01日 至2022年12月31 日	上年度可比期间 2021年07月27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	1,474,633.27	865,338.08

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 2022年01月01日至2022年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中信建投量化精选6个月持有 期混合A	中信建投量化精选6个月持有 期混合C	合计
中信建投 基金管理 有限公司	0.00	783.09	783.09
中信建投 证券股份 有限公司	0.00	106,072.52	106,072. 52
中信银行	0.00	214,759.27	214,759.

股份有限公司			27
合计	0.00	321,614.88	321,614.88
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021年07月27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		
	中信建投量化精选6个月持有期混合A	中信建投量化精选6个月持有期混合C	合计
中信建投基金管理有限公司	0.00	579.46	579.46
中信建投证券股份有限公司	0.00	64,345.81	64,345.81
中信银行股份有限公司	0.00	120,223.76	120,223.76
合计	0.00	185,149.03	185,149.03

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 2022年01月01日至2022年12月31日		上年度可比期间 2021年07月27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	期末余额	当期利息收入
中信银行股份有限公司	14,517,859.49	91,931.25	59,066,915.71	431,278.02

注：本基金的银行存款由基金托管人中信银行股份有限公司保管，按约定利率计息。

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2022年01月01日至2022年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张/股）	总金额
中信建投证券股份有限公司	001227	兰州银行	网下配售	7,868	28,088.76
中信建投证券股份有限公司	688281	华秦科技	网下配售	1,936	366,872.00
中信建投证券股份有限公司	301236	软通动力	网下配售	6,085	443,474.80
中信建投证券股份有限公司	688153	唯捷创芯	网下配售	5,312	353,779.20
中信建投证券股份有限公司	603272	联翔股份	网下配售	443	6,042.52

中信建投 证券股份 有限公司	688119	中钢洛耐	网下配售	33,327	168,634.62
中信建投 证券股份 有限公司	301266	宇邦新材	网下配售	5,161	138,624.46
中信建投 证券股份 有限公司	688322	奥比中光	网下配售	8,529	264,313.71
中信建投 证券股份 有限公司	301308	江波龙	网下配售	5,915	329,288.05
中信建投 证券股份 有限公司	001236	弘业期货	网下配售	1,399	2,602.14
中信建投 证券股份 有限公司	688203	海正生材	网下配售	5,761	96,093.48
中信建投 证券股份 有限公司	688381	帝奥微	网下配售	4,494	187,309.92
中信建投 证券股份 有限公司	001300	三柏硕	网下配售	763	8,522.71
中信建投 证券股份 有限公司	001338	永顺泰	网下配售	1,649	11,246.18
中信建投 证券股份 有限公司	603130	云中马	网下配售	480	9,465.60
中信建投 证券股份 有限公司	301311	昆船智能	网下配售	8,320	115,481.60

中信建投 证券股份 有限公司	688143	长盈通	网下配售	1,938	69,128.46
中信建投 证券股份 有限公司	688172	燕东微	网下配售	13,981	307,302.38
上年度可比期间 2021年07月27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	4,224	493,701.12
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	8,704	338,324.48
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



**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2022年12月31日，本基金存放于中信建投期货的结算备付金余额为68,427.92元。于2022年度，本基金当期的中信建投期货结算备付金利息收入为68,531.01元。

**7.4.11 利润分配情况--固定净值型货币市场基金之外的基金**

无。

**7.4.12 期末（2022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	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688375	国博电子	2022-07-13	6个月以上	科创板打新限售	70.88	94.20	3,807	269,840.16	358,619.40	-
688506	百利天恒	2022-12-28	1个月内（含）	新股未上市	24.70	24.70	11,493	283,877.10	283,877.10	-
688401	路维光电	2022-08-10	6个月以上	科创板打新限售	25.08	41.55	4,947	124,070.76	205,547.85	-
688419	耐科装备	2022-10-31	6个月以上	科创板打新限售	37.85	29.44	3,039	115,026.15	89,468.16	-
301269	华大九天	2022-07-21	6个月以上	创业板打新限售	32.69	87.94	663	21,673.47	58,304.22	-

				售						
3013 27	华宝 新能	2022 -09-0 8	6个月以 上	创业 板打 新限 售	237.5 0	176.9 7	194	46,07 5.00	34,33 2.18	-
3013 08	江波 龙	2022 -07-2 7	6个月以 上	创业 板打 新限 售	55.67	56.72	592	32,95 6.64	33,57 8.24	-
3013 67	怡和 嘉业	2022 -10-2 1	6个月以 上	创业 板打 新限 售	119.8 8	175.7 8	160	19,18 0.80	28,12 4.80	-
3012 67	华夏 眼科	2022 -10-2 6	6个月以 上	创业 板打 新限 售	50.88	66.20	362	18,41 8.56	23,96 4.40	-
3011 52	天力 锂能	2022 -08-1 9	6个月以 上	创业 板打 新限 售	57.00	46.64	433	24,68 1.00	20,19 5.12	-
3013 89	隆扬 电子	2022 -10-1 8	6个月以 上	创业 板打 新限 售	22.50	17.16	1,010	22,72 5.00	17,33 1.60	-
3011 71	易点 天下	2022 -08-1 0	6个月以 上	创业 板打 新限 售	18.18	17.72	965	17,54 3.70	17,09 9.80	-
3013 63	美好 医疗	2022 -09-2 8	6个月以 上	创业 板打 新限 售	30.66	37.85	445	13,64 3.70	16,84 3.25	-
3012	新巨	2022	6个月以	创业	18.19	14.90	1,042	18,95	15,52	-

96	丰	-08-26	上	板打新限售				3.98	5.80	
301115	建科股份	2022-08-23	6个月以上	创业板打新限售	42.05	24.04	620	26,071.00	14,904.80	-
301328	维峰电子	2022-08-30	6个月以上	创业板打新限售	78.80	76.96	191	15,050.80	14,699.36	-
301121	紫建电子	2022-08-01	6个月以上	创业板打新限售	61.07	49.77	290	17,710.30	14,433.30	-
301339	通行宝	2022-09-02	6个月以上	创业板打新限售	18.78	15.59	913	17,146.14	14,233.67	-
301335	天元宠物	2022-11-11	6个月以上	创业板打新限售	49.98	33.82	420	20,991.60	14,204.40	-
301377	鼎泰高科	2022-11-11	6个月以上	创业板打新限售	22.88	17.63	770	17,617.60	13,575.10	-
301311	昆船智能	2022-11-23	6个月以上	创业板打新限售	13.88	15.86	832	11,548.16	13,195.52	-
301297	富乐德	2022-12-23	6个月以上	创业板打新限售	8.48	12.99	1,015	8,607.20	13,184.85	-

				售						
301338	凯格精机	2022-08-08	6个月以上	创业板打新限售	46.33	48.99	257	11,906.81	12,590.43	-
301280	珠城科技	2022-12-19	6个月以上	创业板打新限售	67.40	44.80	279	18,804.60	12,499.20	-
301283	聚胶股份	2022-08-26	6个月以上	创业板打新限售	52.69	51.41	235	12,382.15	12,081.35	-
301349	信德新材	2022-08-30	6个月以上	创业板打新限售	138.88	103.52	115	15,971.20	11,904.80	-
301290	东星医疗	2022-11-23	6个月以上	创业板打新限售	44.09	35.13	330	14,549.70	11,592.90	-
301277	新天地	2022-11-09	6个月以上	创业板打新限售	27.00	25.78	439	11,853.00	11,317.42	-
301361	众智科技	2022-11-08	6个月以上	创业板打新限售	26.44	20.96	517	13,669.48	10,836.32	-
301273	瑞晨环保	2022-10-11	6个月以上	创业板打新限售	37.89	37.79	277	10,495.53	10,467.83	-
3013	维海	2022	6个月以	创业	64.68	41.74	206	13,32	8,59	-

18	德	-08-03	上	板打 新限售				4.08	8.44	
3013 98	星源 卓镁	2022 -12-08	6个月以 上	创业 板打 新限售	34.40	28.94	255	8,77 2.00	7,37 9.70	-
3012 76	嘉曼 服饰	2022 -09-01	6个月以 上	创业 板打 新限售	40.66	22.61	303	12,31 9.98	6,85 0.83	-
3013 88	欣灵 电气	2022 -10-26	6个月以 上	创业 板打 新限售	25.88	21.60	292	7,55 6.96	6,30 7.20	-
3013 68	丰立 智能	2022 -12-07	6个月以 上	创业 板打 新限售	22.33	18.52	337	7,52 5.21	6,24 1.24	-
3012 70	汉仪 股份	2022 -08-19	6个月以 上	创业 板打 新限售	25.68	28.37	210	5,39 2.80	5,95 7.70	-
3012 31	荣信 文化	2022 -08-31	6个月以 上	创业 板打 新限售	25.49	20.38	275	7,00 9.75	5,60 4.50	-
3013 09	万得 凯	2022 -09-08	6个月以 上	创业 板打 新限售	39.00	24.46	228	8,89 2.00	5,57 6.88	-
3013 16	慧博 云通	2022 -09-29	6个月以 上	创业 板打 新限售	7.60	14.32	359	2,72 8.40	5,14 0.88	-

				售					
--	--	--	--	---	--	--	--	--	--

注：1、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》，本基金所认购的非公开发行股份，自发行结束之日起6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份，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份数量的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份，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份不适用《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。从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的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2022年12月31日，本基金无债券投资（2021年12月31日：同）。

### 7.4.13.3 流动性风险

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

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

于2022年12月31日，除附注7.4.12.3中列示的卖出回购金融资产款余额将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短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公司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2022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2022年12月31日，本基金确认的净赎回申请未超过7个工作日可变现资产的可变现价值。

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

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
-------------------------------	-------	-------	-------	-----	----

资产					
银行存款	120,384,996.27	-	-	-	120,384,996.27
结算备付金	20,500,527.83	-	-	-	20,500,527.83
交易性金融资产	-	-	-	331,147,703.49	331,147,703.49
应收申购款	-	-	-	2,708.12	2,708.12
资产总计	140,885,524.10	-	-	331,150,411.61	472,035,935.71
负债					
应付赎回款	-	-	-	274,611.97	274,611.97
应付管理人报酬	-	-	-	618,819.66	618,819.66
应付托管费	-	-	-	103,136.61	103,136.61
应付销售服务费	-	-	-	109,607.78	109,607.78
其他负债	-	-	-	180,000.00	180,000.00
负债总计	-	-	-	1,286,176.02	1,286,176.02
利率敏感度缺口	140,885,524.10	-	-	329,864,235.59	470,749,759.69
上年度末 2021 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	86,238,556.74	-	-	-	86,238,556.74
结算备付金	299,642.83	-	-	-	299,642.83
交易性金融资产	-	-	-	714,766,212.12	714,766,212.12
应收申购款	-	-	-	137,151.92	137,151.92

其他资产	-	-	-	16,376.43	16,376.43
资产总计	86,538,199.57	-	-	714,919,740.47	801,457,940.04
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	1,016,282.38	1,016,282.38
应付托管费	-	-	-	169,380.39	169,380.39
应付销售服务费	-	-	-	185,813.94	185,813.94
其他负债	-	-	-	110,000.00	110,000.00
负债总计	-	-	-	1,481,476.71	1,481,476.71
利率敏感度缺口	86,538,199.57	-	-	713,438,263.76	799,976,463.33

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2022年12月31日，本基金未持有交易性债券投资（2021年12月31日：同），因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响（2021年12月31日：同）。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过量化分析,对宏观经济情况及市场行为进行分析，做出资产配置的决定；通过运用多因子分析模型和机器学习模型构建投资组合，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理

人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

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

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日		上年度末 2021年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	331,147,703.49	70.34	714,766,212.12	89.35
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	331,147,703.49	70.34	714,766,212.12	89.35

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

		本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
	业绩比较基准上升5%	25,328,744.45	-
	业绩比较基准下降5%	-25,328,744.45	-

注：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 公允价值

### 7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

### 7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

#### 7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年12月31日	上年度末 2021年12月31日
第一层次	329,681,512.95	714,199,475.76
第二层次	283,877.10	5,504.49
第三层次	1,182,313.44	561,231.87
合计	331,147,703.49	714,766,212.12

#### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

#### 7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

##### 7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	561,231.87	561,231.87
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	1,339,037.47	1,339,037.47
转出第三层次	-	458,636.87	458,636.87
当期利得或损失总额	-	-259,319.03	-259,319.03
其中：计入损益的利得或损失	-	-259,319.03	-259,319.03
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,182,313.44	1,182,313.44
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	119,628.07	119,628.07
项目	上年度可比同期 2021年07月27日（基金合同生效日）至2021年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	416,599.39	416,599.39
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	144,632.48	144,632.48

其中：计入损益的利得或损失	-	144,632.48	144,632.48
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	561,231.87	561,231.87
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	144,632.48	144,632.48

注：于2022年12月31日，本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。于2022年度，本基金从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资。

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

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

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
交易性金融资产-股票投资	1,182,313.44	亚式期权	预期波动率	21.27%~247.56%	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
交易性金融资产-股票投资	561,231.87	亚式期权	预期波动率	34.36%~274.17%	负相关

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2022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(2021年12月31日：同)。

#### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

### §8 投资组合报告

#### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	331,147,703.49	70.15
	其中：股票	331,147,703.49	70.15
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	140,885,524.10	29.85
8	其他各项资产	2,708.12	0.00
9	合计	472,035,935.71	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	7,980,105.00	1.70
B	采矿业	22,584,091.00	4.80
C	制造业	175,039,207.54	37.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	15,996,694.00	3.40
E	建筑业	15,631,809.00	3.32
F	批发和零售业	7,496,693.00	1.59
G	交通运输、仓储和邮政业	11,829,209.00	2.51
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,032,620.02	1.49
J	金融业	32,449,112.00	6.89
K	房地产业	20,538,347.38	4.36
L	租赁和商务服务业	5,475,919.00	1.16
M	科学研究和技术服务业	1,499,776.65	0.32
N	水利、环境和公共设施管理业	680,403.00	0.14
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	297,856.00	0.06
Q	卫生和社会工作	422,079.40	0.09
R	文化、体育和娱乐业	6,193,781.50	1.32
S	综合	-	-
	合计	331,147,703.49	70.34

### 8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无余额。

## 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例
----	------	------	-------	---------	-----------

					(%)
1	600057	厦门象屿	496,000	5,093,920.00	1.08
2	600971	恒源煤电	648,800	4,645,408.00	0.99
3	600188	兖矿能源	133,100	4,469,498.00	0.95
4	000895	双汇发展	170,300	4,415,879.00	0.94
5	600886	国投电力	400,700	4,339,581.00	0.92
6	600039	四川路桥	354,100	3,937,592.00	0.84
7	002318	久立特材	220,900	3,675,776.00	0.78
8	000921	海信家电	275,500	3,628,335.00	0.77
9	600008	首创环保	1,224,500	3,465,335.00	0.74
10	002299	圣农发展	139,600	3,307,124.00	0.70
11	601766	中国中车	636,700	3,253,537.00	0.69
12	600820	隧道股份	614,100	3,236,307.00	0.69
13	002404	嘉欣丝绸	481,300	3,065,881.00	0.65
14	600846	同济科技	338,200	3,040,418.00	0.65
15	000011	深物业A	256,000	2,967,040.00	0.63
16	600422	昆药集团	210,000	2,965,200.00	0.63
17	603858	步长制药	140,100	2,943,501.00	0.63
18	600683	京投发展	635,400	2,929,194.00	0.62
19	000651	格力电器	70,800	2,288,256.00	0.49
20	601601	中国太保	79,000	1,937,080.00	0.41
21	002129	TCL中环	47,100	1,773,786.00	0.38
22	601088	中国神华	63,200	1,745,584.00	0.37
23	000157	中联重科	316,500	1,721,760.00	0.37
24	601668	中国建筑	308,900	1,677,327.00	0.36
25	600704	物产中大	345,100	1,659,931.00	0.35
26	002003	伟星股份	162,900	1,648,548.00	0.35
27	600901	江苏租赁	298,000	1,633,040.00	0.35
28	600376	首开股份	285,300	1,623,357.00	0.34
29	601000	唐山港	587,800	1,610,572.00	0.34
30	601398	工商银行	370,500	1,607,970.00	0.34

31	601288	农业银行	552,500	1,607,775.00	0.34
32	601006	大秦铁路	239,600	1,600,528.00	0.34
33	601328	交通银行	337,600	1,600,224.00	0.34
34	601939	建设银行	284,100	1,599,483.00	0.34
35	600919	江苏银行	218,700	1,594,323.00	0.34
36	601988	中国银行	503,700	1,591,692.00	0.34
37	000090	天健集团	290,600	1,586,676.00	0.34
38	600325	华发股份	174,623	1,582,084.38	0.34
39	600985	淮北矿业	123,600	1,582,080.00	0.34
40	600741	华域汽车	91,200	1,580,496.00	0.34
41	600048	保利发展	101,900	1,541,747.00	0.33
42	002459	晶澳科技	25,000	1,502,250.00	0.32
43	000002	万科 A	81,000	1,474,200.00	0.31
44	000408	藏格矿业	56,400	1,464,708.00	0.31
45	601166	兴业银行	81,800	1,438,862.00	0.31
46	002737	葵花药业	61,500	1,425,570.00	0.30
47	002419	天虹股份	200,500	1,379,440.00	0.29
48	300750	宁德时代	3,500	1,376,970.00	0.29
49	600782	新钢股份	335,100	1,370,559.00	0.29
50	300498	温氏股份	69,800	1,370,174.00	0.29
51	603156	养元饮品	61,200	1,362,924.00	0.29
52	601098	中南传媒	136,500	1,362,270.00	0.29
53	603259	药明康德	16,800	1,360,800.00	0.29
54	600674	川投能源	111,100	1,358,753.00	0.29
55	600757	长江传媒	238,300	1,358,310.00	0.29
56	600377	宁沪高速	165,000	1,356,300.00	0.29
57	601928	凤凰传媒	171,100	1,355,112.00	0.29
58	600350	山东高速	237,400	1,350,806.00	0.29
59	600027	华电国际	229,600	1,350,048.00	0.29
60	002088	鲁阳节能	58,300	1,347,896.00	0.29
61	600028	中国石化	309,000	1,347,240.00	0.29

62	600261	阳光照明	422,100	1,346,499.00	0.29
63	600389	江山股份	30,500	1,344,440.00	0.29
64	600900	长江电力	64,000	1,344,000.00	0.29
65	002884	凌霄泵业	80,900	1,343,749.00	0.29
66	601225	陕西煤业	72,300	1,343,334.00	0.29
67	601818	光大银行	437,300	1,342,511.00	0.29
68	600398	海澜之家	253,300	1,342,490.00	0.29
69	603886	元祖股份	68,400	1,342,008.00	0.29
70	600548	深高速	149,400	1,341,612.00	0.28
71	002303	美盈森	378,800	1,340,952.00	0.28
72	600373	中文传媒	140,100	1,340,757.00	0.28
73	601216	君正集团	335,700	1,339,443.00	0.28
74	002938	鹏鼎控股	48,800	1,339,072.00	0.28
75	600000	浦发银行	183,900	1,338,792.00	0.28
76	600016	民生银行	387,600	1,337,220.00	0.28
77	002233	塔牌集团	188,300	1,336,930.00	0.28
78	600642	申能股份	243,500	1,336,815.00	0.28
79	000828	东莞控股	149,000	1,336,530.00	0.28
80	601009	南京银行	128,200	1,335,844.00	0.28
81	601169	北京银行	309,900	1,335,669.00	0.28
82	600177	雅戈尔	211,000	1,335,630.00	0.28
83	601077	渝农商行	377,700	1,333,281.00	0.28
84	000036	华联控股	329,100	1,332,855.00	0.28
85	002367	康力电梯	177,700	1,332,750.00	0.28
86	600383	金地集团	130,200	1,331,946.00	0.28
87	601229	上海银行	225,300	1,331,523.00	0.28
87	000581	威孚高科	75,100	1,331,523.00	0.28
89	002128	电投能源	107,800	1,330,252.00	0.28
90	603878	武进不锈	123,600	1,329,936.00	0.28
91	600015	华夏银行	256,200	1,329,678.00	0.28
92	600688	上海石化	427,500	1,329,525.00	0.28

93	600104	上汽集团	92,200	1,328,602.00	0.28
94	600801	华新水泥	89,600	1,327,872.00	0.28
94	600395	盘江股份	197,600	1,327,872.00	0.28
96	600064	南京高科	200,800	1,327,288.00	0.28
97	002110	三钢闽光	282,300	1,326,810.00	0.28
98	002563	森马服饰	253,200	1,326,768.00	0.28
99	000789	万年青	155,300	1,326,262.00	0.28
100	002372	伟星新材	62,100	1,325,214.00	0.28
101	600282	南钢股份	420,700	1,325,205.00	0.28
102	600153	建发股份	97,000	1,324,050.00	0.28
103	600585	海螺水泥	48,300	1,322,454.00	0.28
104	600755	厦门国贸	184,900	1,320,186.00	0.28
105	600808	马钢股份	469,800	1,320,138.00	0.28
106	600295	鄂尔多斯	86,800	1,318,492.00	0.28
107	000932	华菱钢铁	280,500	1,318,350.00	0.28
108	000830	鲁西化工	106,400	1,318,296.00	0.28
109	600479	千金药业	137,300	1,318,080.00	0.28
110	600019	宝钢股份	235,300	1,315,327.00	0.28
111	601666	平煤股份	121,400	1,312,334.00	0.28
112	002601	龙佰集团	69,300	1,311,156.00	0.28
113	002516	旷达科技	267,500	1,310,750.00	0.28
114	000402	金融街	249,400	1,309,350.00	0.28
115	600873	梅花生物	128,500	1,308,130.00	0.28
116	601636	旗滨集团	114,800	1,307,572.00	0.28
117	600348	华阳股份	91,700	1,306,725.00	0.28
118	601669	中国电建	182,700	1,293,516.00	0.27
119	002443	金洲管道	200,200	1,261,260.00	0.27
120	002714	牧原股份	25,100	1,223,625.00	0.26
121	300450	先导智能	29,900	1,203,475.00	0.26
122	002709	天赐材料	27,100	1,188,606.00	0.25
123	002050	三花智控	52,400	1,111,928.00	0.24

124	002600	领益智造	232,000	1,053,280.00	0.22
125	300433	蓝思科技	99,700	1,049,841.00	0.22
126	300316	晶盛机电	16,300	1,036,028.00	0.22
127	600233	圆通速递	51,300	1,030,617.00	0.22
128	300207	欣旺达	48,700	1,030,005.00	0.22
129	300014	亿纬锂能	11,700	1,028,430.00	0.22
130	688599	天合光能	15,200	969,152.00	0.21
131	002756	永兴材料	10,500	967,785.00	0.21
132	603185	上机数控	8,900	942,065.00	0.20
133	000876	新希望	72,300	933,393.00	0.20
134	600795	国电电力	213,800	912,926.00	0.19
135	002602	世纪华通	235,200	896,112.00	0.19
136	000301	东方盛虹	65,200	850,208.00	0.18
137	300856	科思股份	16,200	844,830.00	0.18
138	300502	新易盛	35,200	836,000.00	0.18
139	000776	广发证券	53,900	834,911.00	0.18
140	000877	天山股份	95,900	817,068.00	0.17
141	300761	立华股份	23,500	804,875.00	0.17
142	300763	锦浪科技	4,400	792,220.00	0.17
143	300274	阳光电源	7,000	782,600.00	0.17
144	002959	小熊电器	12,900	778,128.00	0.17
145	601319	中国人保	146,400	764,208.00	0.16
146	603456	九洲药业	17,800	755,254.00	0.16
147	603599	广信股份	25,500	749,700.00	0.16
148	600481	双良节能	57,700	746,638.00	0.16
149	300896	爱美客	1,300	736,255.00	0.16
150	002074	国轩高科	25,500	735,165.00	0.16
151	600732	爱旭股份	19,400	733,708.00	0.16
152	002085	万丰奥威	123,000	731,850.00	0.16
153	300910	瑞丰新材	5,900	727,529.00	0.15
154	603609	禾丰股份	61,300	725,792.00	0.15

155	000069	华侨城 A	134,800	718,484.00	0.15
156	300532	今天国际	49,200	712,416.00	0.15
157	002478	常宝股份	125,300	705,439.00	0.15
158	600150	中国船舶	31,400	699,592.00	0.15
159	300002	神州泰岳	159,900	693,966.00	0.15
160	300073	当升科技	12,300	693,720.00	0.15
161	002352	顺丰控股	12,000	693,120.00	0.15
162	600037	歌华有线	84,900	691,086.00	0.15
163	002273	水晶光电	58,600	690,894.00	0.15
164	002244	滨江集团	78,100	689,623.00	0.15
165	601231	环旭电子	42,400	688,152.00	0.15
166	000166	申万宏源	172,800	687,744.00	0.15
167	000333	美的集团	13,200	683,760.00	0.15
168	601908	京运通	103,300	678,681.00	0.14
169	002955	鸿合科技	28,800	678,240.00	0.14
170	300413	芒果超媒	22,400	672,448.00	0.14
171	603056	德邦股份	32,100	668,643.00	0.14
172	600438	通威股份	17,100	659,718.00	0.14
173	603290	斯达半导	2,000	658,600.00	0.14
174	002475	立讯精密	20,400	647,700.00	0.14
175	601567	三星医疗	47,900	645,692.00	0.14
176	000100	TCL科技	173,400	645,048.00	0.14
177	601869	长飞光纤	19,700	642,811.00	0.14
178	002594	比亚迪	2,500	642,425.00	0.14
179	688012	中微公司	6,300	617,463.00	0.13
180	000001	平安银行	46,900	617,204.00	0.13
181	601808	中海油服	36,000	596,880.00	0.13
182	601012	隆基绿能	14,100	595,866.00	0.13
183	603392	万泰生物	4,700	595,490.00	0.13
184	601788	光大证券	39,600	588,852.00	0.13
185	601689	拓普集团	9,800	574,084.00	0.12

186	300494	盛天网络	38,300	571,819.00	0.12
187	688556	高测股份	7,600	570,152.00	0.12
188	600018	上港集团	106,600	569,244.00	0.12
189	601857	中国石油	114,200	567,574.00	0.12
190	300772	运达股份	37,900	563,573.00	0.12
191	688303	大全能源	11,700	557,856.00	0.12
192	603659	璞泰来	10,600	550,034.00	0.12
193	002831	裕同科技	16,400	542,348.00	0.12
194	688518	联赢激光	18,500	540,385.00	0.11
195	002463	沪电股份	45,300	539,070.00	0.11
196	002430	杭氧股份	13,600	535,296.00	0.11
197	688008	澜起科技	8,500	532,100.00	0.11
198	600660	福耀玻璃	14,900	522,543.00	0.11
199	000725	京东方 A	153,400	518,492.00	0.11
200	688559	海目星	8,800	508,992.00	0.11
201	300724	捷佳伟创	4,400	501,688.00	0.11
202	688357	建龙微纳	4,400	487,960.00	0.10
203	688200	华峰测控	1,700	469,999.00	0.10
204	002258	利尔化学	26,100	468,756.00	0.10
205	000977	浪潮信息	21,300	458,376.00	0.10
206	688301	奕瑞科技	1,000	457,880.00	0.10
207	002472	双环传动	17,800	453,010.00	0.10
208	002212	天融信	45,000	449,550.00	0.10
209	600765	中航重机	14,400	447,696.00	0.10
210	000988	华工科技	27,200	446,352.00	0.09
211	603198	迎驾贡酒	7,100	445,738.00	0.09
212	300672	国科微	5,200	442,260.00	0.09
213	300474	景嘉微	8,100	442,017.00	0.09
214	000519	中兵红箭	22,300	437,972.00	0.09
215	300573	兴齐眼药	3,500	437,780.00	0.09
216	000657	中钨高新	27,600	437,184.00	0.09



217	600884	杉杉股份	24,000	436,800.00	0.09
218	002236	大华股份	38,600	436,566.00	0.09
219	601882	海天精工	16,600	434,920.00	0.09
220	300409	道氏技术	29,600	434,824.00	0.09
221	605111	新洁能	5,600	434,448.00	0.09
222	600436	片仔癀	1,500	432,690.00	0.09
223	600141	兴发集团	14,900	432,100.00	0.09
224	002407	多氟多	12,900	429,828.00	0.09
225	300260	新莱应材	6,400	429,440.00	0.09
226	002850	科达利	3,600	427,716.00	0.09
227	000568	泸州老窖	1,900	426,132.00	0.09
228	300755	华致酒行	13,800	426,006.00	0.09
229	603086	先达股份	31,600	413,644.00	0.09
230	603105	芯能科技	28,000	412,440.00	0.09
231	603355	莱克电气	14,700	412,188.00	0.09
232	601633	长城汽车	13,900	411,718.00	0.09
233	600050	中国联通	90,800	406,784.00	0.09
234	603444	吉比特	1,300	406,692.00	0.09
235	300705	九典制药	16,700	405,810.00	0.09
236	002460	赣锋锂业	5,800	403,158.00	0.09
237	600995	南网储能	27,700	399,434.00	0.08
238	601128	常熟银行	52,300	394,865.00	0.08
239	300881	盛德鑫泰	12,300	394,707.00	0.08
240	603668	天马科技	22,000	394,240.00	0.08
241	603129	春风动力	3,500	393,820.00	0.08
242	300130	新国都	32,600	393,482.00	0.08
243	603035	常熟汽饰	18,500	393,125.00	0.08
244	002947	恒铭达	19,900	393,025.00	0.08
245	002997	瑞鹄模具	16,100	392,840.00	0.08
246	002204	大连重工	75,600	392,364.00	0.08
247	601702	华峰铝业	26,200	391,690.00	0.08

248	300136	信维通信	23,700	391,287.00	0.08
249	600491	龙元建设	62,100	390,609.00	0.08
250	000012	南玻 A	58,200	390,522.00	0.08
251	002839	张家港行	84,600	390,006.00	0.08
252	601699	潞安环能	23,100	389,235.00	0.08
253	603179	新泉股份	10,100	388,749.00	0.08
254	300035	中科电气	18,800	386,904.00	0.08
255	603305	旭升集团	12,000	386,880.00	0.08
256	603906	龙蟠科技	16,700	386,605.00	0.08
257	300511	雪榕生物	59,900	386,355.00	0.08
258	688123	聚辰股份	3,800	384,560.00	0.08
259	600499	科达制造	26,900	382,249.00	0.08
260	601825	沪农商行	63,300	372,204.00	0.08
261	603529	爱玛科技	8,100	371,547.00	0.08
262	603920	世运电路	25,800	371,004.00	0.08
263	000417	合肥百货	68,000	370,600.00	0.08
264	300673	佩蒂股份	20,900	368,885.00	0.08
265	688375	国博电子	3,807	358,619.40	0.08
266	300716	国立科技	25,500	350,625.00	0.07
267	300796	贝斯美	17,300	349,460.00	0.07
268	603867	新化股份	10,700	345,610.00	0.07
269	600519	贵州茅台	200	345,400.00	0.07
270	600060	海信视像	25,400	343,916.00	0.07
271	002252	上海莱士	53,800	341,092.00	0.07
272	603345	安井食品	2,100	339,948.00	0.07
273	603199	九华旅游	11,800	335,474.00	0.07
274	002100	天康生物	40,200	334,062.00	0.07
275	600322	天房发展	147,300	332,898.00	0.07
276	300109	新开源	13,700	331,540.00	0.07
277	601665	齐鲁银行	79,400	331,098.00	0.07
278	000063	中兴通讯	12,800	331,008.00	0.07

279	002772	众兴菌业	39,100	325,312.00	0.07
280	300639	凯普生物	19,100	321,835.00	0.07
281	600236	桂冠电力	55,300	318,528.00	0.07
282	000600	建投能源	59,100	310,275.00	0.07
283	000915	华特达因	6,800	309,400.00	0.07
284	603556	海兴电力	17,400	306,240.00	0.07
285	002597	金禾实业	9,400	305,500.00	0.06
286	301035	润丰股份	3,500	304,850.00	0.06
287	000517	荣安地产	103,000	303,850.00	0.06
288	603998	方盛制药	37,600	301,176.00	0.06
289	300298	三诺生物	8,900	300,197.00	0.06
290	600895	张江高科	26,400	299,376.00	0.06
291	300192	科德教育	41,600	297,856.00	0.06
292	002548	金新农	49,400	296,894.00	0.06
293	300628	亿联网络	4,900	296,891.00	0.06
294	000735	罗牛山	41,500	293,405.00	0.06
295	002312	川发龙蟒	27,600	290,352.00	0.06
296	000425	徐工机械	57,100	289,497.00	0.06
297	603363	傲农生物	22,200	286,158.00	0.06
298	002697	红旗连锁	50,800	286,004.00	0.06
299	688506	百利天恒	11,493	283,877.10	0.06
300	000521	长虹美菱	67,300	283,333.00	0.06
301	600821	金开新能	38,900	281,636.00	0.06
302	002422	科伦药业	10,500	279,405.00	0.06
303	603612	索通发展	10,700	278,414.00	0.06
304	002649	博彦科技	26,900	276,801.00	0.06
305	300308	中际旭创	10,200	275,706.00	0.06
306	601318	中国平安	5,800	272,600.00	0.06
307	600009	上海机场	4,700	271,237.00	0.06
308	000858	五粮液	1,500	271,035.00	0.06
309	601899	紫金矿业	27,100	271,000.00	0.06

310	300015	爱尔眼科	8,700	270,309.00	0.06
311	002004	华邦健康	53,000	270,300.00	0.06
312	002142	宁波银行	8,300	269,335.00	0.06
313	601658	邮储银行	58,200	268,884.00	0.06
314	600030	中信证券	13,500	268,785.00	0.06
315	600600	青岛啤酒	2,500	268,750.00	0.06
316	600036	招商银行	7,200	268,272.00	0.06
317	003816	中国广核	99,700	268,193.00	0.06
318	688981	中芯国际	6,500	267,410.00	0.06
319	601628	中国人寿	7,200	267,264.00	0.06
320	600570	恒生电子	6,600	267,036.00	0.06
321	601995	中金公司	7,000	266,910.00	0.06
322	002821	凯莱英	1,800	266,400.00	0.06
323	000560	我爱我家	106,500	266,250.00	0.06
324	300999	金龙鱼	6,100	265,716.00	0.06
325	601238	广汽集团	24,000	264,720.00	0.06
326	600905	三峡能源	46,800	264,420.00	0.06
327	600690	海尔智家	10,800	264,168.00	0.06
328	600941	中国移动	3,900	263,913.00	0.06
329	300373	扬杰科技	5,000	263,000.00	0.06
330	601888	中国中免	1,200	259,236.00	0.06
331	600809	山西汾酒	900	256,491.00	0.05
332	002179	中航光电	4,440	256,454.40	0.05
333	601390	中国中铁	45,800	254,648.00	0.05
334	002192	融捷股份	2,600	254,540.00	0.05
335	603876	鼎胜新材	6,200	254,448.00	0.05
336	688126	沪硅产业	14,400	253,584.00	0.05
337	601138	工业富联	27,200	249,696.00	0.05
338	600933	爱柯迪	13,600	247,656.00	0.05
339	002384	东山精密	10,000	247,300.00	0.05
340	002965	祥鑫科技	4,200	244,482.00	0.05

341	600089	特变电工	11,900	238,952.00	0.05
342	688401	路维光电	4,947	205,547.85	0.04
343	301363	美好医疗	4,447	184,567.07	0.04
344	300684	中石科技	12,300	182,163.00	0.04
345	605009	豪悦护理	3,200	165,984.00	0.04
346	605507	国邦医药	6,200	164,114.00	0.03
347	301039	中集车辆	20,200	160,994.00	0.03
348	600665	天地源	42,800	157,932.00	0.03
349	605196	华通线缆	21,300	148,674.00	0.03
350	301335	天元宠物	4,192	147,884.08	0.03
351	301311	昆船智能	8,320	145,957.76	0.03
352	600160	巨化股份	9,400	145,794.00	0.03
353	600909	华安证券	31,700	145,503.00	0.03
354	300059	东方财富	7,500	145,500.00	0.03
355	600546	山煤国际	10,000	144,900.00	0.03
356	002518	科士达	2,500	144,000.00	0.03
357	002982	湘佳股份	3,300	141,966.00	0.03
358	300645	正元智慧	5,600	141,008.00	0.03
359	300438	鹏辉能源	1,800	140,382.00	0.03
360	688639	华恒生物	900	139,725.00	0.03
361	002993	奥海科技	4,100	139,441.00	0.03
362	603083	剑桥科技	12,400	139,376.00	0.03
363	688295	中复神鹰	3,200	138,144.00	0.03
364	000739	普洛药业	6,400	137,856.00	0.03
365	600284	浦东建设	20,400	137,496.00	0.03
366	300546	雄帝科技	6,400	136,704.00	0.03
367	301302	华如科技	2,100	134,463.00	0.03
368	003002	壶化股份	7,300	134,320.00	0.03
369	300679	电连技术	3,600	133,200.00	0.03
370	603368	柳药集团	7,100	132,557.00	0.03
371	600054	黄山旅游	10,400	132,496.00	0.03

372	600963	岳阳林纸	24,300	132,435.00	0.03
373	301280	珠城科技	2,783	132,065.20	0.03
374	600073	上海梅林	16,500	131,175.00	0.03
375	688187	时代电气	2,400	130,968.00	0.03
376	002746	仙坛股份	14,200	130,072.00	0.03
377	002524	光正眼科	17,900	127,806.00	0.03
378	600975	新五丰	17,900	127,269.00	0.03
379	000608	阳光股份	37,300	125,701.00	0.03
380	688658	悦康药业	6,500	125,580.00	0.03
381	300596	利安隆	2,300	125,511.00	0.03
382	002560	通达股份	18,400	125,488.00	0.03
383	301277	新天地	4,384	125,209.57	0.03
384	603118	共进股份	15,700	124,815.00	0.03
385	002442	龙星化工	24,600	124,476.00	0.03
386	300377	赢时胜	15,000	123,150.00	0.03
387	002115	三维通信	27,100	122,763.00	0.03
388	301290	东星医疗	3,291	122,423.13	0.03
389	300607	拓斯达	8,400	122,220.00	0.03
390	002292	奥飞娱乐	26,000	121,160.00	0.03
391	002669	康达新材	9,300	119,691.00	0.03
392	600280	中央商场	36,400	119,028.00	0.03
393	000811	冰轮环境	10,700	118,770.00	0.03
394	300765	新诺威	7,500	118,350.00	0.03
395	600720	祁连山	11,900	118,167.00	0.03
396	603317	天味食品	4,300	118,164.00	0.03
397	688819	天能股份	3,200	117,568.00	0.02
398	300551	古鳌科技	10,000	116,800.00	0.02
399	002133	广宇集团	33,200	116,532.00	0.02
400	002091	江苏国泰	13,600	115,600.00	0.02
401	301361	众智科技	5,169	115,134.16	0.02
402	600285	羚锐制药	8,800	114,752.00	0.02

403	000950	重药控股	22,500	114,300.00	0.02
404	603611	诺力股份	7,000	113,330.00	0.02
405	002558	巨人网络	14,200	113,032.00	0.02
406	601038	一拖股份	10,000	113,000.00	0.02
407	300017	网宿科技	20,200	112,716.00	0.02
408	002304	洋河股份	700	112,350.00	0.02
409	003037	三和管桩	9,900	111,474.00	0.02
410	301235	华康医疗	3,100	110,887.00	0.02
411	300070	碧水源	23,100	109,263.00	0.02
412	300205	天喻信息	9,900	108,900.00	0.02
413	000886	海南高速	22,400	108,640.00	0.02
414	300861	美畅股份	2,200	108,152.00	0.02
415	600987	航民股份	14,900	108,025.00	0.02
416	002826	易明医药	10,500	106,995.00	0.02
417	300366	创意信息	11,100	106,782.00	0.02
418	600582	天地科技	20,500	106,600.00	0.02
419	002705	新宝股份	6,400	106,560.00	0.02
420	688600	皖仪科技	4,200	104,916.00	0.02
421	300248	新开普	11,900	104,720.00	0.02
422	300541	先进数通	9,200	104,420.00	0.02
423	605266	健之佳	1,300	104,091.00	0.02
424	603136	天目湖	3,800	103,170.00	0.02
425	300793	佳禾智能	6,000	102,360.00	0.02
426	600993	马应龙	4,500	101,700.00	0.02
427	300365	恒华科技	13,200	100,452.00	0.02
428	300567	精测电子	2,000	100,400.00	0.02
429	002497	雅化集团	4,300	99,975.00	0.02
430	300144	宋城演艺	6,800	99,280.00	0.02
431	002155	湖南黄金	7,300	94,535.00	0.02
432	688419	耐科装备	3,039	89,468.16	0.02
433	300142	沃森生物	2,200	88,418.00	0.02

434	601718	际华集团	28,900	84,099.00	0.02
435	000970	中科三环	6,000	81,840.00	0.02
436	600166	福田汽车	28,900	81,209.00	0.02
437	002008	大族激光	3,100	79,515.00	0.02
438	301398	星源卓镁	2,549	78,837.80	0.02
439	600170	上海建工	29,700	77,220.00	0.02
440	002555	三七互娱	3,900	70,590.00	0.01
441	000338	潍柴动力	6,900	70,242.00	0.01
442	300568	星源材质	3,300	70,158.00	0.01
443	002007	华兰生物	3,100	70,153.00	0.01
444	002624	完美世界	5,500	69,960.00	0.01
445	001301	尚太科技	1,164	68,722.56	0.01
446	301316	慧博云通	3,584	67,028.63	0.01
447	301368	丰立智能	3,368	66,558.14	0.01
448	002056	横店东磁	3,400	63,716.00	0.01
449	002493	荣盛石化	5,100	62,730.00	0.01
450	000938	紫光股份	3,200	62,432.00	0.01
451	300595	欧普康视	1,700	60,690.00	0.01
452	000400	许继电气	3,000	59,910.00	0.01
453	300003	乐普医疗	2,600	59,722.00	0.01
454	301269	华大九天	663	58,304.22	0.01
455	300115	长盈精密	5,600	57,848.00	0.01
456	002230	科大讯飞	1,600	52,528.00	0.01
457	002080	中材科技	2,400	51,432.00	0.01
458	600580	卧龙电驱	4,100	51,086.00	0.01
459	002747	埃斯顿	2,300	49,864.00	0.01
460	002648	卫星化学	3,200	49,600.00	0.01
461	002531	天顺风能	3,200	48,416.00	0.01
462	601778	晶科科技	8,500	46,750.00	0.01
463	000933	神火股份	3,000	44,880.00	0.01
464	301238	瑞泰新材	1,910	42,955.90	0.01



465	301327	华宝新能	194	34,332.18	0.01
466	002444	巨星科技	1,800	34,164.00	0.01
467	301308	江波龙	592	33,578.24	0.01
468	301367	怡和嘉业	160	28,124.80	0.01
469	301267	华夏眼科	362	23,964.40	0.01
470	301152	天力锂能	433	20,195.12	0.00
471	301389	隆扬电子	1,010	17,331.60	0.00
472	301171	易点天下	965	17,099.80	0.00
473	301296	新巨丰	1,042	15,525.80	0.00
474	301115	建科股份	620	14,904.80	0.00
475	301328	维峰电子	191	14,699.36	0.00
476	301121	紫建电子	290	14,433.30	0.00
477	301339	通行宝	913	14,233.67	0.00
478	301377	鼎泰高科	770	13,575.10	0.00
479	301297	富乐德	1,015	13,184.85	0.00
480	301338	凯格精机	257	12,590.43	0.00
481	301283	聚胶股份	235	12,081.35	0.00
482	301349	信德新材	115	11,904.80	0.00
483	301273	瑞晨环保	277	10,467.83	0.00
484	301318	维海德	206	8,598.44	0.00
485	301276	嘉曼服饰	303	6,850.83	0.00
486	301388	欣灵电气	292	6,307.20	0.00
487	301270	汉仪股份	210	5,957.70	0.00
488	301231	荣信文化	275	5,604.50	0.00
489	301309	万得凯	228	5,576.88	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初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

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

1	600970	中材国际	64,993,279.84	8.12
2	600325	华发股份	64,322,938.76	8.04
3	600153	建发股份	63,689,917.44	7.96
4	600057	厦门象屿	63,380,249.62	7.92
5	002004	华邦健康	60,957,550.04	7.62
6	601800	中国交建	59,261,264.06	7.41
7	601668	中国建筑	58,679,641.80	7.34
8	601958	金钼股份	54,821,476.25	6.85
9	600985	淮北矿业	48,860,723.00	6.11
10	601390	中国中铁	47,655,463.85	5.96
11	600039	四川路桥	43,708,940.99	5.46
12	600705	中航产融	42,376,759.00	5.30
13	600900	长江电力	42,149,948.00	5.27
14	000895	双汇发展	41,867,719.90	5.23
15	601117	中国化学	41,841,060.22	5.23
16	600886	国投电力	40,714,307.49	5.09
17	000401	冀东水泥	39,022,006.88	4.88
18	600028	中国石化	38,785,427.84	4.85
19	600704	物产中大	38,670,293.95	4.83
20	600395	盘江股份	38,010,492.53	4.75
21	601231	环旭电子	37,575,195.84	4.70
22	600018	上港集团	35,763,434.44	4.47
23	300316	晶盛机电	35,531,632.27	4.44
24	002216	三全食品	35,481,280.50	4.44
25	601088	中国神华	34,202,807.00	4.28
26	300750	宁德时代	33,951,793.29	4.24
27	601098	中南传媒	33,012,548.52	4.13
28	000877	天山股份	32,971,786.45	4.12
29	600582	天地科技	32,925,212.98	4.12
30	002091	江苏国泰	32,696,307.84	4.09
31	000921	海信家电	31,351,418.50	3.92

32	000703	恒逸石化	30,474,078.60	3.81
33	600188	兖矿能源	29,937,931.28	3.74
34	600063	皖维高新	29,643,906.00	3.71
35	600606	绿地控股	29,340,967.67	3.67
36	001979	招商蛇口	28,829,603.00	3.60
37	002709	天赐材料	27,802,780.98	3.48
38	300363	博腾股份	27,580,476.28	3.45
39	600062	华润双鹤	27,289,562.25	3.41
40	603456	九洲药业	27,083,098.07	3.39
41	000651	格力电器	27,040,413.00	3.38
42	002821	凯莱英	27,036,144.04	3.38
43	601872	招商轮船	26,899,211.60	3.36
44	600600	青岛啤酒	26,871,600.00	3.36
45	603986	兆易创新	26,755,069.80	3.34
46	000568	泸州老窖	26,712,451.82	3.34
47	600141	兴发集团	26,494,085.83	3.31
48	601899	紫金矿业	26,488,962.01	3.31
49	600755	厦门国贸	25,946,790.00	3.24
50	000733	振华科技	25,564,524.00	3.20
51	603259	药明康德	24,790,789.49	3.10
52	600256	广汇能源	23,919,809.80	2.99
53	000090	天健集团	23,845,004.00	2.98
54	000069	华侨城 A	23,783,690.36	2.97
55	600170	上海建工	23,766,672.00	2.97
56	601881	中国银河	23,701,201.76	2.96
57	600546	山煤国际	23,404,734.00	2.93
58	000519	中兵红箭	22,686,812.00	2.84
59	601857	中国石油	22,641,666.00	2.83
60	600348	华阳股份	22,602,880.00	2.83
61	600233	圆通速递	22,427,063.00	2.80
62	002129	TCL中环	22,229,019.00	2.78

63	002328	新朋股份	21,390,987.90	2.67
64	601766	中国中车	21,277,812.36	2.66
65	605358	立昂微	21,244,617.27	2.66
66	002404	嘉欣丝绸	21,241,106.00	2.66
67	002230	科大讯飞	20,966,438.38	2.62
68	600449	宁夏建材	20,855,538.00	2.61
69	600780	通宝能源	20,824,219.00	2.60
70	601225	陕西煤业	20,759,268.00	2.59
71	600873	梅花生物	20,566,708.80	2.57
72	601985	中国核电	20,424,737.83	2.55
73	601128	常熟银行	20,168,695.98	2.52
74	300759	康龙化成	19,397,434.44	2.42
75	603799	华友钴业	19,164,621.47	2.40
76	600690	海尔智家	18,871,851.35	2.36
77	600737	中粮糖业	18,649,912.00	2.33
78	002756	永兴材料	18,496,516.00	2.31
79	000333	美的集团	18,491,968.00	2.31
80	002371	北方华创	18,463,091.00	2.31
81	603613	国联股份	18,450,474.30	2.31
82	601838	成都银行	18,431,059.00	2.30
83	002375	亚厦股份	18,409,530.71	2.30
84	600820	隧道股份	18,358,257.00	2.29
85	300009	安科生物	18,316,924.78	2.29
86	601186	中国铁建	17,997,463.00	2.25
87	600438	通威股份	17,912,191.00	2.24
88	603856	东宏股份	17,893,827.00	2.24
89	601928	凤凰传媒	17,852,259.16	2.23
90	601658	邮储银行	17,818,655.78	2.23
91	002244	滨江集团	17,788,820.00	2.22
92	300130	新国都	17,639,584.76	2.21
93	601006	大秦铁路	17,586,360.00	2.20

94	600176	中国巨石	17,507,254.89	2.19
95	300347	泰格医药	17,456,569.42	2.18
96	300037	新宙邦	17,412,124.93	2.18
97	603198	迎驾贡酒	17,390,707.00	2.17
98	601339	百隆东方	17,323,689.00	2.17
99	300073	当升科技	17,153,507.92	2.14
100	000725	京东方 A	17,112,449.00	2.14
101	600718	东软集团	17,096,101.00	2.14
102	601615	明阳智能	17,074,762.00	2.13
103	603599	广信股份	16,710,512.00	2.09
104	600426	华鲁恒升	16,694,217.56	2.09
105	000977	浪潮信息	16,694,170.20	2.09
106	002459	晶澳科技	16,628,365.20	2.08
107	601669	中国电建	16,597,541.00	2.07
108	600160	巨化股份	16,574,900.00	2.07
109	002212	天融信	16,436,255.00	2.05
110	003816	中国广核	16,410,636.00	2.05
111	600867	通化东宝	16,324,292.80	2.04
112	601699	潞安环能	16,129,468.00	2.02
113	002299	圣农发展	16,124,988.00	2.02
114	002555	三七互娱	16,055,399.00	2.01

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600325	华发股份	70,732,800.13	8.84
2	600970	中材国际	68,003,063.49	8.50
3	600057	厦门象屿	65,716,114.62	8.21
4	600153	建发股份	65,299,076.72	8.16
5	601668	中国建筑	62,190,915.40	7.77

6	002004	华邦健康	59,933,349.89	7.49
7	601800	中国交建	58,429,542.96	7.30
8	601958	金钼股份	56,849,644.99	7.11
9	600985	淮北矿业	46,016,325.00	5.75
10	601390	中国中铁	45,703,917.19	5.71
11	300316	晶盛机电	41,713,712.05	5.21
12	601117	中国化学	40,998,547.88	5.12
13	600900	长江电力	40,949,531.00	5.12
14	600705	中航产融	40,638,536.00	5.08
15	600039	四川路桥	39,790,683.60	4.97
16	601231	环旭电子	39,140,890.40	4.89
17	601088	中国神华	37,969,820.45	4.75
18	600028	中国石化	37,763,183.32	4.72
19	000401	冀东水泥	37,738,557.26	4.72
20	000895	双汇发展	37,577,821.92	4.70
21	600704	物产中大	36,327,277.20	4.54
22	600886	国投电力	36,233,517.53	4.53
23	600395	盘江股份	35,812,211.20	4.48
24	300750	宁德时代	35,599,938.70	4.45
25	002216	三全食品	35,337,187.59	4.42
26	000877	天山股份	35,186,630.18	4.40
27	600018	上港集团	35,165,995.89	4.40
28	600141	兴发集团	34,283,812.78	4.29
29	600582	天地科技	33,987,812.58	4.25
30	300363	博腾股份	32,785,915.12	4.10
31	603456	九洲药业	32,702,462.75	4.09
32	002129	TCL中环	32,236,928.04	4.03
33	600063	皖维高新	32,222,733.00	4.03
34	002709	天赐材料	32,084,679.91	4.01
35	601098	中南传媒	31,809,270.62	3.98
36	002091	江苏国泰	31,686,259.78	3.96

37	603986	兆易创新	30,872,352.96	3.86
38	601872	招商轮船	30,842,141.40	3.86
39	001979	招商蛇口	30,805,064.96	3.85
40	000733	振华科技	30,669,282.80	3.83
41	600188	兖矿能源	30,471,524.88	3.81
42	000568	泸州老窖	30,451,028.60	3.81
43	000703	恒逸石化	29,776,455.08	3.72
44	600062	华润双鹤	29,331,344.25	3.67
45	000921	海信家电	28,581,286.85	3.57
46	600606	绿地控股	28,398,685.94	3.55
47	603613	国联股份	27,293,898.79	3.41
48	002821	凯莱英	27,005,576.35	3.38
49	000069	华侨城 A	26,508,246.80	3.31
50	600600	青岛啤酒	26,441,493.73	3.31
51	601899	紫金矿业	26,361,757.49	3.30
52	600546	山煤国际	26,212,190.00	3.28
53	600348	华阳股份	25,983,798.86	3.25
54	000519	中兵红箭	25,819,682.03	3.23
55	603198	迎驾贡酒	24,967,720.02	3.12
56	600755	厦门国贸	24,860,370.87	3.11
57	601615	明阳智能	24,790,240.03	3.10
58	601225	陕西煤业	24,610,138.00	3.08
59	000651	格力电器	24,470,035.00	3.06
60	601881	中国银河	24,336,417.89	3.04
61	600256	广汇能源	24,142,695.44	3.02
62	603259	药明康德	23,965,010.24	3.00
63	002328	新朋股份	23,821,786.00	2.98
64	600438	通威股份	23,698,705.00	2.96
65	601699	潞安环能	23,575,263.00	2.95
66	601985	中国核电	23,339,814.83	2.92
67	600873	梅花生物	23,329,711.76	2.92

68	601128	常熟银行	23,085,346.90	2.89
69	600170	上海建工	22,886,226.90	2.86
70	600765	中航重机	22,850,798.40	2.86
71	300009	安科生物	22,577,994.29	2.82
72	600780	通宝能源	22,326,668.16	2.79
73	603599	广信股份	22,290,282.74	2.79
74	000090	天健集团	22,151,818.02	2.77
75	601857	中国石油	21,705,480.00	2.71
76	600233	圆通速递	21,307,244.50	2.66
77	600176	中国巨石	21,279,854.69	2.66
78	002230	科大讯飞	20,738,527.82	2.59
79	600449	宁夏建材	20,734,422.15	2.59
80	600887	伊利股份	20,695,519.73	2.59
81	605358	立昂微	20,394,801.00	2.55
82	601919	中远海控	19,792,799.44	2.47
83	000977	浪潮信息	19,771,274.07	2.47
84	300037	新宙邦	19,749,907.08	2.47
85	300347	泰格医药	19,638,198.58	2.45
86	603369	今世缘	19,514,279.62	2.44
87	000938	紫光股份	19,437,341.20	2.43
88	000598	兴蓉环境	19,242,951.00	2.41
89	002756	永兴材料	19,011,121.06	2.38
90	002128	电投能源	18,994,992.45	2.37
91	601339	百隆东方	18,929,476.11	2.37
92	002557	洽洽食品	18,908,956.96	2.36
93	601838	成都银行	18,647,925.90	2.33
94	300759	康龙化成	18,647,112.80	2.33
95	603799	华友钴业	18,498,744.12	2.31
96	600737	中粮糖业	18,494,058.00	2.31
97	601000	唐山港	18,358,025.40	2.29
98	603856	东宏股份	18,345,154.00	2.29



99	000404	长虹华意	18,264,664.88	2.28
100	300772	运达股份	18,216,920.76	2.28
101	002404	嘉欣丝绸	18,191,639.00	2.27
102	601766	中国中车	18,178,353.72	2.27
103	603882	金城医学	18,138,018.85	2.27
104	601156	东航物流	18,092,052.00	2.26
105	600690	海尔智家	18,043,743.04	2.26
106	600884	杉杉股份	17,960,018.61	2.25
107	002410	广联达	17,924,963.00	2.24
108	002244	滨江集团	17,899,261.00	2.24
109	601658	邮储银行	17,879,333.43	2.23
110	300073	当升科技	17,876,138.20	2.23
111	000333	美的集团	17,815,446.44	2.23
112	000988	华工科技	17,811,054.21	2.23
113	601928	凤凰传媒	17,799,144.76	2.22
114	600787	中储股份	17,717,599.00	2.21
115	002212	天融信	17,702,848.00	2.21
116	601186	中国铁建	17,449,643.00	2.18
117	000725	京东方 A	17,394,349.00	2.17
118	002371	北方华创	17,357,348.00	2.17
119	300130	新国都	17,263,840.03	2.16
120	002555	三七互娱	17,225,491.38	2.15
121	300244	迪安诊断	17,207,858.45	2.15
122	002375	亚厦股份	17,179,916.01	2.15
123	300755	华致酒行	17,102,606.00	2.14
124	600160	巨化股份	17,014,044.00	2.13
125	603589	口子窖	17,006,465.00	2.13
126	600426	华鲁恒升	16,857,022.52	2.11
127	000062	深圳华强	16,709,013.00	2.09
128	600718	东软集团	16,613,935.00	2.08
129	600867	通化东宝	16,579,614.20	2.07

130	002517	恺英网络	16,499,423.06	2.06
131	300573	兴齐眼药	16,487,468.00	2.06
132	002008	大族激光	16,411,292.00	2.05
133	601006	大秦铁路	16,173,754.00	2.02
134	003816	中国广核	16,051,861.00	2.01
135	300059	东方财富	16,035,607.20	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	9,242,725,513.26
卖出股票收入（成交）总额	9,516,302,563.55

### 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 本基金投资股指期货的投资政策

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本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

### 8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,708.12
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,708.12

### 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	持有	户均持有	持有人结构
----	----	------	-------

级别	人户数 (户)	的基金份额	机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
中信建投量化精选6个月持有期混合A	3,324	60,682.39	3,032,368.47	1.5033%	198,675,902.48	98.4967%
中信建投量化精选6个月持有期混合C	5,715	69,878.31	4,200,016.00	1.0517%	395,154,497.74	98.9483%
合计	8,887	67,633.94	7,232,384.47	1.2033%	593,830,400.22	98.7967%

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额 比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	中信建投量化精选6个月持有期混合A	334,090.59	0.1656%
	中信建投量化精选6个月持有期混合C	141,021.10	0.0353%
	合计	475,111.69	0.0790%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
----	------	-------------------

本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	中信建投量化精选6个月持有期混合A	10~50
	中信建投量化精选6个月持有期混合C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	中信建投量化精选6个月持有期混合A	0
	中信建投量化精选6个月持有期混合C	0
	合计	0

### §10 开放式基金份额变动

单位：份

	中信建投量化精选6个月持有期混合A	中信建投量化精选6个月持有期混合C
基金合同生效日(2021年07月27日)基金份额总额	242,486,586.62	540,134,151.70
本报告期期初基金份额总额	260,832,390.19	571,243,002.88
本报告期基金总申购份额	4,362,523.90	7,299,602.40
减：本报告期基金总赎回份额	63,486,643.14	179,188,091.54
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	201,708,270.95	399,354,513.74

### §11 重大事件揭示

#### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

#### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

#### 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60,000.00元整，该审计机构自2021年7月27日（基金合同生效日）起为本基金提供审计服务。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
华创证券（券商柜台）	2	18,731,294,163.33	100.00%	9,952,882.66	100.00%	-

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

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

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

(3) 评估实行评分制，具体如下：

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

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

## 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中信建投基金管理有限公司关于旗下公开募集证券投资基金执行新金融工具相关会计准则的公告	规定网站、规定报刊	2022-01-05
2	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分基金投资关联方承销证券的公告	规定网站、规定报刊	2022-01-08
3	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分公开募集证券投资基金可投资于北京证券交易所股票及相关风险提示的公告	规定网站、规定报刊	2022-01-20
4	中信建投基金管理有限公司旗下部分基金2021年第4季度报告提示性公告	规定报刊	2022-01-24
5	中信建投量化精选6个月持有期混合型证券投资基金2021年第4季度报告	规定网站	2022-01-24
6	中信建投量化精选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	规定网站、规定报刊	2022-01-25
7	中信建投基金管理有限公司关于公司股东变更的公告	规定网站、规定报刊	2022-01-27
8	中信建投基金管理有限公司关于完成股东变更工商变更	规定网站、规定报刊	2022-02-11

	登记的公告		
9	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加鼎信汇金（北京）投资管理有限公司为代销机构并开通定期定额投资业务及开展费率优惠的公告	规定网站、规定报刊	2022-02-17
10	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加上海万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及开展费率优惠的公告	规定网站、规定报刊	2022-02-23
11	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分基金投资关联方承销证券的公告	规定网站、规定报刊	2022-03-02
12	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分基金投资关联方承销证券的公告	规定网站、规定报刊	2022-03-10
13	中信建投基金管理有限公司旗下部分基金2021年年度报告提示性公告	规定报刊	2022-03-31
14	中信建投量化精选6个月持有期混合型证券投资基金2021年年度报告	规定网站	2022-03-31
15	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分基金投资关联方承销证券的公告	规定网站、规定报刊	2022-04-02
16	中信建投基金管理有限公司旗下部分基金2022年第1季度报告提示性公告	规定报刊	2022-04-22
17	中信建投量化精选6个月持有期混合型证券投资基金2022年第1季度报告	规定网站	2022-04-22



18	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加中国人寿保险股份有限公司为代销机构并开通定期定额投资业务及开展费率优惠的公告	规定网站、规定报刊	2022-04-28
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	规定网站、规定报刊	2022-05-13
20	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分基金投资关联方承销证券的公告	规定网站、规定报刊	2022-05-28
21	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投起点金额的公告	规定网站、规定报刊	2022-05-31
22	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分基金投资关联方承销证券的公告	规定网站、规定报刊	2022-06-01
23	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加宁波银行股份有限公司为代销机构及开展费率优惠的公告	规定网站、规定报刊	2022-06-15
24	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分基金投资关联方承销证券的公告	规定网站、规定报刊	2022-07-02
25	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加青岛意才基金销售有限公司为代销机构并开通定期定额投资及开展费率优惠业务的公告	规定网站、规定报刊	2022-07-12
26	中信建投基金管理有限公司旗下部分基金2022年第2季度报告提示性公告	规定报刊	2022-07-21

27	中信建投量化精选6个月持有期混合型证券投资基金2022年第2季度报告	规定网站	2022-07-21
28	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加泰信财富基金销售有限公司为代销机构并开通定期定额投资业务及开展费率优惠的公告	规定网站、规定报刊	2022-07-29
29	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分基金投资关联方承销证券的公告	规定网站、规定报刊	2022-07-29
30	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分基金投资关联方承销证券的公告	规定网站、规定报刊	2022-07-30
31	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分基金投资关联方承销证券的公告	规定网站、规定报刊	2022-08-11
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	规定网站、规定报刊	2022-08-17
33	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加北京中植基金销售有限公司为代销机构并开通定期定额投资业务及开展费率优惠的公告	规定网站、规定报刊	2022-08-19
34	中信建投基金管理有限公司旗下部分基金2022年中期报告提示性公告	规定报刊	2022-08-31
35	中信建投量化精选6个月持有期混合型证券投资基金2022年中期报告	规定网站	2022-08-31
36	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加招商	规定网站、规定报刊	2022-09-21

	证券股份有限公司为代销机构并开通定期定额投资业务及开展费率优惠的公告		
37	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加招商银行股份有限公司招赢通为销售平台并开展费率优惠的公告	规定网站、规定报刊	2022-09-29
38	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分基金投资关联方承销证券的公告	规定网站、规定报刊	2022-10-14
39	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金在中信银行股份有限公司开通基金转换业务的公告	规定网站、规定报刊	2022-10-14
40	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加北京创金启富基金销售有限公司为代销机构并开通定期定额投资业务及开展费率优惠的公告	规定网站、规定报刊	2022-10-24
41	中信建投基金管理有限公司旗下部分基金2022年第3季度报告提示性公告	规定报刊	2022-10-26
42	中信建投量化精选6个月持有期混合型证券投资基金2022年第3季度报告	规定网站	2022-10-26
43	关于中信建投基金管理有限公司旗下基金在销售机构开通定投业务、定投起点金额及申购费率优惠业务的提示性公告	规定网站、规定报刊	2022-11-01
44	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分基金投资关联	规定网站、规定报刊	2022-11-05

	方承销证券的公告		
45	中信建投基金管理有限公司 关于旗下部分基金投资关联方承销证券的公告	规定网站、规定报刊	2022-11-12
46	中信建投基金管理有限公司 关于旗下部分基金投资关联方承销证券的公告	规定网站、规定报刊	2022-11-25
47	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加泛华普益基金销售有限公司为代销机构并开通定期定额投资及开展费率优惠业务的公告	规定网站、规定报刊	2022-12-01
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	规定网站、规定报刊	2022-12-03
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	规定网站、规定报刊	2022-12-10

## §12 影响投资者决策的其他重要信息

### 12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本报告期内，未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，无影响投资者决策的其他重要信息。

## §13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

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

6、基金托管人业务资格批件、营业执照。

### 13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

### 13.3 查阅方式

投资者可以在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

中信建投基金管理有限公司  
二〇二三年三月三十一日