
中信证券量化优选股票型集合资产管理计划

2024 年年度报告

2024 年 12 月 31 日

基金管理人：中信证券资产管理有限公司

基金托管人：中信银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二五年三月三十一日

§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 2025 年 3 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料已经审计。毕马威华振会计师事务所 (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 2024 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	4
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
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	14
§6 审计报告	14
6.1 审计意见	15
6.2 形成审计意见的基础	15
6.3 其他信息	15
6.4 管理层和治理层对财务报表的责任	15
6.5 注册会计师对财务报表审计的责任	16
§7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	18
7.3 净资产变动表	19
7.4 报表附注	21
§8 投资组合报告	48
8.1 期末基金资产组合情况	48
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	48
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	49

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	80
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	88
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	89
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	89
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	89
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细	89
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	89
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	89
8.12 投资组合报告附注	89
§9 基金份额持有人信息	90
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	90
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	91
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	91
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	91
§10 开放式基金份额变动	91
§11 重大事件揭示	91
11.1 基金份额持有人大会决议	92
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	92
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	92
11.4 基金投资策略的改变	92
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	92
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	92
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	92
11.8 其他重大事件	93
§12 影响投资者决策的其他重要信息	94
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	94
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	94
§13 备查文件目录	94
13.1 备查文件目录	94
13.2 存放地点	94
13.3 查阅方式	94

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中信证券量化优选股票型集合资产管理计划	
基金简称	中信证券量化优选	
基金主代码	900029	
交易代码	900029	
基金运作方式	契约开放式	
基金合同生效日	2020 年 5 月 22 日	
基金管理人	中信证券资产管理有限公司	
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	265,617,915.76 份	
基金合同存续期	自 2020 年 5 月 22 日起至 2025 年 6 月 30 日	
下属分级基金的基金简称	中信证券量化优选 A	中信证券量化优选 C
下属分级基金的交易代码	900029	900030
报告期末下属分级基金的份额总额	136,560,748.76 份	129,057,167.00 份

注：本报告所述的“基金”也包括按照《证券公司大集合资产管理业务适用<关于规范金融机构资产管理业务的指导意见>操作指引》的要求进行变更后的证券公司大集合资产管理产品。

2.2 基金产品说明

投资目标	本集合计划通过量化模型，合理配置资产权重，精选个股，坚持价值和成长为核心的长期稳健型投资，在充分控制投资风险的前提下，力求并创造持续稳定的相对收益。
投资策略	通过量化模型构建投资组合进行选股，主要投资策略有权益类资产投资策略、债权类资产投资策略和衍生品投资策略等。
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	本集合计划为股票型集合计划，其风险收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

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		中信证券资产管理有限公司	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	梁源	滕菲菲
	联系电话	010-60838899	4006800000
	电子邮箱	liangyuan@citics.com	tengfeifei@citicbank.com
客户服务电话		95548 转 5	95558
传真		(010) 60836627	010-85230024
注册地址		北京市丰台区金丽南路 3 号院 2 号楼 1 至 16 层 01 内六层 1-288 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		北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证	北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼

	券大厦 16 层	6-30 层、32-42 层
邮政编码	100026	100020
法定代表人	杨冰	方合英

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.citicsam.com
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）	中国北京东长安街1号东方广场东2座办公楼 8 层
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§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	2024 年		2023 年		2022 年	
	中信证券量化优选 A	中信证券量化优选 C	中信证券量化优选 A	中信证券量化优选 C	中信证券量化优选 A	中信证券量化优选 C
本期已实现收益	11,595,591.02	9,805,779.74	-3,379,894.50	-5,263,340.05	-66,776,755.92	-66,819,752.50
本期利润	15,110,844.11	14,366,406.18	-4,190,837.26	-6,074,217.44	-74,705,443.52	-74,628,774.82
加权平均基金份额本期利润	0.1080	0.1001	-0.0257	-0.0386	-0.3904	-0.4135
本期加权平均净值利润率	11.73%	11.26%	-2.67%	-4.11%	-38.93%	-41.82%
本期基金份额净值增长率	12.85%	11.96%	-3.52%	-4.30%	-28.28%	-28.85%
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末		2023 年末		2022 年末	
	中信证券量化优选 A	中信证券量化优选 C	中信证券量化优选 A	中信证券量化优选 C	中信证券量化优选 A	中信证券量化优选 C
期末可供分配利润	3,391,570.60	-10,948,753.31	-13,734,785.25	-25,671,892.72	-10,547,601.19	-22,041,949.09
期末可供分	0.0248	-0.0848	-0.0919	-0.1656	-0.0588	-0.1327

配基金份额利润						
期末基金资产净值	139,952,319.36	127,488,137.96	135,687,949.44	136,746,088.44	168,831,243.88	153,087,001.37
期末基金份额净值	1.0248	0.9878	0.9081	0.8823	0.9412	0.9219
3.1.3 累计期末指标	2024 年末		2023 年末		2022 年末	
	中信证券量化优选 A	中信证券量化优选 C	中信证券量化优选 A	中信证券量化优选 C	中信证券量化优选 A	中信证券量化优选 C
基金份额累计净值增长率	16.68%	12.47%	3.39%	0.46%	7.16%	4.96%

注：①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。

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

3.2 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

1. 中信证券量化优选 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	1.16%	1.54%	-1.92%	1.65%	3.08%	-0.11%
过去六个月	14.36%	1.45%	13.05%	1.58%	1.31%	-0.13%
过去一年	12.85%	1.19%	14.04%	1.27%	-1.19%	-0.08%
过去三年	-21.91%	1.17%	-19.21%	1.12%	-2.70%	0.05%
自基金合同生效起至今	16.68%	1.29%	0.98%	1.13%	15.70%	0.16%

2. 中信证券量化优选 C：

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	0.96%	1.54%	-1.92%	1.65%	2.88%	-0.11%
过去六个月	13.91%	1.45%	13.05%	1.58%	0.86%	-0.13%
过去一年	11.96%	1.19%	14.04%	1.27%	-2.08%	-0.08%
过去三年	-23.76%	1.17%	-19.21%	1.12%	-4.55%	0.05%
自基金合同生效起至今	12.47%	1.29%	0.98%	1.13%	11.49%	0.16%

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

中信证券量化优选股票型集合资产管理计划

自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2020 年 5 月 22 日至 2024 年 12 月 31 日)

1、中信证券量化优选 A



2、中信证券量化优选 C

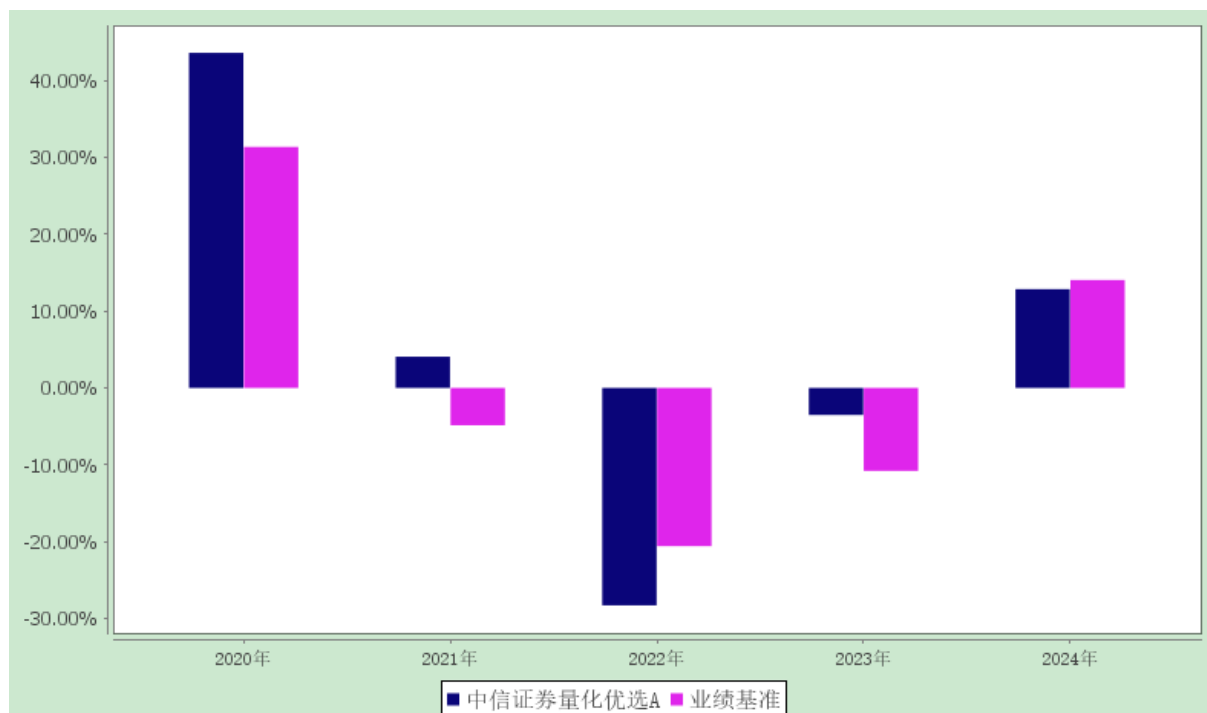


3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

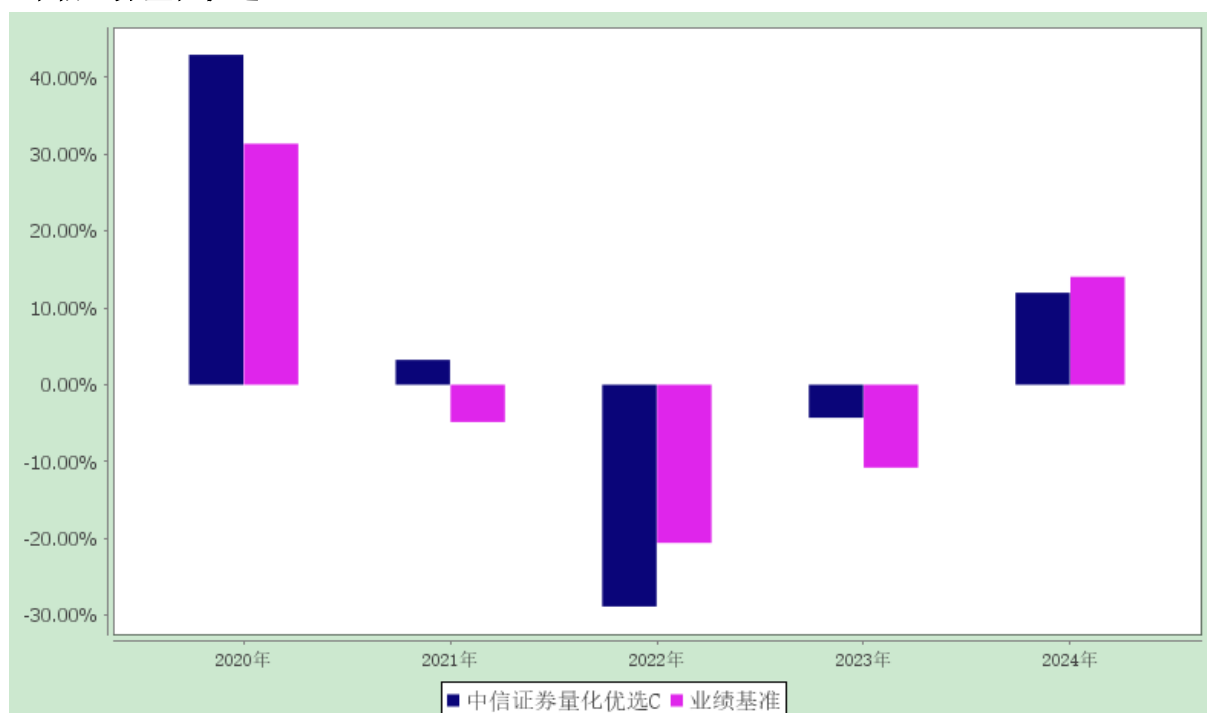
中信证券量化优选股票型集合资产管理计划

自基金合同生效以来净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图

1、中信证券量化优选 A



2、中信证券量化优选 C



注：本基金基金合同生效日为2020年05月22日,2020年度的相关数据根据当年实际存续期(2020年05月22日至2020年12月31日)计算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

过去三年无利润分配。

§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

中信证券股份有限公司（以下简称“中信证券”）于 1995 年 10 月 25 日在北京成立。2002 年 12 月 13 日，经中国证券监督管理委员会核准，中信证券向社会公开发行 4 亿股普通 A 股股票，2003 年 1 月 6 日在上海证券交易所挂牌上市交易，股票简称“中信证券”，股票代码“600030”。2011 年 10 月 6 日在香港联合交易所上市交易，股票代码为“6030”。

中信证券资产管理有限公司（以下简称“中信证券资管”或“公司”）是经中国证监会证监许可[2022] 3254 号文批准，由中信证券设立的全资证券资产管理子公司，公司注册资本 10 亿元。公司前身为中信证券资产管理部，自 1998 年开始经营资产管理业务，在投研能力和管理规模上均保持快速发展，与客户携手共同成长，受托管理资金总规模连续 14 年稳居同业首位。

2023 年 11 月 1 日，中信证券股份有限公司与中信证券资产管理有限公司发布《关于中信证券股份有限公司管理的资产管理计划变更管理人的公告》，根据《中华人民共和国证券投资基金法》，按照《中信证券量化优选股票型集合资产管理计划资产管理合同》约定，经与托管人协商一致，本基金的管理人自 2023 年 11 月 1 日起由中信证券股份有限公司变更为中信证券资产管理有限公司。

中信证券资管根据《证券公司大集合资产管理业务适用关于规范金融机构资产管理业务的指导意见操作指引》的要求，截至 2024 年 12 月 31 日，旗下已有 19 只大集合产品完成公募化改造，分别为“中信证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划”、“中信证券红利价值一年持有混合型集合资产管理计划”、“中信证券臻选价值成长混合型集合资产管理计划”、“中信证券量化优选股票型集合资产管理计划”、“中信证券卓越成长两年持有期混合型集合资产管理计划”、“中信证券稳健回报混合型集合资产管理计划”、“中信证券臻选回报两年持有期混合型集合资产管理计划”、“中信证券成长动力混合型集合资产管理计划”、“中信证券增益十八个月持有期债券型集合资产管理计划”、“中信证券信远一年持有期混合型集合资产管理计划”、“中信证券债券优化一年持有期债券型集合资产管理计划”、“中信证券品质生活混合型集合资产管理计划”、“中信证券财富优选一年持有期混合型基金中基金（FOF）集合资产管理计划”、“中信证券信盈一年持有期债券型集合资产管理计划”、“中信证券增利一年定期开放债券型集合资产管理计划”、“中信证券债券增强六个月持有期债券型集合

资产管理计划”、“中信证券现金增值货币型集合资产管理计划”、“中信证券现金添利货币型集合资产管理计划”、“中信证券中短债债券型集合资产管理计划”。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

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		
魏宇	本基金的基金经理	2022-02-08	-	14	男，香港大学统计学博士。现任中信证券资产管理有限公司量化投资经理。2010 年加入北京尊嘉资产管理有限公司，从事量化策略的研究与开发，并参与量化私募产品的管理。2014 年加入中金基金管理有限公司，曾任投资经理管理量化专户产品，后任基金经理管理量化公募基金，获得“英华奖”两次。2021 年加入中信证券，主要负责资产管理业务量化类产品的投资管理工作。
李天颖	本基金的基金经理助理	2022-07-29	-	13	女，英国约克大学金融管理学硕士。现任中信证券资产管理有限公司固定收益投资经理。曾任中国银河证券交易员，中信信诚资产管理有限公司债券投资经理。2017 年加入中信证券，负责资产管理业务债券产品的投资工作，有多年从业经验。

注：①基金的首任基金经理，其“任职日期”为基金合同生效日，其“离任日期”为根据公司决议确定的解聘日期。

②非首任基金经理，其“任职日期”和“离任日期”分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期。

③证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

④依据《证券业从业人员资格管理常见问题解答》，从业年限满 12 个月算一年，不满一年向下取整。

⑤为加强基金流动性管理，本基金安排了相关人员协助基金经理进行现金头寸与流动性管理。

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
魏宇	公募基金	2	322,316,886.98	2017 年 03 月 28 日
	私募资产管理计划	1	12,790.50	2024 年 04 月 16 日
	其他组合	-	-	-
	合计	3	322,329,677.48	

注：任职时间为投资经理在行业内首次管理本类产品的时间。

4.1.4 基金经理薪酬机制

本基金的基金经理薪酬激励不存在与私募资产管理计划浮动管理费或产品业绩表现挂钩的情况。

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，本基金管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》《证券公司大集合资产管理业务适用关于规范金融机构资产管理业务的指导意见操作指引》等有关法律法规及基金合同、招募说明书等有关基金法律文件的规定，依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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《中信证券资产管理有限公司公平交易制度》。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

本基金管理人一贯公平对待旗下管理的所有基金和组合，制定并严格遵守相应的制度和流程，通过系统和人工等方式在各环节严格控制交易公平执行。报告期内，本公司严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《中信证券资产管理有限公司公平交易制度》《中信证券资产管理有限公司异常交易监控与报告管理制度》的规定。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

本基金管理人对旗下同一投资经理管理的基金和组合进行多层次控制和管理。针对投资经理兼任情形，管理人根据《基金经理兼任私募资产管理计划投资经理工作指引（试行）》强化交易行为管控：兼任投资经理所属各组合实施同向交易应遵循“同时同价”原则，强化事前控制和事后监测，禁止同日反向交易（完全按有关指数构成比例进行投资等特定情形除外）；交易监测和分析方面，对不同时窗下反向交易和同向交易价差进行监控（最长时窗达 10 个交易日），对交易所竞价交易同日反向交易成交量较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5%的交易进行事后分析。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

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

回顾 2024 年，A 股市场整体呈现震荡上行行情。中证全指上涨 7.43%，万得全 A 上涨 10.00%。各大规模指数全年表现整体偏大市值。大盘的沪深 300 指数上涨 14.68%，中盘的中证 500 指数上涨 5.46%，中小盘的中证 1000 指数上涨 1.20%，小盘的中证 2000 指数下跌 2.14%。

行业表现方面，全年中信一级行业指数涨多跌少，20 个行业上涨，受央行降准、降息等逆周期调节政策影响，银行和非银行金融表现最强势，家电次之，分别上涨 42.84%、33.67%、31.35%；10 个行业收跌，受经济增长放缓的影响，综合表现最差，下跌 19.07%，除综合外，医药、农林牧渔、消费者服务表现最弱，分别下跌 12.83%、9.55%、8.70%。中信 5 大风格指数上看，全年表现也有分歧。消费类表现最差，下跌 2.23%，其余风格均为上涨，金融类表现最好，上涨 33.36%，稳定类上涨 17.32%，成长类上涨 7.38%，周期类上涨 7.31%。

风格上看，市值层面，整体偏大市值风格。万得超大盘股指数上涨 30.84%，万得大盘股指数上涨 15.82%，但微盘股表现也不错，优于中小盘股，万得微盘股指数上涨 10.00%，而万得中盘股指数只上涨 5.35%，万得小盘股指数更是下跌 0.37%。

量化优选 A 全年绝对收益 12.85%，超额收益-1.19%。产品绝对收益尚可，相对收益方面，由于年初在小市值上的部分暴露，造成超额收益有所回撤，后面在一直追赶，到年底最终还是未能使得超额收益翻正。吸取年初的经验和教训，未来会继续秉持量化的投资手段，但更加重视控制风险，力争能够创造更稳健的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2024 年 12 月 31 日，中信证券量化优选 A 基金份额净值为 1.0248 元，本报告期份额净值增长率为 12.85%；中信证券量化优选 C 基金份额净值为 0.9878 元，本报告期份额净值增长率为 11.96%；同期业绩比较基准增长率为 14.04%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2025 年的权益市场，随着核心城市房价企稳和社会融资增速回升，国内信用周期、宏观价格和 A 股盈利有望迎来上行周期，A 股市场的投融资生态、投资者生态和产品生态也将进入新的发展阶段。在此背景下，绩优成长、内需消费和并购重组将成为三大重要投资赛道。

绩优成长关注自主可控和新兴产业两大主线。美国对中国科技产业的持续限制将强化自主可控预期，建议重点关注半导体先进制程、设备、材料、零部件以及信创等领域。同时，新质生产力的

发展将带来产业升级机遇，AI 终端、智能汽车和商业航天等领域值得关注。

内需消费，政策推动内需消费复苏，配置策略从必选消费逐步拓展至可选消费。当前，消费互联网、低估值的乳制品和大众餐饮等必需板块具有攻守兼备的特性；而餐饮供应链、酒类、人力资源服务和酒店等顺周期行业有望在政策落地后展现弹性，建议逐步增配。

并购重组，政策支持和产业升级需求推动并购重组迎来新机遇。可以关注两类机会：一是产业链整合，重点在电子、医疗器械和汽车零部件等领域；二是跨产业并购，特别是已公告“控制权变更”或实控人有体外资产的企业。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

在本报告期内，管理人持续加强合规管理、风险管理和监察稽核工作。合规管理方面，管理人积极跟踪法律法规变化和监管动态更新，及时向业务团队传达最新法律法规和监管政策，认真评估其对业务的影响并明确各项法规、监管要求的落实责任部门，使得管理人的从业人员知法、守法，合法合规展业；管理人不断完善内控制度建设，通过制度和流程明细合规管理要点并细化工作要求，确保在内控有效性的前提下稳健展业；继续开展合规宣导，不断增强管理员工的合规意识，促进合规文化的建设，通过对新员工的合规培训、对全体人员的年度合规培训等各种多样形式，并结合最新的法律法规变化、监管政策更新及行业风险事件，加深员工对法律法规、监管政策及风险的理解，从而使得法律法规、监管政策等合规要点在管理人内部得到切实落实。风险管理方面，管理人严格落实事前严格监督审查、事中严格指标监控、事后及时分析管理的三阶段工作部署，在持续对日常投资运作进行监督的同时，加强对基金流动性风险的管理和风控指标的强制合规管理，督促投研交易业务的合规开展。监察稽核方面，管理人定期和不定期开展多项内部稽核，对投资决策、投资研究、交易执行、基金销售、信息技术等关键业务和岗位进行监察监督，并关注内部控制的健全性和有效性，及时提出相应的改进性建议，促进管理人业务合规运作、稳健经营。

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及基金合同约定，本基金管理人作为准确、及时进行基金估值和份额净值计价，制定了基金估值和份额净值计价的业务管理制度，建立了估值委员会，使用可靠的估值业务系统，设有完善的风险监测、控制和报告机制。本基金托管人审阅本基金管理人采用的估值原则及技术，并复核、审查基金资产净值和基金份额申购、赎回价格。会计师事务所对估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性发表专业意见。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

报告期内未进行收益分配。

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

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万元的情形。

§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，对本基金报告期的投资运作，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，中信证券资产管理有限公司在本基金的投资运作、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，中信证券资产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报告期内的财务指标、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

毕马威华振审字第 2506521 号

中信证券量化优选股票型集合资产管理计划全体份额持有人：

6.1 审计意见

我们审计了后附的中信证券量化优选股票型集合资产管理计划（以下简称“该基金”）财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）及财务报表附注 7.4.2 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”）和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了该基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净资产变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则（以下简称“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。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于该基金，并履行了职业道德方面的其他责任。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。

6.3 其他信息

该基金管理人中信证券资产管理有限公司（以下简称“该基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括该基金 2024 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。

结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。

基于我们已执行的工作，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。

6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

该基金管理人管理层负责按照企业会计准则及财务报表附注 7.4.2 所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。

在编制财务报表时，该基金管理人管理层负责评估该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，除非该基金预计在清算时资产无法按照公允价值处置。

该基金管理人治理层负责监督该基金的财务报告过程。

6.5 注册会计师对财务报表审计的责任

我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：

(1)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(2)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。

(3)评价该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。

(4)对该基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对该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该基金不能持续经营。

(5)评价财务报表的总体列报 (包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

我们与该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。

毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）

中国注册会计师

张楠 倪益

中国北京东长安街1号东方广场东2座办公楼8层

2025年3月28日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：中信证券量化优选股票型集合资产管理计划

报告截止日：2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	15,685,369.78	3,290,359.12
结算备付金		1,782,685.99	2,488,394.17
存出保证金		123,060.48	125,920.70
交易性金融资产	7.4.7.2	251,421,095.40	266,803,907.33
其中：股票投资		236,569,482.30	249,524,781.31
基金投资		-	-
债券投资		14,851,613.10	17,279,126.02
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	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		38,147.48	2,469,383.79
应收股利		-	-
应收申购款		36,197.00	557.71
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		269,086,556.13	275,178,522.82
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-

应付清算款		-	1,287,939.22
应付赎回款		309,405.48	287,039.68
应付管理人报酬		229,777.43	232,436.26
应付托管费		34,466.60	34,865.44
应付销售服务费		263,930.82	186,216.94
应付投资顾问费		-	-
应交税费		178,306.28	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	630,212.20	715,987.40
负债合计		1,646,098.81	2,744,484.94
净资产：			
实收基金	7.4.7.10	265,617,915.76	304,405,082.71
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.11	1,822,541.56	-31,971,044.83
净资产合计		267,440,457.32	272,434,037.88
负债和净资产总计		269,086,556.13	275,178,522.82

注：报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额总额 265,617,915.76 份，其中 A 类基金份额净值 1.0248 元，基金份额总额 136,560,748.76 份；C 类基金份额净值 0.9878 元，基金份额总额 129,057,167.00 份。

7.2 利润表

会计主体：中信证券量化优选股票型集合资产管理计划

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
一、营业总收入		33,711,005.82	-5,320,184.74
1.利息收入		70,508.60	95,601.14
其中：存款利息收入	7.4.7.12	70,508.60	95,601.14
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		25,501,743.51	-3,833,065.15
其中：股票投资收益	7.4.7.13	18,930,988.64	-8,019,456.83
基金投资收益	7.4.7.14	-	-
债券投资收益	7.4.7.15	288,508.96	360,777.74
资产支持证券投资收益	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-

股利收益	7.4.7.19	6,282,245.91	3,825,613.94
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益（若有）		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.20	8,075,879.53	-1,621,820.15
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	62,874.18	39,099.42
减：二、营业总支出		4,233,755.53	4,944,869.96
1. 管理人报酬		2,564,474.53	3,050,135.97
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费		384,671.03	457,520.45
3. 销售服务费		1,021,681.06	1,183,528.28
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. 税金及附加		82,392.55	71,880.08
8. 其他费用	7.4.7.22	180,536.36	181,805.18
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		29,477,250.29	-10,265,054.70
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		29,477,250.29	-10,265,054.70
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		29,477,250.29	-10,265,054.70

7.3 净资产变动表

会计主体：中信证券量化优选股票型集合资产管理计划

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	304,405,082.71	-31,971,044.83	272,434,037.88
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
二、本期期初净资产	304,405,082.71	-31,971,044.83	272,434,037.88
三、本期增减变动	-38,787,166.95	33,793,586.39	-4,993,580.56

额（减少以“-”号填列）			
（一）、综合收益总额	-	29,477,250.29	29,477,250.29
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-38,787,166.95	4,316,336.10	-34,470,830.85
其中：1.基金申购款	45,631,060.96	-1,430,453.58	44,200,607.38
2.基金赎回款	-84,418,227.91	5,746,789.68	-78,671,438.23
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-
四、本期期末净资产	265,617,915.76	1,822,541.56	267,440,457.32
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	345,442,390.71	-23,524,145.46	321,918,245.25
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
二、本期期初净资产	345,442,390.71	-23,524,145.46	321,918,245.25
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-41,037,308.00	-8,446,899.37	-49,484,207.37
（一）、综合收益总额	-	-10,265,054.70	-10,265,054.70
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-41,037,308.00	1,818,155.33	-39,219,152.67
其中：1.基金申购	45,762,583.83	-2,504,318.46	43,258,265.37

款			
2.基金赎回款	-86,799,891.83	4,322,473.79	-82,477,418.04
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-
四、本期期末净资产	304,405,082.71	-31,971,044.83	272,434,037.88

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：

基金管理人负责人：杨冰

主管会计工作负责人：梁源

会计机构负责人：杨天玉

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

中信证券量化优选股票型集合资产管理计划(以下简称“本基金”)是由中信证券套利宝 1 号集合资产管理计划转型而来。中信证券量化优选股票集合资产管理计划的管理人中信证券股份有限公司于 2020 年 5 月 13 日发布《中信证券套利宝 1 号集合资产管理计划变更的公告》。根据公告，中信证券套利宝 1 号集合资产管理计划名称变更为“中信证券量化优选股票型集合资产管理计划”，中信证券套利宝 1 号集合资产管理计划份额转换为中信证券量化优选股票型集合资产管理计划份额。合同变更后，本基金的托管人、登记机构不变。自 2020 年 5 月 22 日起《中信证券量化优选股票型集合资产管理计划资产管理合同》、《中信证券量化优选股票型集合资产管理计划托管协议》生效。本基金自资产管理合同变更生效日起存续期至 2025 年 6 月 30 日。本基金的原管理人为中信证券股份有限公司(以下简称“中信证券”)，托管人为中信银行股份有限公司(以下简称“中信银行”)。

中信证券和中信证券资产管理有限公司(以下简称“中信证券资管”)于 2023 年 11 月 1 日发布《关于中信证券股份有限公司管理的资产管理计划变更管理人的公告》，按照《中信证券量化优选股票型集合资产管理计划资产管理合同》约定，本基金的管理人自 2023 年 11 月 1 日起由中信证券变更为中信证券资管。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中信证券量化优选股票型集合资产管理计划资产管理合同》的有关规定，本基金的投资范围主要为：具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发

行的股票(包括主板、中小板、创业板以及其他经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)允许投资的股票)、债券(包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券(含超短期融资券)、可交换债券)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括定期存款、协议存款、通知存款等)、同业存单、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许公开募集证券投资基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许公开募集证券投资基金投资其他品种,基金管理人将在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为:本基金股票投资占基金资产的 80%-95%,除股票外的其他资产占基金资产的 5%-20%。每个交易日日终扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后,本基金持有的现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:沪深 300 指数收益率 $\times$ 95%+银行活期存款利率(税后) $\times$ 5%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称“企业会计准则”)的要求,同时亦按照中国证监会颁布的《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颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》及财务报表附注 7.4.4 所列示的中国证监会、中国证券投资基金业协会发布的其他有关基金行业实务操作的规定编制财务报表。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求,真实、完整地反映了本基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况、2024 年度的经营成果和净资产变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币,编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(a) 金融资产的分类

本基金通常根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征，在初始确认时将金融资产分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以摊余成本计量的金融资产。

除非本基金改变管理金融资产的业务模式，在此情形下，所有受影响的相关金融资产在业务模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类，否则金融资产在初始确认后不得进行重分类。

本基金将同时符合下列条件且未被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，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；
- 该金融资产的合同条款规定，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。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产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。本基金现无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。

管理金融资产的业务模式，是指本基金如何管理金融资产以产生现金流量。业务模式决定本基金所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本基金以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础，确定管理金融资产的业务模式。

本基金对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定时期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本基金对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

(b) 金融负债的分类

本基金将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及以摊余成本计量的金融负债。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

该类金融负债包括交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具）和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

本基金现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。

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

(a) 金融工具的初始确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

(b) 金融工具的后续计量

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失（包括利息和股利收入）计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

- 以摊余成本计量的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债以公允价值进行后续计量，除与套期会计有关外，产生的利得或损失（包括利息费用）计入当期损益。

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

(c) 金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 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；
- 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。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产在终止确认日的账面价值；
- 因转移金融资产而收到的对价。

金融负债 (或其一部分) 的现时义务已经解除的, 本基金终止确认该金融负债 (或该部分金融负债)。

(d)金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础, 对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备:

- 以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

预期信用损失的计量

预期信用损失, 是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失, 是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额, 即全部现金短缺的现值。

在计量预期信用损失时, 本基金需考虑的最长期限为面临信用风险的最长合同期限 (包括考虑续约选择权)。

整个存续期预期信用损失, 是指因金融工具整个预计存续期内所有可能发生的违约事件而导致的预期信用损失。

未来 12 个月内预期信用损失, 是指因资产负债表日后 12 个月内 (若金融工具的预计存续期少于 12 个月, 则为预计存续期) 可能发生的金融工具违约事件而导致的预期信用损失, 是整个存续期预期信用损失的一部分。

本基金对满足下列情形的金融工具按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备, 对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备:

- 该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险; 或
- 该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

预期信用损失准备的列报

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化, 本基金在每个资产负债表日重新计量预期信用损失, 由此形成的损失准备的增加或转回金额, 应当作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产, 损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

核销

如果本基金不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回, 则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本基金确定债务人没有

资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是，被减记的金融资产仍可能受到本基金催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据企业会计准则的规定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。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，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，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

对不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，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。

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似金融工具的现行市价及重大变化等因素，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

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

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份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。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

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

投资收益

股票投资收益、债券投资收益、资产支持证券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其初始计量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资及资产支持证券投资，在其持有期间，按票面金额和票面利率计算的利息计入投资收益。

公允价值变动收益

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、衍生工具、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。不包括本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资在持有期间按票面利率计算的利息。

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 (如有) 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。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配收益将有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益分配方式分两种：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相应类别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；在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每份基金份额每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 10%；基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值。

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。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

编制财务报表时，本基金需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入和支出的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本基金对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

对于证券交易所上市的股票，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《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，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。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，根据中基协发 [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》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《关于固定收益品种的估值处理标准》在银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所及中国证券监督管理委员会认可的其他交易场所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值基准服务机构提供的价格数据进行估值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

7.4.6 税项

本基金运作过程中涉及的各项纳税事项，依照财政部、国家税务总局的相关规定以及其他相关规定执行。主要税项列示如下：

(1)根据财政部和国家税务总局发布的《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》(财税[2016]36 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[2016]140 号)、《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税[2017]2 号)及《关于资管产品增值税有关问题的通知》(财税[2017]56 号)及其他相关税务法规的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。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。

对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入免征增值税。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)截至财务报表批准日，财政部和国家税务总局并未就计划的所得税事项出台具体规定。2024 年度，本基金没有计提所得税费用。如果涉及计划业务的有关税收法规在未来得以明确，财务报表就此所作出的估计可能会根据相关税务法规而作出调整。

(3)本基金进行的证券交易所适用的出让方应征收的印花税税率为 0.10%，对受让方不再征税；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。对于计划通过沪港通、深港通买卖、继承、赠与与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

(4)根据《中华人民共和国个人所得税法》、《国家税务总局关于加强企业债券利息个人所得税代扣代缴工作的通知》(国税函[2003]612 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[2012]85 号)及《财政部国家税务总局证监会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[2015]101 号)、《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司

股息红利差别化个人所得税政策的公告》(财政部、税务总局公告 2024 年第 8 号)及其他相关税务法规的规定,对从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司(“挂牌公司”)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。

截至目前,由于没有专门针对计划作为上述股息红利及债券利息个人所得税代扣代缴义务人的明确税务规定,经与托管人协商一致,本基金对所取得的股息红利收入不计提股息红利个人所得税;本基金在实际取得债券利息收入时按收到的利息金额确认收入,不计提债券利息个人所得税。如果上述税务事项的最终认定结果与估计存在差异,该差异将可能对作出上述最终认定所对应期间的应代扣代缴所得税和净资产金额产生影响。

(5)对计划运营过程中缴纳的增值税,分别按照资管产品管理人所在地适用的税率,计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

(6)对计划取得的源自境外的差价收入和股利收益,其涉及的境外所得税税收政策,按照相关国家或地区税收法律和法规执行。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位:人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	15,685,369.78	3,290,359.12
等于: 本金	15,683,599.95	3,290,037.64
加: 应计利息	1,769.83	321.48
定期存款	-	-
等于: 本金	-	-
加: 应计利息	-	-
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	-	-
等于: 本金	-	-
加: 应计利息	-	-
合计	15,685,369.78	3,290,359.12

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2024 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		237,571,665.46	-	236,569,482.30	-1,002,183.16
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	14,711,722.00	125,923.10	14,851,613.10	13,968.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	14,711,722.00	125,923.10	14,851,613.10	13,968.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		252,283,387.46	125,923.10	251,421,095.40	-988,215.16
项目		上年度末 2023 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		258,596,043.00	-	249,524,781.31	-9,071,261.69
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	17,079,633.00	192,326.02	17,279,126.02	7,167.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	17,079,633.00	192,326.02	17,279,126.02	7,167.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		275,675,676.00	192,326.02	266,803,907.33	-9,064,094.69

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

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。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

无。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

7.4.7.8 其他资产

无。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	34.67	3.35
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	485,877.53	571,684.05
其中：交易所市场	485,877.53	571,684.05
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提信息披露费	120,000.00	120,000.00
预提审计费	24,300.00	24,300.00
合计	630,212.20	715,987.40

7.4.7.10 实收基金

中信证券量化优选 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	149,422,734.69	149,422,734.69
本期申购	18,753,036.01	18,753,036.01

本期赎回（以“-”号填列）	-31,615,021.94	-31,615,021.94
本期末	136,560,748.76	136,560,748.76

中信证券量化优选 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	154,982,348.02	154,982,348.02
本期申购	26,878,024.95	26,878,024.95
本期赎回（以“-”号填列）	-52,803,205.97	-52,803,205.97
本期末	129,057,167.00	129,057,167.00

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.11 未分配利润

中信证券量化优选 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	40,180,685.75	-53,915,471.00	-13,734,785.25
本期期初	40,180,685.75	-53,915,471.00	-13,734,785.25
本期利润	11,595,591.02	3,515,253.09	15,110,844.11
本期基金份额交易产生的变动数	-2,565,509.92	4,581,021.66	2,015,511.74
其中：基金申购款	5,766,002.60	-5,273,594.02	492,408.58
基金赎回款	-8,331,512.52	9,854,615.68	1,523,103.16
本期已分配利润	-	-	-
本期末	49,210,766.85	-45,819,196.25	3,391,570.60

中信证券量化优选 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-25,671,892.72	7,435,633.14	-18,236,259.58
本期期初	-25,671,892.72	7,435,633.14	-18,236,259.58
本期利润	9,805,779.74	4,560,626.44	14,366,406.18
本期基金份额交易产生的变动数	4,917,359.67	-2,616,535.31	2,300,824.36
其中：基金申购款	-4,647,785.78	2,724,923.62	-1,922,862.16
基金赎回款	9,565,145.45	-5,341,458.93	4,223,686.52
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-10,948,753.31	9,379,724.27	-1,569,029.04

7.4.7.12 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月

	31 日	31 日
活期存款利息收入	37,967.51	48,486.10
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	30,507.66	44,784.32
其他	2,033.43	2,330.72
合计	70,508.60	95,601.14

7.4.7.13 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	3,106,355,198.12	4,013,293,412.85
减：卖出股票成本总额	3,083,455,154.40	4,014,727,767.90
减：交易费用	3,969,055.08	6,585,101.78
买卖股票差价收入	18,930,988.64	-8,019,456.83

注：卖出股票成交总额中扣除了股票投资收益中增值税的影响。

7.4.7.14 基金投资收益

无。

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
债券投资收益——利息收入	304,897.06	341,957.44
债券投资收益——买卖债券 (债转股及债券到期兑付)差价收入	-16,388.10	18,820.30
债券投资收益——赎回差价收入	-	-
债券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	288,508.96	360,777.74

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
----	---	--

卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	29,660,907.58	25,556,571.58
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	29,137,793.00	25,073,597.00
减：应计利息总额	533,379.86	454,175.28
减：交易费用	6,122.82	9,979.00
买卖债券差价收入	-16,388.10	18,820.30

注：卖出债券成交总额中扣除了债券投资收益中增值税的影响。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

7.4.7.17 贵金属投资收益

无。

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

7.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	6,282,245.91	3,825,613.94
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	6,282,245.91	3,825,613.94

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	8,075,879.53	-1,621,820.15
——股票投资	8,069,078.53	-1,615,442.42
——债券投资	6,801.00	-6,377.73
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-

——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	8,075,879.53	-1,621,820.15

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	62,874.18	39,099.42
合计	62,874.18	39,099.42

7.4.7.22 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
审计费用	24,300.00	24,300.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行手续费	51.00	537.96
账户维护费	18,000.00	16,500.00
其他	18,185.36	20,467.22
合计	180,536.36	181,805.18

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，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中信证券资产管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中信证券股份有限公司	原管理人、管理人股东、基金销售机构
中信银行股份有限公司	基金托管人、管理人其他关联方、基金销售机构
中信证券(山东)有限责任公司	管理人其他关联方、基金销售机构

上海华夏财富投资管理有限公司	管理人其他关联方、基金销售机构
中信期货有限公司	管理人其他关联方、基金销售机构
中信证券华南股份有限公司	管理人其他关联方、基金销售机构

注：①下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

②本基金的管理人自 2023 年 11 月 1 日起由中信证券股份有限公司变更为中信证券资产管理有限公司。中信证券资产管理有限公司是中信证券股份有限公司的全资子公司。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中信证券股份有限公司	6,169,472,977.36	100.00%	7,990,842,803.99	100.00%

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
中信证券股份有限公司	41,497,012.00	100.00%	49,293,960.85	100.00%

7.4.10.1.4 债券回购交易

无。

7.4.10.1.5 基金交易

无。

7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日
-------	--

	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中信证券股份有限公司	2,025,900.53	100.00%	485,877.53	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中信证券股份有限公司	2,621,201.32	100.00%	571,684.05	100.00%

注：上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果。

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,564,474.53	3,050,135.97
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,200,156.55	1,144,417.95
应支付基金管理人的净管理费	1,364,317.98	1,905,718.02

注：①2023 年 11 月 1 日，中信证券股份有限公司与中信证券资产管理有限公司发布《关于中信证券股份有限公司管理的资产管理计划变更管理人的公告》，根据《中华人民共和国证券投资基金法》，按照《中信证券量化优选股票型集合资产管理计划资产管理合同》约定，经与托管人协商一致，本基金的管理人自 2023 年 11 月 1 日起由中信证券股份有限公司变更为中信证券资产管理有限公司。

②本基金本期发生的基金应支付的固定管理费 2,564,474.53 元，本基金管理费按前一日基金资产净值 1.00%的年费率计提，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 × 1.00% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	384,671.03	457,520.45

注：支付托管人中信银行的托管费按前一日基金资产净值 0.15%的年费率计提，按月支付。其计算公式为：

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.15% / 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中信证券量化优选 A	中信证券量化优选 C	合计
中信证券股份有限公司	-	838,939.48	838,939.48
中信银行股份有限公司	-	16,154.91	16,154.91
上海华夏财富投资管理有限公司	-	231.48	231.48
中信证券华南股份有限公司	-	90,544.51	90,544.51
中信证券(山东)有限责任公司	-	25,995.58	25,995.58
中信期货有限公司	-	514.13	514.13
合计	-	972,380.09	972,380.09
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中信证券量化优选 A	中信证券量化优选 C	合计
中信银行股份有限公司	-	16,728.79	16,728.79
中信证券股份有限公司	-	974,661.13	974,661.13
上海华夏财富投资管理有限公司	-	256.50	256.50
中信证券华南股份有限公司	-	104,104.23	104,104.23
中信证券(山东)有限责任公司	-	26,165.51	26,165.51
中信期货有限公司	-	694.66	694.66
合计	-	1,122,610.82	1,122,610.82

注：本基金 A 类份额不收取销售服务费。C 类份额的销售服务费按前一日 C 类份额资产净值 0.80% 的年费率计提，按月支付。计算公式为：日销售服务费 = 前一日 C 类份额资产净值 × 0.80% / 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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

7.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

无。

7.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.5.2 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。

7.4.10.6 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 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	15,685,369.78	37,967.51	3,290,359.12	48,486.10

注：本基金的银行存款由托管行中信银行保管，按同业利率或约定利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

报告期内，因执行量化策略，本基金通过集合竞价交易方式投资于中信金属股份有限公司及中信国安信息产业股份有限公司发行的股票，上述交易为一般关联交易，交易价格公允，不存在利益输送的情况。

7.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

无。

7.4.11 利润分配情况

无。

7.4.12 期末（2024 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票	股票	停牌	停牌	期末估值	复牌	复牌开	数量	期末	期末	备注
----	----	----	----	------	----	-----	----	----	----	----

代码	名称	日期	原因	单价	日期	盘单价	(单位: 股)	成本总额	估值总额	
002494	华斯股份	2024-12-30	重大事项	3.99	2025-01-14	3.60	6,200.00	24,973.60	24,738.00	-
300807	天迈科技	2024-12-30	重大事项	30.31	2025-01-07	36.37	700.00	24,446.62	21,217.00	-
400174	中天 3	2023-08-30	重整事项	-	-	-	400.00	331.65		-

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。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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市场风险、流动性风险及信用风险。本基金管理人制定了相应的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。

本基金管理人建立了由风险管理部、稽核审计部、法律与风险处置部及合规部组成的风险控制职能部门，独立开展对业务和相关操作的风险评价。风险管理部、稽核审计部、法律与风险处置部及合规部等互相配合，建立信息沟通机制，从事前、事中、事后全面进行业务风险监控。此外，业务部门也建立了自身的内部控制机制，主要由授权体系和业务后台部门信息监控机制组成。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金均投资于具有良好信用等级度的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，在银行间同业市场交易前对交易对手进行信用评估，以控制相应的信用风险。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	14,851,613.10	17,279,126.02
合计	14,851,613.10	17,279,126.02

注：未评级债券包括期限一年以内的国债、政策性金融债、央行票据及未有第三方机构评级的短期融资券和超短期融资券。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本报告期末及上年末均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本报告期末及上年末均未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本报告期末及上年末均未持有按长期信用评级列示的债券。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本报告期末及上年末均未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本报告期末及上年末均未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指无法通过变现资产等途径以合理成本及时获得充足资金，用于偿付到期债务、满足计划份额持有人赎回需求、履行其他支付义务和满足正常业务开展的其他资金需求的风险。本基金的流动性风险一方面来自于份额持有人于约定开放日要求赎回本基金计划，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。

流动性风险的管理目标是建立科学完善的流动性风险管理体系，对流动性风险进行有效识别、计量、监测和控制，确保流动性需求能够及时以合理成本得到满足。针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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。

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风险进行监控，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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	15,685,369.78	-	-	-	15,685,369.78
交易性金融资产	14,851,613.10	-	-	236,569,482.30	251,421,095.40
存出保证金	123,060.48	-	-	-	123,060.48
结算备付金	1,782,685.99	-	-	-	1,782,685.99

应收清算款	-	-	-	38,147.48	38,147.48
应收申购款	-	-	-	36,197.00	36,197.00
资产总计	32,442,729.35	-	-	236,643,826.78	269,086,556.13
负债					
应付赎回款	-	-	-	309,405.48	309,405.48
应付管理人报酬	-	-	-	229,777.43	229,777.43
应付托管费	-	-	-	34,466.60	34,466.60
应付销售服务费	-	-	-	263,930.82	263,930.82
应交税费	-	-	-	178,306.28	178,306.28
其他负债	-	-	-	630,212.20	630,212.20
负债总计	-	-	-	1,646,098.81	1,646,098.81
利率敏感度缺口	32,442,729.35	-	-	234,997,727.97	267,440,457.32
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	3,290,359.12	-	-	-	3,290,359.12
交易性金融资产	17,279,126.02	-	-	249,524,781.31	266,803,907.33
存出保证金	125,920.70	-	-	-	125,920.70
结算备付金	2,488,394.17	-	-	-	2,488,394.17
应收清算款	-	-	-	2,469,383.79	2,469,383.79
应收申购款	-	-	-	557.71	557.71
资产总计	23,183,800.01	-	-	251,994,722.81	275,178,522.82
负债					
应付清算款	-	-	-	1,287,939.22	1,287,939.22
应付赎回款	-	-	-	287,039.68	287,039.68
应付管理人报酬	-	-	-	232,436.26	232,436.26
应付托管费	-	-	-	34,865.44	34,865.44
应付销售服务费	-	-	-	186,216.94	186,216.94
其他负债	-	-	-	715,987.40	715,987.40
负债总计	-	-	-	2,744,484.94	2,744,484.94
利率敏感度缺口	23,183,800.01	-	-	249,250,237.87	272,434,037.88

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

假设	除市场利率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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	市场利率上升 25 个基点	-16,003.49	-18,109.42
	市场利率下降 25 个基点	16,040.87	18,150.60

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。本基金报告期末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

其他价格风险为除市场利率和外汇汇率以外的市场因素发生变动时产生的价格波动风险。本基金的其他价格风险主要为市场价格变化或波动所引起的股票、基金等资产损失的可能性。

本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险。此外，本基金管理人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进行风险度量和分析，以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 2024 年 12 月 31 日		上年度末 2023 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	236,569,482.30	88.46	249,524,781.31	91.59
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
合计	236,569,482.30	88.46	249,524,781.31	91.59

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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	业绩比较基准下降 5%	-12,206,035.63	-11,734,265.72
	业绩比较基准上升 5%	12,206,035.63	11,734,265.72

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层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

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 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	236,523,527.30	248,923,939.31
第二层次	14,897,568.10	17,879,968.02
第三层次	-	-
合计	251,421,095.40	266,803,907.33

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。

对于本基金投资的证券交易所上市的证券，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时，本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑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，确定相关证券公允价值的层次。

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 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	-	-

期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	160.00	160.00
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-160.00	-160.00
其中：计入损益的利得或损失	-	-160.00	-160.00
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-

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
中天 3	-	成本法	重置成本	-	正相关关系
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

中天 3	-	成本法	重置成本	-	正相关关系
------	---	-----	------	---	-------

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2024 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工具。

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工具主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至报告期末，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	236,569,482.30	87.92
	其中：股票	236,569,482.30	87.92
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	14,851,613.10	5.52
	其中：债券	14,851,613.10	5.52
	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	17,468,055.77	6.49
8	其他各项资产	197,404.96	0.07
9	合计	269,086,556.13	100.00

8.2 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

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	2,145,298.00	0.80
B	采矿业	16,667,625.24	6.23
C	制造业	120,059,962.59	44.89
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	11,753,328.40	4.39

E	建筑业	9,359,025.00	3.50
F	批发和零售业	923,950.00	0.35
G	交通运输、仓储和邮政业	10,982,111.00	4.11
H	住宿和餐饮业	45,480.00	0.02
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,889,476.99	5.19
J	金融业	43,580,702.95	16.30
K	房地产业	645,150.00	0.24
L	租赁和商务服务业	3,019,910.00	1.13
M	科学研究和技术服务业	1,333,544.48	0.50
N	水利、环境和公共设施管理业	891,162.65	0.33
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	19,924.00	0.01
Q	卫生和社会工作	379,180.00	0.14
R	文化、体育和娱乐业	504,475.00	0.19
S	综合	369,176.00	0.14
	合计	236,569,482.30	88.46

8.2.2 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。

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	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	4,715.00	7,185,660.00	2.69
2	601318	中国平安	106,443.00	5,604,223.95	2.10
3	000333	美的集团	74,500.00	5,603,890.00	2.10
4	300750	宁德时代	20,140.00	5,357,240.00	2.00
5	601899	紫金矿业	293,202.00	4,433,214.24	1.66
6	600900	长江电力	141,748.00	4,188,653.40	1.57
7	600887	伊利股份	131,600.00	3,971,688.00	1.49
8	688981	中芯国际	41,108.00	3,889,638.96	1.45
9	000725	京东方 A	840,000.00	3,687,600.00	1.38
10	601668	中国建筑	555,000.00	3,330,000.00	1.25
11	600919	江苏银行	338,600.00	3,325,052.00	1.24
12	601601	中国太保	93,700.00	3,193,296.00	1.19
13	601919	中远海控	198,800.00	3,081,400.00	1.15
14	000100	TCL 科技	597,000.00	3,002,910.00	1.12
15	601688	华泰证券	166,700.00	2,932,253.00	1.10
16	601225	陕西煤业	126,000.00	2,930,760.00	1.10
17	600050	中国联通	550,400.00	2,922,624.00	1.09
18	601166	兴业银行	148,500.00	2,845,260.00	1.06
19	002027	分众传媒	400,900.00	2,818,327.00	1.05

20	688012	中微公司	14,848.00	2,808,647.68	1.05
21	601658	邮储银行	488,000.00	2,771,840.00	1.04
22	601169	北京银行	442,900.00	2,723,835.00	1.02
23	601766	中国中车	324,700.00	2,720,986.00	1.02
24	600028	中国石化	406,500.00	2,715,420.00	1.02
25	601600	中国铝业	342,700.00	2,518,845.00	0.94
26	000166	申万宏源	469,600.00	2,512,360.00	0.94
27	600160	巨化股份	101,500.00	2,448,180.00	0.92
28	601868	中国能建	1,053,700.00	2,412,973.00	0.90
29	003816	中国广核	584,100.00	2,412,333.00	0.90
30	002230	科大讯飞	49,600.00	2,396,672.00	0.90
31	601689	拓普集团	48,600.00	2,381,400.00	0.89
32	601881	中国银河	156,200.00	2,378,926.00	0.89
33	600023	浙能电力	414,600.00	2,346,636.00	0.88
34	601319	中国人保	305,500.00	2,327,910.00	0.87
35	603993	洛阳钼业	346,200.00	2,302,230.00	0.86
36	601111	中国国航	289,200.00	2,287,572.00	0.86
37	002459	晶澳科技	166,000.00	2,282,500.00	0.85
38	002422	科伦药业	74,400.00	2,226,792.00	0.83
39	300760	迈瑞医疗	8,300.00	2,116,500.00	0.79
40	601288	农业银行	343,500.00	1,834,290.00	0.69
41	600016	民生银行	421,300.00	1,739,969.00	0.65
42	002001	新和成	79,000.00	1,735,630.00	0.65
43	600309	万华化学	23,900.00	1,705,265.00	0.64
44	300124	汇川技术	27,200.00	1,593,376.00	0.60
45	601857	中国石油	167,500.00	1,497,450.00	0.56
46	002714	牧原股份	38,900.00	1,495,316.00	0.56
47	600219	南山铝业	381,200.00	1,490,492.00	0.56
48	603019	中科曙光	20,500.00	1,482,560.00	0.55
49	601398	工商银行	210,800.00	1,458,736.00	0.55
50	601628	中国人寿	34,600.00	1,450,432.00	0.54
51	600438	通威股份	65,100.00	1,439,361.00	0.54
52	600115	中国东航	357,800.00	1,431,200.00	0.54
53	688041	海光信息	9,514.00	1,425,102.06	0.53
54	600745	闻泰科技	36,400.00	1,411,592.00	0.53
55	601006	大秦铁路	207,900.00	1,409,562.00	0.53
56	600809	山西汾酒	7,600.00	1,399,996.00	0.52
57	603501	韦尔股份	13,200.00	1,378,212.00	0.52
58	601818	光大银行	351,100.00	1,358,757.00	0.51
59	600795	国电电力	286,500.00	1,312,170.00	0.49
60	600031	三一重工	78,900.00	1,300,272.00	0.49
61	601989	中国重工	261,600.00	1,258,296.00	0.47
62	601916	浙商银行	416,600.00	1,212,306.00	0.45

63	300059	东方财富	45,900.00	1,185,138.00	0.44
64	600871	石化油服	573,800.00	1,170,552.00	0.44
65	601669	中国电建	212,000.00	1,157,520.00	0.43
66	688538	和辉光电-U	496,888.00	1,152,780.16	0.43
67	600221	海航控股	674,200.00	1,146,140.00	0.43
68	600567	山鹰国际	573,700.00	1,124,452.00	0.42
69	600482	中国动力	45,700.00	1,118,279.00	0.42
70	300442	润泽科技	21,400.00	1,111,944.00	0.42
71	002281	光迅科技	21,300.00	1,111,221.00	0.42
72	600176	中国巨石	97,500.00	1,110,525.00	0.42
73	601618	中国中冶	334,500.00	1,103,850.00	0.41
74	000158	常山北明	54,700.00	1,101,658.00	0.41
75	600518	康美药业	469,700.00	1,099,098.00	0.41
76	601336	新华保险	21,600.00	1,073,520.00	0.40
77	600941	中国移动	8,800.00	1,039,808.00	0.39
78	600728	佳都科技	214,400.00	1,003,392.00	0.38
79	002050	三花智控	41,900.00	985,069.00	0.37
80	603259	药明康德	17,800.00	979,712.00	0.37
81	688599	天合光能	49,789.00	960,927.70	0.36
82	601127	赛力斯	6,900.00	920,391.00	0.34
83	300661	圣邦股份	11,000.00	899,580.00	0.34
84	605499	东鹏饮料	3,560.00	884,731.20	0.33
85	688169	石头科技	4,031.00	883,957.99	0.33
86	000630	铜陵有色	270,200.00	872,746.00	0.33
87	600660	福耀玻璃	13,100.00	817,440.00	0.31
88	002916	深南电路	5,800.00	725,000.00	0.27
89	603089	正裕工业	77,900.00	698,763.00	0.26
90	600570	恒生电子	24,900.00	696,951.00	0.26
91	000858	五粮液	4,700.00	658,188.00	0.25
92	688303	大全能源	26,651.00	643,355.14	0.24
93	002625	光启技术	13,000.00	621,400.00	0.23
94	002352	顺丰控股	15,300.00	616,590.00	0.23
95	600938	中国海油	20,000.00	590,200.00	0.22
96	600690	海尔智家	19,700.00	560,859.00	0.21
97	688271	联影医疗	4,264.00	538,969.60	0.20
98	601988	中国银行	93,300.00	514,083.00	0.19
99	000917	电广传媒	72,100.00	509,747.00	0.19
100	300573	兴齐眼药	7,200.00	502,416.00	0.19
101	601399	国机重装	161,200.00	496,496.00	0.19
102	002594	比亚迪	1,700.00	480,522.00	0.18
103	600011	华能国际	68,500.00	463,745.00	0.17
104	600989	宝丰能源	27,400.00	461,416.00	0.17
105	600166	福田汽车	152,700.00	383,277.00	0.14

106	603288	海天味业	8,200.00	376,380.00	0.14
107	600770	综艺股份	82,400.00	345,256.00	0.13
108	601118	海南橡胶	58,800.00	318,108.00	0.12
109	301269	华大九天	2,400.00	290,640.00	0.11
110	601816	京沪高铁	45,000.00	277,200.00	0.10
111	688223	晶科能源	38,932.00	276,806.52	0.10
112	002102	能特科技	96,600.00	253,092.00	0.09
113	600688	上海石化	82,900.00	250,358.00	0.09
114	600960	渤海汽车	69,000.00	229,770.00	0.09
115	603566	普莱柯	17,400.00	222,024.00	0.08
116	600100	同方股份	29,300.00	208,323.00	0.08
117	603296	华勤技术	2,900.00	205,755.00	0.08
118	002532	天山铝业	25,500.00	200,685.00	0.08
119	002465	海格通信	17,600.00	193,248.00	0.07
120	600346	恒力石化	12,400.00	190,340.00	0.07
121	600707	彩虹股份	22,800.00	187,416.00	0.07
122	601866	中远海发	71,200.00	185,832.00	0.07
123	688772	珠海冠宇	11,508.00	185,048.64	0.07
124	601991	大唐发电	64,900.00	184,965.00	0.07
125	301078	孩子王	16,200.00	184,356.00	0.07
126	000050	深天马 A	20,400.00	184,212.00	0.07
127	002261	拓维信息	10,000.00	183,100.00	0.07
128	000709	河钢股份	82,000.00	181,220.00	0.07
129	688472	阿特斯	14,293.00	179,520.08	0.07
130	300735	光弘科技	6,400.00	179,136.00	0.07
131	300185	通裕重工	69,400.00	178,358.00	0.07
132	002065	东华软件	24,400.00	177,144.00	0.07
133	300253	卫宁健康	24,500.00	175,420.00	0.07
134	600633	浙数文化	16,600.00	173,636.00	0.06
135	600959	江苏有线	51,800.00	173,530.00	0.06
136	600316	洪都航空	5,300.00	170,236.00	0.06
137	603185	弘元绿能	10,400.00	169,000.00	0.06
138	601992	金隅集团	94,300.00	167,854.00	0.06
139	600996	贵广网络	19,500.00	166,725.00	0.06
140	600782	新钢股份	49,900.00	166,666.00	0.06
141	600339	中油工程	46,400.00	166,112.00	0.06
142	000898	鞍钢股份	69,200.00	166,080.00	0.06
143	000552	甘肃能化	60,300.00	165,825.00	0.06
144	000927	中国铁物	63,000.00	165,690.00	0.06
145	300232	洲明科技	23,800.00	163,506.00	0.06
146	601106	中国一重	55,900.00	162,669.00	0.06
147	600651	飞乐音响	38,800.00	160,632.00	0.06
148	600403	大有能源	54,000.00	158,760.00	0.06

149	688066	航天宏图	7,754.00	158,181.60	0.06
150	000761	本钢板材	49,400.00	158,080.00	0.06
151	300054	鼎龙股份	6,000.00	156,120.00	0.06
152	002585	双星新材	29,200.00	155,928.00	0.06
153	002212	天融信	24,100.00	155,445.00	0.06
154	002973	侨银股份	14,500.00	153,410.00	0.06
155	002059	云南旅游	28,000.00	150,920.00	0.06
156	601279	英利汽车	39,300.00	150,519.00	0.06
157	600758	辽宁能源	43,700.00	150,328.00	0.06
158	600815	厦工股份	56,500.00	149,725.00	0.06
159	002517	恺英网络	11,000.00	149,710.00	0.06
160	002445	中南文化	61,000.00	149,450.00	0.06
161	600939	重庆建工	49,600.00	149,296.00	0.06
162	600936	广西广电	51,700.00	148,896.00	0.06
163	002548	金新农	37,500.00	148,875.00	0.06
164	600099	林海股份	16,900.00	148,720.00	0.06
165	002437	誉衡药业	59,700.00	148,653.00	0.06
166	600307	酒钢宏兴	93,400.00	148,506.00	0.06
167	600726	华电能源	64,800.00	148,392.00	0.06
168	603188	亚邦股份	42,700.00	148,169.00	0.06
169	002996	顺博合金	22,300.00	148,072.00	0.06
170	000509	华塑控股	44,400.00	147,852.00	0.06
171	300489	光智科技	2,700.00	147,636.00	0.06
172	002551	尚荣医疗	47,900.00	147,532.00	0.06
173	300427	红相股份	25,000.00	147,500.00	0.06
174	002172	澳洋健康	47,100.00	147,423.00	0.06
175	601388	怡球资源	59,900.00	147,354.00	0.06
176	603499	翔港科技	5,700.00	147,345.00	0.06
177	603222	济民健康	21,700.00	147,343.00	0.06
178	603038	华立股份	9,000.00	147,150.00	0.06
179	002250	联化科技	26,700.00	147,117.00	0.06
180	300587	天铁股份	33,500.00	147,065.00	0.05
181	600990	四创电子	6,900.00	146,832.00	0.05
182	002801	微光股份	6,000.00	146,760.00	0.05
183	002109	兴化股份	46,200.00	146,454.00	0.05
184	300247	融捷健康	40,900.00	146,422.00	0.05
185	002849	威星智能	8,200.00	146,124.00	0.05
186	603882	金域医学	5,300.00	145,909.00	0.05
187	002413	雷科防务	33,400.00	145,624.00	0.05
188	300510	金冠股份	34,300.00	145,432.00	0.05
189	688488	艾迪药业	18,497.00	145,386.42	0.05
190	688319	欧林生物	13,631.00	144,488.60	0.05
191	300074	华平股份	36,300.00	144,474.00	0.05

192	002111	威海广泰	13,100.00	144,362.00	0.05
193	688033	天宜上佳	25,051.00	144,043.25	0.05
194	002793	罗欣药业	37,600.00	143,632.00	0.05
195	601999	出版传媒	22,800.00	142,956.00	0.05
196	688280	精进电动 -UW	32,522.00	142,771.58	0.05
197	600984	建设机械	44,700.00	142,593.00	0.05
198	300214	日科化学	25,500.00	142,545.00	0.05
199	300415	伊之密	7,100.00	142,426.00	0.05
200	601059	信达证券	9,500.00	142,310.00	0.05
201	688133	泰坦科技	7,731.00	141,013.44	0.05
202	300583	赛托生物	7,100.00	138,805.00	0.05
203	603920	世运电路	4,600.00	135,240.00	0.05
204	002162	悦心健康	38,800.00	134,248.00	0.05
205	600495	晋西车轴	35,100.00	133,380.00	0.05
206	002453	华软科技	26,000.00	131,300.00	0.05
207	000503	国新健康	11,700.00	128,466.00	0.05
208	002456	欧菲光	10,700.00	128,186.00	0.05
209	600162	香江控股	66,600.00	127,872.00	0.05
210	000032	深桑达 A	7,000.00	123,480.00	0.05
211	301236	软通动力	2,100.00	123,291.00	0.05
212	000776	广发证券	7,600.00	123,196.00	0.05
213	000975	山金国际	8,000.00	122,960.00	0.05
214	600429	三元股份	27,900.00	122,760.00	0.05
215	600383	金地集团	27,700.00	121,326.00	0.05
216	601211	国泰君安	6,500.00	121,225.00	0.05
217	002736	国信证券	10,800.00	120,960.00	0.05
218	600999	招商证券	6,300.00	120,708.00	0.05
219	601865	福莱特	6,100.00	120,109.00	0.04
220	600169	太原重工	48,100.00	119,769.00	0.04
221	600662	外服控股	23,600.00	119,652.00	0.04
222	601136	首创证券	5,400.00	118,800.00	0.04
223	002414	高德红外	15,800.00	117,394.00	0.04
224	300199	翰宇药业	8,900.00	114,721.00	0.04
225	600418	江淮汽车	2,900.00	108,750.00	0.04
226	002475	立讯精密	2,600.00	105,976.00	0.04
227	600103	青山纸业	40,600.00	103,936.00	0.04
228	603098	森特股份	10,800.00	103,680.00	0.04
229	601777	力帆科技	13,000.00	99,450.00	0.04
230	688082	盛美上海	971.00	97,100.00	0.04
231	300515	三德科技	8,100.00	96,471.00	0.04
232	002142	宁波银行	3,900.00	94,809.00	0.04
233	688047	龙芯中科	716.00	94,712.48	0.04

234	688506	百利天恒-U	490.00	93,947.70	0.04
235	002096	易普力	7,800.00	92,664.00	0.03
236	300757	罗博特科	400.00	90,128.00	0.03
237	300346	南大光电	2,200.00	84,898.00	0.03
238	600664	哈药股份	20,400.00	84,252.00	0.03
239	002330	得利斯	19,100.00	83,467.00	0.03
240	600235	民丰特纸	14,600.00	82,782.00	0.03
241	688120	华海清科	490.00	79,865.10	0.03
242	300048	合康新能	15,400.00	77,616.00	0.03
243	688019	安集科技	552.00	76,926.72	0.03
244	600905	三峡能源	17,600.00	76,912.00	0.03
245	688469	芯联集成-U	14,990.00	76,898.70	0.03
246	002130	沃尔核材	3,000.00	75,750.00	0.03
247	688213	思特威-W	972.00	75,543.84	0.03
248	002851	麦格米特	1,200.00	73,752.00	0.03
249	301358	湖南裕能	1,600.00	72,512.00	0.03
250	600363	联创光电	1,500.00	71,820.00	0.03
251	688018	乐鑫科技	322.00	70,196.00	0.03
252	688361	中科飞测	797.00	69,777.35	0.03
253	601985	中国核电	6,600.00	68,838.00	0.03
254	600569	安阳钢铁	36,600.00	68,076.00	0.03
255	600171	上海贝岭	1,700.00	67,456.00	0.03
256	002405	四维图新	6,700.00	64,588.00	0.02
257	600744	华银电力	20,500.00	63,755.00	0.02
258	688249	晶合集成	2,724.00	63,578.16	0.02
259	000415	渤海租赁	15,600.00	58,812.00	0.02
260	688347	华虹公司	1,211.00	56,275.17	0.02
261	600595	中孚实业	19,800.00	56,034.00	0.02
262	600330	天通股份	7,800.00	55,380.00	0.02
263	002063	远光软件	9,600.00	55,296.00	0.02
264	601333	广深铁路	16,000.00	54,880.00	0.02
265	600095	湘财股份	7,500.00	54,000.00	0.02
266	601778	晶科科技	19,000.00	53,580.00	0.02
267	300674	宇信科技	2,700.00	52,704.00	0.02
268	601678	滨化股份	13,900.00	52,264.00	0.02
269	688525	佰维存储	836.00	51,806.92	0.02
270	000877	天山股份	9,100.00	51,506.00	0.02
271	600751	海航科技	19,400.00	51,022.00	0.02
272	002567	唐人神	10,000.00	51,000.00	0.02
273	600968	海油发展	11,900.00	50,813.00	0.02
274	002421	达实智能	14,800.00	50,764.00	0.02
275	300079	数码视讯	9,300.00	50,313.00	0.02
276	688571	杭华股份	7,327.00	49,164.17	0.02

277	600252	中恒集团	19,800.00	48,708.00	0.02
278	000425	徐工机械	6,000.00	47,580.00	0.02
279	603588	高能环境	9,000.00	47,160.00	0.02
280	002061	浙江交科	11,500.00	46,920.00	0.02
281	002706	良信股份	6,100.00	46,848.00	0.02
282	000528	柳工	3,800.00	45,828.00	0.02
283	603005	晶方科技	1,600.00	45,200.00	0.02
284	688343	云天励飞-U	869.00	43,102.40	0.02
285	688322	奥比中光 -UW	916.00	42,594.00	0.02
286	688702	盛科通信-U	503.00	42,252.00	0.02
287	300085	银之杰	1,100.00	42,075.00	0.02
288	600531	豫光金铅	6,500.00	41,730.00	0.02
289	600073	光明肉业	6,000.00	41,640.00	0.02
290	300451	创业慧康	9,200.00	41,216.00	0.02
291	300623	捷捷微电	1,200.00	40,992.00	0.02
292	002550	千红制药	6,600.00	40,920.00	0.02
293	603477	巨星农牧	2,300.00	40,825.00	0.02
294	688297	中无人机	1,006.00	40,521.68	0.02
295	002837	英维克	1,000.00	40,400.00	0.02
296	688498	源杰科技	301.00	40,394.20	0.02
297	002402	和而泰	2,200.00	39,842.00	0.01
298	001696	宗申动力	1,600.00	39,840.00	0.01
299	000488	晨鸣纸业	13,000.00	39,650.00	0.01
300	002859	洁美科技	1,900.00	39,425.00	0.01
301	603118	共进股份	4,400.00	39,160.00	0.01
302	002312	川发龙蟒	2,700.00	39,069.00	0.01
303	300458	全志科技	1,000.00	38,760.00	0.01
304	688484	南芯科技	1,071.00	38,598.84	0.01
305	002139	拓邦股份	2,800.00	38,108.00	0.01
306	300459	汤姆猫	6,600.00	37,884.00	0.01
307	002745	木林森	4,300.00	37,496.00	0.01
308	002446	盛路通信	5,700.00	37,335.00	0.01
309	688327	云从科技 -UW	3,080.00	37,268.00	0.01
310	688007	光峰科技	2,492.00	36,856.68	0.01
311	000881	中广核技	5,000.00	36,650.00	0.01
312	300088	长信科技	5,600.00	36,624.00	0.01
313	300679	电连技术	600.00	35,820.00	0.01
314	003012	东鹏控股	5,400.00	35,694.00	0.01
315	601975	招商南油	11,400.00	35,682.00	0.01
316	605589	圣泉集团	1,500.00	35,370.00	0.01
317	002060	广东建工	9,600.00	35,136.00	0.01

318	688052	纳芯微	267.00	34,790.10	0.01
319	688027	国盾量子	116.00	34,609.76	0.01
320	002191	劲嘉股份	8,200.00	34,440.00	0.01
321	301308	江波龙	400.00	34,400.00	0.01
322	688503	聚和材料	776.00	34,369.04	0.01
323	688158	优刻得-W	2,453.00	34,292.94	0.01
324	002583	海能达	2,400.00	34,104.00	0.01
325	002126	银轮股份	1,800.00	33,696.00	0.01
326	600559	老白干酒	1,600.00	33,584.00	0.01
327	688141	杰华特	1,090.00	33,364.90	0.01
328	688608	恒玄科技	102.00	33,187.74	0.01
329	603989	艾华集团	2,200.00	33,176.00	0.01
330	300315	掌趣科技	6,000.00	33,000.00	0.01
331	000766	通化金马	2,100.00	32,970.00	0.01
332	000533	顺钠股份	5,400.00	32,724.00	0.01
333	688037	芯源微	389.00	32,532.07	0.01
334	601677	明泰铝业	2,700.00	32,481.00	0.01
335	002620	瑞和股份	7,200.00	32,328.00	0.01
336	300068	南都电源	2,000.00	32,280.00	0.01
337	300857	协创数据	300.00	32,067.00	0.01
338	601886	江河集团	5,900.00	31,860.00	0.01
339	688114	华大智造	671.00	31,396.09	0.01
340	688568	中科星图	611.00	31,179.33	0.01
341	688519	南亚新材	1,457.00	30,975.82	0.01
342	688262	国芯科技	1,113.00	30,830.10	0.01
343	688220	翱捷科技-U	566.00	30,614.94	0.01
344	300002	神州泰岳	2,600.00	30,134.00	0.01
345	688515	裕太微-U	304.00	30,096.00	0.01
346	002506	协鑫集成	11,200.00	29,904.00	0.01
347	688110	东芯股份	1,197.00	29,805.30	0.01
348	605567	春雪食品	3,300.00	29,700.00	0.01
349	688409	富创精密	572.00	29,498.04	0.01
350	300779	惠城环保	300.00	29,280.00	0.01
351	688116	天奈科技	752.00	29,185.12	0.01
352	688072	拓荆科技	189.00	29,043.63	0.01
353	688032	禾迈股份	257.00	28,948.48	0.01
354	002798	帝欧家居	6,600.00	28,908.00	0.01
355	002400	省广集团	3,600.00	28,764.00	0.01
356	300077	国民技术	1,200.00	28,608.00	0.01
357	002634	棒杰股份	7,600.00	28,576.00	0.01
358	603966	法兰泰克	3,700.00	28,564.00	0.01
359	000952	广济药业	4,600.00	28,428.00	0.01
360	600191	华资实业	4,100.00	28,372.00	0.01

361	300296	利亚德	4,400.00	28,336.00	0.01
362	301171	易点天下	1,000.00	28,190.00	0.01
363	002630	华西能源	8,100.00	28,188.00	0.01
364	688362	甬矽电子	836.00	28,156.48	0.01
365	688260	昀冢科技	2,010.00	28,039.50	0.01
366	688183	生益电子	712.00	27,953.12	0.01
367	002218	拓日新能	7,000.00	27,790.00	0.01
368	000665	湖北广电	6,000.00	27,600.00	0.01
369	001301	尚太科技	400.00	27,420.00	0.01
370	301301	川宁生物	2,300.00	27,278.00	0.01
371	688387	信科移动-U	4,567.00	27,219.32	0.01
372	688234	天岳先进	530.00	27,136.00	0.01
373	002910	庄园牧场	3,600.00	27,108.00	0.01
374	002497	雅化集团	2,300.00	26,910.00	0.01
375	603166	福达股份	3,700.00	26,899.00	0.01
376	001201	东瑞股份	1,700.00	26,894.00	0.01
377	601616	广电电气	6,100.00	26,779.00	0.01
378	000030	富奥股份	5,200.00	26,676.00	0.01
379	603876	鼎胜新材	3,000.00	26,550.00	0.01
380	688681	科汇股份	2,463.00	26,526.51	0.01
381	300697	电工合金	2,100.00	26,481.00	0.01
382	002442	龙星化工	4,400.00	26,444.00	0.01
383	600097	开创国际	2,600.00	26,364.00	0.01
384	002858	力盛体育	2,300.00	26,312.00	0.01
385	002731	萃华珠宝	2,800.00	26,292.00	0.01
386	600714	金瑞矿业	2,700.00	26,244.00	0.01
387	688313	仕佳光子	1,601.00	26,240.39	0.01
388	600774	汉商集团	3,500.00	26,215.00	0.01
389	603978	深圳新星	1,700.00	26,197.00	0.01
390	001309	德明利	300.00	26,160.00	0.01
391	003030	祖名股份	1,700.00	26,146.00	0.01
392	600037	歌华有线	3,500.00	26,110.00	0.01
393	300115	长盈精密	1,600.00	25,984.00	0.01
394	000988	华工科技	600.00	25,980.00	0.01
395	301293	三博脑科	600.00	25,968.00	0.01
396	300993	玉马科技	2,300.00	25,967.00	0.01
397	603968	醋化股份	2,800.00	25,956.00	0.01
398	688051	佳华科技	1,243.00	25,879.26	0.01
399	002380	科远智慧	1,400.00	25,872.00	0.01
399	603590	康辰药业	1,100.00	25,872.00	0.01
400	003011	海象新材	1,700.00	25,840.00	0.01
401	600281	华阳新材	7,900.00	25,833.00	0.01
402	600538	国发股份	5,000.00	25,800.00	0.01

403	002887	绿茵生态	3,700.00	25,789.00	0.01
404	603329	上海雅仕	2,000.00	25,780.00	0.01
405	601880	辽港股份	14,900.00	25,777.00	0.01
406	301037	保立佳	2,500.00	25,775.00	0.01
407	600802	福建水泥	6,800.00	25,772.00	0.01
408	301043	绿岛风	900.00	25,767.00	0.01
409	600366	宁波韵升	3,500.00	25,760.00	0.01
410	000520	凤凰航运	5,500.00	25,740.00	0.01
411	000757	浩物股份	6,900.00	25,737.00	0.01
412	600716	凤凰股份	6,800.00	25,704.00	0.01
413	600697	欧亚集团	2,000.00	25,700.00	0.01
414	300816	艾可蓝	1,000.00	25,650.00	0.01
415	002774	快意电梯	3,700.00	25,641.00	0.01
416	002207	准油股份	5,200.00	25,636.00	0.01
417	603616	韩建河山	7,300.00	25,623.00	0.01
418	000698	沈阳化工	7,600.00	25,612.00	0.01
418	603677	奇精机械	1,900.00	25,612.00	0.01
419	600540	新赛股份	6,500.00	25,610.00	0.01
420	002365	永安药业	3,200.00	25,568.00	0.01
421	688326	经纬恒润-W	304.00	25,566.40	0.01
422	000510	新金路	7,100.00	25,560.00	0.01
423	600237	铜峰电子	3,900.00	25,545.00	0.01
424	002696	百洋股份	5,400.00	25,542.00	0.01
425	600800	渤海化学	8,400.00	25,536.00	0.01
426	002863	今飞凯达	5,500.00	25,520.00	0.01
427	688021	奥福环保	2,443.00	25,504.92	0.01
428	300151	昌红科技	1,500.00	25,500.00	0.01
428	301297	富乐德	600.00	25,500.00	0.01
429	603813	原尚股份	2,200.00	25,498.00	0.01
430	301002	崧盛股份	1,500.00	25,485.00	0.01
431	688296	和达科技	2,271.00	25,480.62	0.01
432	603045	福达合金	2,000.00	25,480.00	0.01
433	002688	金河生物	5,700.00	25,479.00	0.01
434	002398	垒知集团	5,800.00	25,462.00	0.01
435	600925	苏能股份	4,800.00	25,440.00	0.01
436	000430	张家界	4,100.00	25,420.00	0.01
436	000541	佛山照明	4,100.00	25,420.00	0.01
436	300016	北陆药业	4,100.00	25,420.00	0.01
436	603538	美诺华	2,000.00	25,420.00	0.01
437	600231	凌钢股份	14,200.00	25,418.00	0.01
438	002942	新农股份	1,800.00	25,416.00	0.01
439	688563	航材股份	455.00	25,407.20	0.01
440	000691	亚太实业	7,400.00	25,382.00	0.01

441	600180	瑞茂通	5,900.00	25,370.00	0.01
442	002671	龙泉股份	5,600.00	25,368.00	0.01
443	688565	力源科技	4,403.00	25,361.28	0.01
444	688195	腾景科技	631.00	25,353.58	0.01
445	600665	天地源	8,100.00	25,353.00	0.01
446	000710	贝瑞基因	3,000.00	25,350.00	0.01
447	002909	集泰股份	5,100.00	25,347.00	0.01
447	300998	宁波方正	1,700.00	25,347.00	0.01
448	600173	卧龙地产	6,400.00	25,344.00	0.01
449	688096	京源环保	3,396.00	25,334.16	0.01
450	000632	三木集团	6,900.00	25,323.00	0.01
451	603810	丰山集团	2,800.00	25,312.00	0.01
452	300912	凯龙高科	2,200.00	25,300.00	0.01
453	002160	常铝股份	6,800.00	25,296.00	0.01
453	002795	永和智控	6,200.00	25,296.00	0.01
454	600072	中船科技	1,800.00	25,290.00	0.01
455	600218	全柴动力	3,200.00	25,280.00	0.01
456	000955	欣龙控股	6,100.00	25,254.00	0.01
457	688548	广钢气体	2,507.00	25,245.49	0.01
458	600561	江西长运	4,700.00	25,239.00	0.01
459	300485	赛升药业	3,600.00	25,236.00	0.01
459	300762	上海瀚讯	1,200.00	25,236.00	0.01
460	000548	湖南投资	4,900.00	25,235.00	0.01
460	300128	锦富技术	4,900.00	25,235.00	0.01
461	002110	三钢闽光	7,600.00	25,232.00	0.01
462	000607	华媒控股	6,800.00	25,228.00	0.01
463	688379	华光新材	1,235.00	25,218.70	0.01
464	000798	中水渔业	3,400.00	25,194.00	0.01
465	002686	亿利达	4,700.00	25,192.00	0.01
466	603101	汇嘉时代	2,700.00	25,191.00	0.01
467	605255	天普股份	2,000.00	25,180.00	0.01
468	002523	天桥起重	7,700.00	25,179.00	0.01
469	002921	联诚精密	2,300.00	25,162.00	0.01
470	605155	西大门	2,500.00	25,150.00	0.01
471	603778	国晟科技	8,300.00	25,149.00	0.01
472	600419	天润乳业	2,700.00	25,137.00	0.01
473	000153	丰原药业	4,100.00	25,133.00	0.01
474	603987	康德莱	3,500.00	25,130.00	0.01
475	688522	纳睿雷达	446.00	25,127.64	0.01
476	002578	闽发铝业	8,400.00	25,116.00	0.01
476	600156	华升股份	5,200.00	25,116.00	0.01
476	601003	柳钢股份	9,100.00	25,116.00	0.01
477	002591	恒大高新	5,100.00	25,092.00	0.01

477	603326	我乐家居	4,100.00	25,092.00	0.01
477	605055	迎丰股份	5,100.00	25,092.00	0.01
478	300627	华测导航	600.00	25,080.00	0.01
478	600684	珠江股份	7,600.00	25,080.00	0.01
478	600735	新华锦	5,500.00	25,080.00	0.01
479	002562	兄弟科技	5,900.00	25,075.00	0.01
480	300335	迪森股份	5,200.00	25,064.00	0.01
481	603708	家家悦	2,200.00	25,058.00	0.01
482	002209	达意隆	2,700.00	25,056.00	0.01
483	002278	神开股份	4,700.00	25,051.00	0.01
484	300196	长海股份	2,300.00	25,047.00	0.01
485	300246	宝莱特	3,800.00	25,042.00	0.01
486	002816	和科达	1,700.00	25,041.00	0.01
487	000720	新能泰山	7,700.00	25,025.00	0.01
488	603177	德创环保	3,400.00	25,024.00	0.01
489	002255	海陆重工	4,500.00	25,020.00	0.01
489	002723	小崧股份	3,600.00	25,020.00	0.01
490	605303	园林股份	3,300.00	25,014.00	0.01
491	002898	赛隆药业	2,600.00	25,012.00	0.01
491	600302	标准股份	5,200.00	25,012.00	0.01
492	603787	新日股份	2,400.00	25,008.00	0.01
493	300710	万隆光电	1,400.00	25,004.00	0.01
494	001202	炬申股份	1,800.00	25,002.00	0.01
495	002982	湘佳股份	1,400.00	24,990.00	0.01
495	300970	华绿生物	2,100.00	24,990.00	0.01
496	600539	狮头股份	3,600.00	24,984.00	0.01
497	002830	名雕股份	2,000.00	24,980.00	0.01
498	002363	隆基机械	3,800.00	24,966.00	0.01
498	300931	通用电梯	3,800.00	24,966.00	0.01
499	000790	华神科技	6,400.00	24,960.00	0.01
500	002672	东江环保	5,900.00	24,957.00	0.01
501	688659	元琛科技	3,697.00	24,954.75	0.01
502	002105	信隆健康	5,000.00	24,950.00	0.01
503	688701	卓锦股份	4,662.00	24,941.70	0.01
504	002231	奥维通信	4,500.00	24,930.00	0.01
505	300230	永利股份	5,600.00	24,920.00	0.01
505	600594	益佰制药	7,000.00	24,920.00	0.01
506	603316	诚邦股份	5,300.00	24,910.00	0.01
507	600108	亚盛集团	8,500.00	24,905.00	0.01
508	002476	宝莫股份	5,900.00	24,898.00	0.01
509	300670	大烨智能	4,300.00	24,897.00	0.01
510	002606	大连电瓷	2,700.00	24,894.00	0.01
511	600883	博闻科技	3,800.00	24,890.00	0.01

512	002253	川大智胜	1,800.00	24,876.00	0.01
513	002968	新大正	2,700.00	24,867.00	0.01
514	002811	郑中设计	2,900.00	24,853.00	0.01
514	600768	宁波富邦	2,900.00	24,853.00	0.01
515	002357	富临运业	3,500.00	24,850.00	0.01
516	000652	泰达股份	6,000.00	24,840.00	0.01
516	300143	盈康生命	2,700.00	24,840.00	0.01
516	603839	安正时尚	4,500.00	24,840.00	0.01
517	300021	大禹节水	6,100.00	24,827.00	0.01
518	603086	先达股份	5,800.00	24,824.00	0.01
519	600192	长城电工	4,300.00	24,811.00	0.01
520	300929	华骐环保	3,000.00	24,810.00	0.01
521	300422	博世科	5,700.00	24,795.00	0.01
521	601002	晋亿实业	5,700.00	24,795.00	0.01
521	603880	南卫股份	5,700.00	24,795.00	0.01
522	301040	中环海陆	2,000.00	24,780.00	0.01
523	601005	重庆钢铁	17,200.00	24,768.00	0.01
524	300051	璿升科技	3,700.00	24,753.00	0.01
525	300434	金石亚药	3,000.00	24,750.00	0.01
526	002494	华斯股份	6,200.00	24,738.00	0.01
527	601828	美凯龙	7,700.00	24,717.00	0.01
528	002692	远程股份	6,300.00	24,696.00	0.01
529	002546	新联电子	5,700.00	24,681.00	0.01
530	603982	泉峰汽车	3,100.00	24,676.00	0.01
531	300967	晓鸣股份	2,100.00	24,675.00	0.01
532	300513	恒实科技	2,700.00	24,651.00	0.01
533	002479	富春环保	5,200.00	24,648.00	0.01
534	002513	蓝丰生化	5,500.00	24,640.00	0.01
535	600439	瑞贝卡	7,300.00	24,601.00	0.01
536	000677	恒天海龙	6,000.00	24,600.00	0.01
536	001227	兰州银行	10,000.00	24,600.00	0.01
536	002169	智光电气	4,000.00	24,600.00	0.01
536	002571	德力股份	6,000.00	24,600.00	0.01
536	300004	南风股份	4,000.00	24,600.00	0.01
537	000953	河化股份	4,400.00	24,596.00	0.01
537	603838	四通股份	4,400.00	24,596.00	0.01
538	000042	中洲控股	5,500.00	24,585.00	0.01
539	600232	金鹰股份	4,700.00	24,581.00	0.01
540	688098	申联生物	4,492.00	24,571.24	0.01
541	605180	华生科技	2,000.00	24,540.00	0.01
542	300512	中亚股份	3,600.00	24,516.00	0.01
543	300839	博汇股份	3,400.00	24,514.00	0.01
543	603090	宏盛股份	1,400.00	24,514.00	0.01

544	300733	西菱动力	2,100.00	24,507.00	0.01
545	603681	永冠新材	1,900.00	24,491.00	0.01
546	002579	中京电子	3,100.00	24,490.00	0.01
547	002724	海洋王	4,600.00	24,472.00	0.01
548	603808	歌力思	3,500.00	24,465.00	0.01
549	688328	深科达	1,633.00	24,462.34	0.01
550	002718	友邦吊顶	2,000.00	24,460.00	0.01
551	601218	吉鑫科技	7,500.00	24,450.00	0.01
552	688103	国力股份	601.00	24,442.67	0.01
553	300854	中兰环保	2,000.00	24,440.00	0.01
554	002295	精艺股份	3,800.00	24,434.00	0.01
555	300375	鹏翎股份	5,300.00	24,433.00	0.01
556	000570	苏常柴 A	4,800.00	24,432.00	0.01
556	600222	太龙药业	4,800.00	24,432.00	0.01
557	300886	华业香料	1,300.00	24,427.00	0.01
558	000599	青岛双星	5,500.00	24,420.00	0.01
559	002817	黄山胶囊	3,900.00	24,414.00	0.01
560	688619	罗普特	2,790.00	24,412.50	0.01
561	603139	康惠制药	1,700.00	24,412.00	0.01
562	605169	洪通燃气	2,400.00	24,408.00	0.01
563	300500	启迪设计	2,300.00	24,403.00	0.01
564	300743	天地数码	1,600.00	24,368.00	0.01
565	600756	浪潮软件	1,700.00	24,361.00	0.01
566	002186	全聚德	2,100.00	24,360.00	0.01
566	301022	海泰科	1,200.00	24,360.00	0.01
567	002286	保龄宝	3,300.00	24,354.00	0.01
568	002104	恒宝股份	3,600.00	24,336.00	0.01
569	603900	莱绅通灵	4,400.00	24,332.00	0.01
570	002772	众兴菌业	3,300.00	24,321.00	0.01
571	300611	美力科技	2,300.00	24,311.00	0.01
572	000985	大庆华科	1,300.00	24,310.00	0.01
572	300270	中威电子	3,400.00	24,310.00	0.01
573	002313	日海智能	3,100.00	24,304.00	0.01
574	300568	星源材质	2,500.00	24,300.00	0.01
574	300940	南极光	1,800.00	24,300.00	0.01
574	603861	白云电器	2,700.00	24,300.00	0.01
575	300659	中孚信息	1,500.00	24,285.00	0.01
576	300164	通源石油	5,700.00	24,282.00	0.01
577	300986	志特新材	2,000.00	24,280.00	0.01
578	688285	高铁电气	3,281.00	24,279.40	0.01
579	688055	龙腾光电	5,875.00	24,263.75	0.01
580	688148	芳源股份	4,901.00	24,259.95	0.01
581	002845	同兴达	1,600.00	24,256.00	0.01

582	002114	罗平锌电	4,300.00	24,252.00	0.01
583	002825	纳尔股份	3,100.00	24,242.00	0.01
584	603158	腾龙股份	3,000.00	24,240.00	0.01
585	003042	中农联合	1,700.00	24,225.00	0.01
585	300950	德固特	1,500.00	24,225.00	0.01
586	300771	智莱科技	2,300.00	24,196.00	0.01
587	300966	共同药业	1,500.00	24,195.00	0.01
588	002655	共达电声	1,900.00	24,187.00	0.01
589	688288	鸿泉物联	1,502.00	24,182.20	0.01
590	300120	经纬辉开	2,600.00	24,180.00	0.01
590	300665	飞鹿股份	3,900.00	24,180.00	0.01
590	603823	百合花	2,600.00	24,180.00	0.01
591	600496	精工钢构	8,000.00	24,160.00	0.01
592	300132	青松股份	4,900.00	24,157.00	0.01
593	300241	瑞丰光电	4,400.00	24,156.00	0.01
593	300283	温州宏丰	4,400.00	24,156.00	0.01
594	300871	回盛生物	2,400.00	24,144.00	0.01
595	001286	陕西能源	2,600.00	24,128.00	0.01
596	603168	莎普爱思	3,600.00	24,120.00	0.01
597	002339	积成电子	3,500.00	24,115.00	0.01
598	603727	博迈科	2,100.00	24,108.00	0.01
599	688579	山大地纬	2,623.00	24,105.37	0.01
600	603017	中衡设计	3,000.00	24,090.00	0.01
601	002403	爱仕达	1,700.00	24,089.00	0.01
601	300447	全信股份	1,700.00	24,089.00	0.01
602	601328	交通银行	3,100.00	24,087.00	0.01
603	300987	川网传媒	1,700.00	24,072.00	0.01
604	605033	美邦股份	2,000.00	24,060.00	0.01
605	688329	艾隆科技	1,757.00	24,053.33	0.01
606	600202	哈空调	5,400.00	24,030.00	0.01
607	300320	海达股份	2,500.00	24,000.00	0.01
607	300610	晨化股份	2,400.00	24,000.00	0.01
608	002662	京威股份	6,200.00	23,994.00	0.01
608	603817	海峡环保	4,300.00	23,994.00	0.01
609	603577	汇金通	3,000.00	23,970.00	0.01
610	603789	星光农机	3,100.00	23,963.00	0.01
611	002556	辉隆股份	4,300.00	23,951.00	0.01
612	002144	宏达高科	2,300.00	23,943.00	0.01
613	688146	中船特气	824.00	23,928.96	0.01
614	600022	山东钢铁	16,500.00	23,925.00	0.01
615	000551	创元科技	2,000.00	23,920.00	0.01
615	002358	森源电气	5,200.00	23,920.00	0.01
616	300789	唐源电气	1,600.00	23,904.00	0.01

617	603926	铁流股份	2,700.00	23,895.00	0.01
618	603618	杭电股份	4,400.00	23,892.00	0.01
619	300745	欣锐科技	1,500.00	23,880.00	0.01
620	603167	渤海轮渡	2,700.00	23,868.00	0.01
621	002451	摩恩电气	3,800.00	23,864.00	0.01
622	600284	浦东建设	3,800.00	23,826.00	0.01
623	301063	海锅股份	1,500.00	23,820.00	0.01
624	603321	梅轮电梯	3,400.00	23,800.00	0.01
625	605058	澳弘电子	1,200.00	23,796.00	0.01
626	603903	中持股份	3,700.00	23,791.00	0.01
627	300239	东宝生物	3,800.00	23,788.00	0.01
628	603600	永艺股份	2,000.00	23,780.00	0.01
629	300523	辰安科技	1,200.00	23,748.00	0.01
630	301028	东亚机械	2,200.00	23,738.00	0.01
631	300030	阳普医疗	4,300.00	23,736.00	0.01
632	603136	天目湖	2,100.00	23,730.00	0.01
633	300995	奇德新材	1,500.00	23,715.00	0.01
634	300069	金利华电	1,800.00	23,706.00	0.01
634	300774	倍杰特	2,700.00	23,706.00	0.01
635	002802	洪汇新材	2,000.00	23,700.00	0.01
635	300955	嘉亨家化	1,500.00	23,700.00	0.01
636	300920	润阳科技	1,400.00	23,688.00	0.01
636	300994	久祺股份	2,100.00	23,688.00	0.01
637	002633	申科股份	2,200.00	23,650.00	0.01
638	603113	金能科技	4,200.00	23,646.00	0.01
639	002637	赞宇科技	2,400.00	23,640.00	0.01
640	002783	凯龙股份	2,900.00	23,635.00	0.01
641	300975	商络电子	2,100.00	23,625.00	0.01
642	688511	天微电子	1,517.00	23,619.69	0.01
643	688616	西力科技	2,273.00	23,616.47	0.01
644	001208	华菱线缆	2,600.00	23,608.00	0.01
645	002058	威尔泰	2,200.00	23,606.00	0.01
646	002382	蓝帆医疗	4,600.00	23,598.00	0.01
647	300110	华仁药业	6,700.00	23,584.00	0.01
647	603315	福鞍股份	2,200.00	23,584.00	0.01
648	603936	博敏电子	2,800.00	23,576.00	0.01
649	001289	龙源电力	1,500.00	23,565.00	0.01
650	300170	汉得信息	1,900.00	23,560.00	0.01
651	000601	韶能股份	5,800.00	23,548.00	0.01
652	600847	万里股份	2,900.00	23,490.00	0.01
653	300182	捷成股份	4,000.00	23,480.00	0.01
654	300424	航新科技	1,300.00	23,478.00	0.01
655	300055	万邦达	4,900.00	23,471.00	0.01

656	002389	航天彩虹	1,300.00	23,465.00	0.01
657	300535	达威股份	1,800.00	23,454.00	0.01
658	002412	汉森制药	3,900.00	23,439.00	0.01
659	688352	硕中科技	1,931.00	23,423.03	0.01
660	000965	天保基建	7,800.00	23,400.00	0.01
661	603386	骏亚科技	2,100.00	23,352.00	0.01
662	603776	永安行	1,800.00	23,346.00	0.01
663	688510	航亚科技	1,340.00	23,342.80	0.01
664	300865	大宏立	1,000.00	23,340.00	0.01
665	688107	安路科技	789.00	23,338.62	0.01
666	600581	八一钢铁	7,600.00	23,332.00	0.01
667	603687	大胜达	3,200.00	23,328.00	0.01
668	600691	阳煤化工	10,500.00	23,310.00	0.01
668	603933	睿能科技	1,500.00	23,310.00	0.01
669	600203	福日电子	2,600.00	23,296.00	0.01
670	002454	松芝股份	3,500.00	23,275.00	0.01
671	688557	兰剑智能	1,213.00	23,253.21	0.01
672	688272	富吉瑞	1,420.00	23,245.40	0.01
673	002676	顺威股份	3,900.00	23,244.00	0.01
674	603020	爱普股份	3,000.00	23,220.00	0.01
675	603232	格尔软件	1,800.00	23,184.00	0.01
676	000554	泰山石油	3,900.00	23,166.00	0.01
677	600351	亚宝药业	3,800.00	23,142.00	0.01
677	603790	雅运股份	2,100.00	23,142.00	0.01
678	000850	华茂股份	5,600.00	23,128.00	0.01
679	300193	佳士科技	2,600.00	23,114.00	0.01
680	603725	天安新材	3,600.00	23,112.00	0.01
681	002057	中钢天源	3,200.00	23,104.00	0.01
681	300514	友讯达	1,600.00	23,104.00	0.01
682	688332	中科蓝讯	177.00	23,098.50	0.01
683	002573	清新环境	5,800.00	23,084.00	0.01
684	002522	浙江众成	5,900.00	23,069.00	0.01
685	603700	宁水集团	2,300.00	23,023.00	0.01
686	000060	中金岭南	4,900.00	22,981.00	0.01
687	603311	金海高科	2,300.00	22,977.00	0.01
688	002617	露笑科技	3,000.00	22,950.00	0.01
688	600276	恒瑞医药	500.00	22,950.00	0.01
689	603668	天马科技	1,800.00	22,932.00	0.01
690	603111	康尼机电	3,800.00	22,914.00	0.01
691	688655	迅捷兴	2,125.00	22,907.50	0.01
692	600488	津药药业	5,400.00	22,896.00	0.01
693	002641	公元股份	5,200.00	22,880.00	0.01
694	601588	北辰实业	12,300.00	22,878.00	0.01

695	002589	瑞康医药	7,700.00	22,869.00	0.01
696	605068	明新旭腾	1,700.00	22,865.00	0.01
697	603528	多伦科技	2,900.00	22,852.00	0.01
698	300160	秀强股份	4,200.00	22,848.00	0.01
699	002558	巨人网络	1,800.00	22,842.00	0.01
700	688004	博汇科技	1,508.00	22,831.12	0.01
701	600310	广西能源	5,000.00	22,800.00	0.01
702	300507	苏奥传感	3,400.00	22,780.00	0.01
703	000751	锌业股份	8,100.00	22,761.00	0.01
704	688189	南新制药	3,479.00	22,752.66	0.01
705	300194	福安药业	5,100.00	22,746.00	0.01
706	605166	聚合顺	1,900.00	22,743.00	0.01
707	603938	三孚股份	2,100.00	22,701.00	0.01
708	300404	博济医药	2,600.00	22,698.00	0.01
709	002222	福晶科技	700.00	22,680.00	0.01
710	002666	德联集团	5,200.00	22,672.00	0.01
711	002054	德美化工	3,900.00	22,659.00	0.01
712	002900	哈三联	2,300.00	22,655.00	0.01
713	688156	路德环境	1,674.00	22,649.22	0.01
714	300385	雪浪环境	4,800.00	22,608.00	0.01
715	600577	精达股份	3,100.00	22,599.00	0.01
716	603010	万盛股份	2,200.00	22,594.00	0.01
717	688335	复洁环保	2,680.00	22,592.40	0.01
718	600261	阳光照明	6,900.00	22,563.00	0.01
719	300519	新光药业	1,700.00	22,559.00	0.01
720	002448	中原内配	3,600.00	22,536.00	0.01
721	002566	益盛药业	3,300.00	22,506.00	0.01
722	600969	郴电国际	3,500.00	22,505.00	0.01
723	002971	和远气体	1,200.00	22,500.00	0.01
724	688308	欧科亿	1,246.00	22,490.30	0.01
725	002245	蔚蓝锂芯	2,100.00	22,449.00	0.01
726	002636	金安国纪	2,900.00	22,446.00	0.01
727	002136	安纳达	2,300.00	22,425.00	0.01
728	600537	亿晶光电	7,300.00	22,411.00	0.01
729	300095	华伍股份	3,300.00	22,407.00	0.01
730	002969	嘉美包装	7,200.00	22,392.00	0.01
731	600361	创新新材	5,800.00	22,388.00	0.01
732	600551	时代出版	2,600.00	22,386.00	0.01
733	603928	兴业股份	2,700.00	22,356.00	0.01
734	000978	桂林旅游	3,700.00	22,348.00	0.01
735	000782	恒申新材	4,900.00	22,344.00	0.01
736	002775	文科股份	5,800.00	22,330.00	0.01
737	000156	华数传媒	3,100.00	22,320.00	0.01

738	002734	利民股份	2,800.00	22,316.00	0.01
739	000929	兰州黄河	3,200.00	22,304.00	0.01
740	605358	立昂微	900.00	22,293.00	0.01
741	300258	精锻科技	2,500.00	22,275.00	0.01
742	300658	延江股份	4,300.00	22,274.00	0.01
743	688349	三一重能	721.00	22,264.48	0.01
744	600704	物产中大	4,400.00	22,264.00	0.01
745	000426	兴业银锡	2,000.00	22,240.00	0.01
746	002273	水晶光电	1,000.00	22,220.00	0.01
746	300172	中电环保	4,400.00	22,220.00	0.01
747	603595	东尼电子	1,300.00	22,217.00	0.01
748	002535	林州重机	5,800.00	22,214.00	0.01
749	300591	万里马	5,400.00	22,194.00	0.01
750	603601	再升科技	6,600.00	22,176.00	0.01
751	688585	上纬新材	3,329.00	22,171.14	0.01
752	600168	武汉控股	5,000.00	22,150.00	0.01
753	002333	罗普斯金	4,300.00	22,145.00	0.01
754	000559	万向钱潮	3,600.00	22,140.00	0.01
754	300272	开能健康	3,600.00	22,140.00	0.01
754	600617	国新能源	8,200.00	22,140.00	0.01
755	002574	明牌珠宝	4,800.00	22,128.00	0.01
756	002907	华森制药	1,700.00	22,100.00	0.01
756	300326	凯利泰	3,400.00	22,100.00	0.01
757	300371	汇中股份	2,300.00	22,057.00	0.01
758	605198	安德利	800.00	22,056.00	0.01
759	300812	易天股份	1,000.00	22,040.00	0.01
760	002920	德赛西威	200.00	22,022.00	0.01
761	603095	越剑智能	1,000.00	22,010.00	0.01
762	688079	美迪凯	2,539.00	21,987.74	0.01
763	000820	神雾节能	6,300.00	21,987.00	0.01
764	002799	环球印务	2,900.00	21,982.00	0.01
765	300334	津膜科技	3,800.00	21,964.00	0.01
766	603281	江瀚新材	900.00	21,960.00	0.01
767	300943	春晖智控	1,700.00	21,913.00	0.01
768	603836	海程邦达	1,800.00	21,888.00	0.01
769	688582	芯动联科	435.00	21,884.85	0.01
770	603998	方盛制药	2,100.00	21,882.00	0.01
771	605189	富春染织	1,800.00	21,870.00	0.01
772	300517	海波重科	2,600.00	21,866.00	0.01
773	300570	太辰光	300.00	21,810.00	0.01
774	688309	恒誉环保	1,750.00	21,787.50	0.01
775	300191	潜能恒信	1,700.00	21,760.00	0.01
776	002284	亚太股份	2,800.00	21,672.00	0.01

777	603319	湘油泵	1,100.00	21,670.00	0.01
778	301165	锐捷网络	300.00	21,660.00	0.01
778	600731	湖南海利	3,800.00	21,660.00	0.01
779	300988	津荣天宇	1,200.00	21,648.00	0.01
780	603811	诚意药业	2,800.00	21,616.00	0.01
781	002098	浔兴股份	2,700.00	21,573.00	0.01
782	600469	风神股份	3,500.00	21,560.00	0.01
783	600433	冠豪高新	6,800.00	21,556.00	0.01
784	300922	天秦装备	1,500.00	21,525.00	0.01
785	002107	沃华医药	4,500.00	21,510.00	0.01
786	002282	博深股份	2,900.00	21,489.00	0.01
787	603758	秦安股份	2,600.00	21,476.00	0.01
788	300909	汇创达	900.00	21,465.00	0.01
789	600523	贵航股份	1,800.00	21,456.00	0.01
790	600749	西藏旅游	2,000.00	21,440.00	0.01
791	688069	德林海	1,425.00	21,403.50	0.01
792	300111	向日葵	6,600.00	21,384.00	0.01
793	300732	设研院	3,200.00	21,376.00	0.01
794	000514	渝开发	5,200.00	21,372.00	0.01
795	000797	中国武夷	7,700.00	21,329.00	0.01
796	688375	国博电子	432.00	21,323.52	0.01
797	600791	京能置业	5,200.00	21,320.00	0.01
798	601956	东贝集团	4,400.00	21,252.00	0.01
799	300807	天迈科技	700.00	21,217.00	0.01
800	600493	凤竹纺织	4,100.00	21,197.00	0.01
801	603022	新通联	2,900.00	21,170.00	0.01
802	601375	中原证券	4,900.00	21,168.00	0.01
803	600117	西宁特钢	9,400.00	21,150.00	0.01
804	000428	华天酒店	6,600.00	21,120.00	0.01
805	300229	拓尔思	1,000.00	20,940.00	0.01
806	600229	城市传媒	3,000.00	20,910.00	0.01
807	600189	泉阳泉	2,900.00	20,909.00	0.01
808	300439	美康生物	2,000.00	20,900.00	0.01
809	300453	三鑫医疗	2,800.00	20,888.00	0.01
810	603991	至正股份	400.00	20,880.00	0.01
811	002483	润邦股份	4,000.00	20,840.00	0.01
812	603937	丽岛新材	2,300.00	20,838.00	0.01
813	300666	江丰电子	300.00	20,835.00	0.01
814	301095	广立微	400.00	20,828.00	0.01
815	002768	国恩股份	900.00	20,763.00	0.01
816	300958	建工修复	1,800.00	20,736.00	0.01
817	688466	金科环境	1,529.00	20,717.95	0.01
818	300414	中光防雷	2,600.00	20,696.00	0.01

819	600446	金证股份	1,200.00	20,688.00	0.01
820	002342	巨力索具	6,400.00	20,672.00	0.01
821	688030	山石网科	1,333.00	20,661.50	0.01
822	688316	青云科技-U	616.00	20,636.00	0.01
823	688321	微芯生物	1,110.00	20,623.80	0.01
824	000590	启迪药业	2,900.00	20,619.00	0.01
825	002809	红墙股份	2,600.00	20,618.00	0.01
826	002035	华帝股份	2,800.00	20,552.00	0.01
827	603236	移远通信	300.00	20,532.00	0.01
828	300126	锐奇股份	4,000.00	20,520.00	0.01
829	000055	方大集团	5,200.00	20,488.00	0.01
830	605162	新中港	3,000.00	20,370.00	0.01
831	603309	维力医疗	1,700.00	20,366.00	0.01
832	605111	新洁能	600.00	20,346.00	0.01
833	603083	剑桥科技	500.00	20,300.00	0.01
834	600257	大湖股份	4,300.00	20,296.00	0.01
835	600468	百利电气	4,300.00	20,210.00	0.01
836	688279	峰昭科技	128.00	20,185.60	0.01
837	600370	三房巷	10,900.00	20,056.00	0.01
838	300672	国科微	300.00	20,025.00	0.01
839	300339	润和软件	400.00	20,012.00	0.01
840	688331	荣昌生物	664.00	19,993.04	0.01
841	600661	昂立教育	1,700.00	19,924.00	0.01
842	600610	中毅达	4,700.00	19,881.00	0.01
843	003020	立方制药	1,100.00	19,844.00	0.01
844	002645	华宏科技	2,900.00	19,778.00	0.01
845	000862	银星能源	4,000.00	19,760.00	0.01
846	605369	拱东医疗	700.00	19,656.00	0.01
847	603506	南都物业	2,300.00	19,573.00	0.01
848	300819	聚杰微纤	1,500.00	19,500.00	0.01
849	000875	吉电股份	3,700.00	19,462.00	0.01
850	300032	金龙机电	4,300.00	19,393.00	0.01
851	600683	京投发展	5,100.00	19,380.00	0.01
852	688403	汇成股份	2,158.00	19,335.68	0.01
853	600601	方正科技	4,400.00	19,316.00	0.01
854	002806	华锋股份	1,700.00	19,176.00	0.01
855	002145	中核钛白	4,500.00	19,080.00	0.01
856	600388	龙净环保	1,500.00	18,975.00	0.01
857	300778	新城市	1,700.00	18,972.00	0.01
858	300045	华力创通	900.00	18,801.00	0.01
859	002694	顾地科技	4,100.00	18,778.00	0.01
860	603628	清源股份	1,500.00	18,720.00	0.01
861	300369	绿盟科技	2,600.00	18,694.00	0.01

862	000628	高新发展	300.00	18,687.00	0.01
863	002151	北斗星通	700.00	18,578.00	0.01
864	002003	伟星股份	1,300.00	18,421.00	0.01
865	688190	云路股份	200.00	18,400.00	0.01
866	001287	中电港	900.00	18,279.00	0.01
867	000686	东北证券	2,300.00	18,262.00	0.01
868	300083	创世纪	2,800.00	18,228.00	0.01
869	002075	沙钢股份	2,900.00	18,154.00	0.01
870	688683	莱尔科技	914.00	18,152.04	0.01
871	000931	中关村	3,800.00	18,088.00	0.01
872	301219	腾远钴业	400.00	18,084.00	0.01
873	688528	秦川物联	2,048.00	17,920.00	0.01
874	301316	慧博云通	700.00	17,899.00	0.01
875	300445	康斯特	1,100.00	17,897.00	0.01
876	300749	顶固集创	2,900.00	17,835.00	0.01
877	688172	燕东微	887.00	17,784.35	0.01
878	300838	浙江力诺	1,400.00	17,724.00	0.01
879	600761	安徽合力	1,000.00	17,650.00	0.01
880	688629	华丰科技	527.00	17,649.23	0.01
881	301291	明阳电气	400.00	17,568.00	0.01
882	002384	东山精密	600.00	17,520.00	0.01
883	601528	瑞丰银行	3,100.00	17,453.00	0.01
884	688232	新点软件	601.00	17,422.99	0.01
885	688631	莱斯信息	200.00	17,418.00	0.01
886	301267	华夏眼科	900.00	17,136.00	0.01
887	688400	凌云光	776.00	17,009.92	0.01
888	000581	威孚高科	900.00	16,992.00	0.01
889	688443	智翔金泰-U	675.00	16,935.75	0.01
890	300432	富临精工	1,100.00	16,918.00	0.01
891	688432	有研硅	1,490.00	16,837.00	0.01
892	688549	中巨芯-U	1,972.00	16,801.44	0.01
893	600200	江苏吴中	1,800.00	16,776.00	0.01
894	600331	宏达股份	2,200.00	16,764.00	0.01
895	688612	威迈斯	711.00	16,736.94	0.01
896	000681	视觉中国	800.00	16,656.00	0.01
897	600323	瀚蓝环境	700.00	16,534.00	0.01
898	002416	爱施德	1,000.00	16,270.00	0.01
899	301325	曼恩斯特	300.00	16,257.00	0.01
900	300018	中元股份	2,400.00	16,248.00	0.01
901	002164	宁波东力	3,200.00	16,032.00	0.01
902	600338	西藏珠峰	1,500.00	16,005.00	0.01
903	301155	海力风电	300.00	15,993.00	0.01
904	300738	奥飞数据	1,100.00	15,950.00	0.01

905	600667	太极实业	2,300.00	15,916.00	0.01
906	600216	浙江医药	1,000.00	15,860.00	0.01
907	002484	江海股份	900.00	15,822.00	0.01
908	002807	江阴银行	3,600.00	15,660.00	0.01
908	301175	中科环保	2,900.00	15,660.00	0.01
908	301510	固高科技	600.00	15,660.00	0.01
909	002936	郑州银行	7,400.00	15,540.00	0.01
910	688261	东微半导	369.00	15,494.31	0.01
911	688235	百济神州-U	96.00	15,457.92	0.01
912	688270	臻镭科技	441.00	15,435.00	0.01
913	300181	佐力药业	1,000.00	15,360.00	0.01
914	301327	华宝新能	200.00	15,342.00	0.01
915	002698	博实股份	900.00	15,300.00	0.01
916	001270	铖昌科技	400.00	15,240.00	0.01
917	688208	道通科技	388.00	15,194.08	0.01
918	600649	城投控股	3,400.00	15,130.00	0.01
919	002428	云南锗业	800.00	15,120.00	0.01
920	600718	东软集团	1,400.00	15,078.00	0.01
921	301511	德福科技	1,200.00	15,072.00	0.01
922	002036	联创电子	1,600.00	15,040.00	0.01
923	002206	海利得	3,500.00	15,015.00	0.01
924	688192	迪哲医药-U	361.00	14,970.67	0.01
925	688550	瑞联新材	476.00	14,894.04	0.01
926	301487	盟固利	700.00	14,889.00	0.01
927	600157	永泰能源	8,700.00	14,877.00	0.01
928	688475	萤石网络	492.00	14,853.48	0.01
929	002747	埃斯顿	800.00	14,800.00	0.01
930	600908	无锡银行	2,500.00	14,775.00	0.01
931	688278	特宝生物	200.00	14,674.00	0.01
932	600846	同济科技	1,700.00	14,654.00	0.01
933	000970	中科三环	1,400.00	14,518.00	0.01
934	002335	科华数据	500.00	14,460.00	0.01
935	600850	电科数字	600.00	14,340.00	0.01
936	300885	海昌新材	1,300.00	14,300.00	0.01
937	002701	奥瑞金	2,500.00	14,175.00	0.01
938	301238	瑞泰新材	900.00	14,094.00	0.01
939	301239	普瑞眼科	300.00	14,070.00	0.01
939	600500	中化国际	3,500.00	14,070.00	0.01
940	600133	东湖高新	1,500.00	14,025.00	0.01
941	300525	博思软件	900.00	14,022.00	0.01
942	301207	华兰疫苗	800.00	14,008.00	0.01
943	688609	九联科技	1,321.00	14,002.60	0.01
944	601096	宏盛华源	3,200.00	13,920.00	0.01

945	002249	大洋电机	2,300.00	13,501.00	0.01
946	688062	迈威生物-U	668.00	13,493.60	0.01
947	002726	龙大美食	1,700.00	13,464.00	0.01
948	300035	中科电气	900.00	13,455.00	0.01
949	601222	林洋能源	1,900.00	13,433.00	0.01
950	600246	万通发展	1,800.00	13,410.00	0.01
951	600285	羚锐制药	600.00	13,296.00	0.00
952	600927	永安期货	1,000.00	13,190.00	0.00
953	300827	上能电气	300.00	13,170.00	0.00
954	688596	正帆科技	369.00	13,117.95	0.00
955	600120	浙江东方	2,800.00	13,048.00	0.00
956	300101	振芯科技	600.00	12,996.00	0.00
956	300133	华策影视	1,800.00	12,996.00	0.00
957	301363	美好医疗	400.00	12,968.00	0.00
958	300303	聚飞光电	1,900.00	12,958.00	0.00
959	603662	柯力传感	200.00	12,920.00	0.00
960	300348	长亮科技	900.00	12,870.00	0.00
961	600308	华泰股份	3,500.00	12,740.00	0.00
961	688167	炬光科技	200.00	12,740.00	0.00
962	600452	涪陵电力	1,200.00	12,708.00	0.00
963	002072	凯瑞德	3,000.00	12,630.00	0.00
964	300180	华峰超纤	2,000.00	12,600.00	0.00
965	000690	宝新能源	2,800.00	12,544.00	0.00
966	600206	有研新材	800.00	12,536.00	0.00
967	001337	四川黄金	600.00	12,528.00	0.00
968	688150	莱特光电	555.00	12,498.60	0.00
969	300775	三角防务	500.00	12,465.00	0.00
970	688147	微导纳米	463.00	12,450.07	0.00
971	300773	拉卡拉	700.00	12,390.00	0.00
972	301216	万凯新材	1,200.00	12,240.00	0.00
973	603867	新化股份	500.00	12,190.00	0.00
974	601137	博威合金	600.00	12,180.00	0.00
975	300638	广和通	600.00	12,090.00	0.00
976	688667	菱电电控	298.00	11,976.62	0.00
977	688166	博瑞医药	396.00	11,959.20	0.00
978	600562	国睿科技	600.00	11,958.00	0.00
979	600170	上海建工	4,500.00	11,925.00	0.00
980	000951	中国重汽	700.00	11,886.00	0.00
980	300036	超图软件	700.00	11,886.00	0.00
981	600877	电科芯片	900.00	11,871.00	0.00
982	600962	国投中鲁	900.00	11,835.00	0.00
983	000620	新华联	5,400.00	11,826.00	0.00
984	002354	天娱数科	2,200.00	11,814.00	0.00

985	000860	顺鑫农业	600.00	11,682.00	0.00
986	000627	天茂集团	2,500.00	11,675.00	0.00
987	603871	嘉友国际	600.00	11,610.00	0.00
988	300123	亚光科技	2,000.00	11,600.00	0.00
989	600839	四川长虹	1,200.00	11,580.00	0.00
990	688380	中微半导	387.00	11,571.30	0.00
991	688248	南网科技	356.00	11,424.04	0.00
992	600149	廊坊发展	2,800.00	11,424.00	0.00
993	002396	星网锐捷	600.00	11,394.00	0.00
994	002679	福建金森	1,400.00	11,368.00	0.00
995	000422	湖北宜化	900.00	11,358.00	0.00
996	001323	慕思股份	300.00	11,343.00	0.00
997	301371	敷尔佳	300.00	11,337.00	0.00
998	300777	中简科技	400.00	11,316.00	0.00
998	600771	广誉远	600.00	11,316.00	0.00
999	300438	鹏辉能源	400.00	11,244.00	0.00
1000	301153	中科江南	400.00	11,176.00	0.00
1001	003017	大洋生物	600.00	11,172.00	0.00
1002	688038	中科通达	915.00	11,117.25	0.00
1003	300783	三只松鼠	300.00	11,061.00	0.00
1004	600029	南方航空	1,700.00	11,033.00	0.00
1005	301526	国际复材	2,900.00	10,730.00	0.00
1006	000829	天音控股	800.00	10,544.00	0.00
1007	601607	上海医药	500.00	10,500.00	0.00
1008	600399	抚顺特钢	1,800.00	10,440.00	0.00
1008	601188	龙江交通	2,900.00	10,440.00	0.00
1009	002221	东华能源	1,100.00	10,439.00	0.00
1010	300663	科蓝软件	600.00	10,416.00	0.00
1011	688209	英集芯	589.00	10,407.63	0.00
1012	603300	海南华铁	1,800.00	10,404.00	0.00
1013	301050	雷电微力	200.00	10,316.00	0.00
1014	300456	赛微电子	600.00	10,308.00	0.00
1015	600552	凯盛科技	900.00	10,269.00	0.00
1016	301348	蓝箭电子	400.00	10,248.00	0.00
1017	600641	万业企业	700.00	10,234.00	0.00
1018	002270	华明装备	600.00	10,134.00	0.00
1019	688372	伟测科技	173.00	10,123.96	0.00
1020	601033	永兴股份	700.00	10,122.00	0.00
1021	603162	海通发展	1,100.00	10,120.00	0.00
1022	600064	南京高科	1,300.00	10,101.00	0.00
1023	601020	华钰矿业	800.00	10,096.00	0.00
1024	600615	丰华股份	900.00	10,017.00	0.00
1025	300319	麦捷科技	800.00	9,984.00	0.00

1026	301217	铜冠铜箔	900.00	9,972.00	0.00
1027	301268	铭利达	600.00	9,948.00	0.00
1028	688523	航天环宇	496.00	9,920.00	0.00
1029	300478	杭州高新	1,100.00	9,911.00	0.00
1030	600827	百联股份	900.00	9,837.00	0.00
1031	600572	康恩贝	2,100.00	9,786.00	0.00
1032	688206	概伦电子	517.00	9,776.47	0.00
1033	002123	梦网科技	900.00	9,729.00	0.00
1034	600986	浙文互联	1,600.00	9,568.00	0.00
1035	000810	创维数字	600.00	9,552.00	0.00
1036	601083	锦江航运	1,000.00	9,520.00	0.00
1037	000543	皖能电力	1,200.00	9,492.00	0.00
1037	600602	云赛智联	600.00	9,492.00	0.00
1038	603306	华懋科技	300.00	9,483.00	0.00
1039	002753	永东股份	1,500.00	9,405.00	0.00
1040	600210	紫江企业	1,400.00	9,254.00	0.00
1041	600821	金开新能	1,700.00	9,180.00	0.00
1042	603678	火炬电子	300.00	9,150.00	0.00
1043	300294	博雅生物	300.00	9,084.00	0.00
1044	300657	弘信电子	400.00	9,064.00	0.00
1045	300379	东方通	600.00	9,054.00	0.00
1046	002183	怡亚通	2,000.00	8,980.00	0.00
1047	002658	雪迪龙	1,400.00	8,960.00	0.00
1048	300026	红日药业	2,300.00	8,717.00	0.00
1049	001236	弘业期货	900.00	8,676.00	0.00
1050	300130	新国都	400.00	8,664.00	0.00
1051	300027	华谊兄弟	3,300.00	8,646.00	0.00
1052	000762	西藏矿业	400.00	8,600.00	0.00
1053	000801	四川九洲	600.00	8,586.00	0.00
1054	002328	新朋股份	1,400.00	8,582.00	0.00
1055	002544	普天科技	400.00	8,572.00	0.00
1056	605090	九丰能源	300.00	8,559.00	0.00
1057	600186	莲花控股	1,500.00	8,550.00	0.00
1058	600456	宝钛股份	300.00	8,535.00	0.00
1059	601126	四方股份	500.00	8,480.00	0.00
1060	000676	智度股份	1,000.00	8,460.00	0.00
1060	300166	东方国信	900.00	8,460.00	0.00
1061	002174	游族网络	900.00	8,415.00	0.00
1062	001308	康冠科技	300.00	8,250.00	0.00
1063	603766	隆鑫通用	900.00	8,190.00	0.00
1064	300409	道氏技术	600.00	8,166.00	0.00
1065	301339	通行宝	400.00	8,136.00	0.00
1066	301246	宏源药业	600.00	8,118.00	0.00

1067	000727	冠捷科技	2,900.00	8,062.00	0.00
1068	688351	微电生理-U	423.00	8,053.92	0.00
1069	601022	宁波远洋	1,000.00	8,030.00	0.00
1070	600635	大众公用	1,800.00	8,010.00	0.00
1071	301536	星宸科技	100.00	7,990.00	0.00
1072	603063	禾望电气	400.00	7,984.00	0.00
1073	001258	立新能源	1,000.00	7,960.00	0.00
1074	688153	唯捷创芯	237.00	7,930.02	0.00
1075	002239	奥特佳	2,600.00	7,930.00	0.00
1076	600422	昆药集团	500.00	7,925.00	0.00
1077	688333	铂力特	200.00	7,886.00	0.00
1078	301558	三态股份	900.00	7,884.00	0.00
1079	002839	张家港行	1,800.00	7,866.00	0.00
1080	002170	芭田股份	900.00	7,857.00	0.00
1081	301498	乖宝宠物	100.00	7,832.00	0.00
1082	600106	重庆路桥	1,400.00	7,826.00	0.00
1083	000680	山推股份	800.00	7,760.00	0.00
1084	300298	三诺生物	300.00	7,743.00	0.00
1085	001311	多利科技	300.00	7,737.00	0.00
1086	601860	紫金银行	2,700.00	7,695.00	0.00
1087	301376	致欧科技	400.00	7,648.00	0.00
1088	600179	安通控股	2,700.00	7,641.00	0.00
1089	301205	联特科技	100.00	7,569.00	0.00
1090	301606	绿联科技	200.00	7,560.00	0.00
1091	002626	金达威	500.00	7,550.00	0.00
1092	000682	东方电子	700.00	7,497.00	0.00
1092	601068	中铝国际	1,700.00	7,497.00	0.00
1093	688239	航宇科技	200.00	7,460.00	0.00
1094	300327	中颖电子	300.00	7,341.00	0.00
1095	300345	华民股份	1,300.00	7,332.00	0.00
1096	002654	万润科技	600.00	7,278.00	0.00
1097	300678	中科信息	200.00	7,274.00	0.00
1098	300121	阳谷华泰	600.00	7,254.00	0.00
1099	002127	南极电商	1,600.00	7,040.00	0.00
1100	600759	洲际油气	3,100.00	7,037.00	0.00
1101	600596	新安股份	800.00	7,024.00	0.00
1102	002292	奥飞娱乐	800.00	6,920.00	0.00
1102	300075	数字政通	400.00	6,920.00	0.00
1103	603283	赛腾股份	100.00	6,916.00	0.00
1104	002681	奋达科技	1,100.00	6,864.00	0.00
1105	603565	中谷物流	700.00	6,860.00	0.00
1106	002597	金禾实业	300.00	6,849.00	0.00
1107	301381	赛维时代	300.00	6,828.00	0.00

1108	600750	江中药业	300.00	6,810.00	0.00
1109	300618	寒锐钴业	200.00	6,754.00	0.00
1110	300113	顺网科技	400.00	6,724.00	0.00
1111	000969	安泰科技	600.00	6,690.00	0.00
1112	600587	新华医疗	400.00	6,660.00	0.00
1113	600621	华鑫股份	400.00	6,592.00	0.00
1114	300265	通光线缆	800.00	6,576.00	0.00
1115	001322	箭牌家居	800.00	6,472.00	0.00
1116	600185	格力地产	900.00	6,471.00	0.00
1117	600114	东睦股份	400.00	6,468.00	0.00
1118	600797	浙大网新	900.00	6,462.00	0.00
1119	000685	中山公用	700.00	6,461.00	0.00
1120	301565	中仑新材	300.00	6,420.00	0.00
1121	300845	捷安高科	500.00	6,405.00	0.00
1122	300776	帝尔激光	100.00	6,358.00	0.00
1123	300624	万兴科技	100.00	6,315.00	0.00
1124	301367	怡和嘉业	100.00	6,300.00	0.00
1125	688048	长光华芯	161.00	6,277.39	0.00
1126	000420	吉林化纤	1,700.00	6,137.00	0.00
1127	002712	思美传媒	1,200.00	6,120.00	0.00
1128	300284	苏交科	600.00	6,090.00	0.00
1129	603057	紫燕食品	300.00	6,027.00	0.00
1130	300087	荃银高科	500.00	5,900.00	0.00
1131	603637	镇海股份	700.00	5,831.00	0.00
1132	002948	青岛银行	1,500.00	5,820.00	0.00
1133	688348	昱能科技	119.00	5,807.20	0.00
1134	688276	百克生物	230.00	5,775.30	0.00
1135	002171	楚江新材	700.00	5,740.00	0.00
1136	001269	欧晶科技	200.00	5,698.00	0.00
1136	300475	香农芯创	200.00	5,698.00	0.00
1137	603219	富佳股份	400.00	5,668.00	0.00
1138	002215	诺普信	500.00	5,615.00	0.00
1138	603132	金徽股份	500.00	5,615.00	0.00
1139	600151	航天机电	700.00	5,586.00	0.00
1140	603999	读者传媒	900.00	5,535.00	0.00
1141	600550	保变电气	700.00	5,495.00	0.00
1142	688281	华秦科技	59.00	5,492.90	0.00
1143	301500	飞南资源	300.00	5,400.00	0.00
1144	300811	铂科新材	100.00	5,391.00	0.00
1145	688295	中复神鹰	264.00	5,261.52	0.00
1146	600678	四川金顶	800.00	5,232.00	0.00
1147	688439	振华风光	102.00	5,231.58	0.00
1148	600993	马应龙	200.00	5,222.00	0.00

1149	000902	新洋丰	400.00	5,216.00	0.00
1150	002020	京新药业	400.00	5,120.00	0.00
1151	600269	赣粤高速	900.00	5,049.00	0.00
1152	001389	广合科技	100.00	5,030.00	0.00
1153	603690	至纯科技	200.00	5,022.00	0.00
1154	301262	海看股份	200.00	4,974.00	0.00
1155	001206	依依股份	300.00	4,959.00	0.00
1156	002351	漫步者	300.00	4,950.00	0.00
1157	688687	凯因科技	228.00	4,920.24	0.00
1158	002675	东诚药业	400.00	4,888.00	0.00
1159	002317	众生药业	400.00	4,860.00	0.00
1160	688381	帝奥微	252.00	4,858.56	0.00
1161	688676	金盘科技	117.00	4,846.14	0.00
1162	300598	诚迈科技	100.00	4,840.00	0.00
1163	600201	生物股份	700.00	4,802.00	0.00
1164	300109	新开源	300.00	4,785.00	0.00
1165	600273	嘉化能源	600.00	4,782.00	0.00
1166	603108	润达医疗	300.00	4,779.00	0.00
1167	600420	国药现代	400.00	4,776.00	0.00
1168	603323	苏农银行	900.00	4,761.00	0.00
1169	603505	金石资源	200.00	4,748.00	0.00
1170	600320	振华重工	1,200.00	4,704.00	0.00
1171	603341	龙旗科技	100.00	4,675.00	0.00
1172	688433	华曙高科	200.00	4,668.00	0.00
1173	688531	日联科技	98.00	4,667.74	0.00
1174	002015	协鑫能科	600.00	4,656.00	0.00
1175	002265	建设工业	200.00	4,654.00	0.00
1176	301180	万祥科技	300.00	4,641.00	0.00
1177	688392	骄成超声	113.00	4,610.40	0.00
1178	301559	中集环科	300.00	4,605.00	0.00
1179	603997	继峰股份	400.00	4,580.00	0.00
1180	301177	迪阿股份	200.00	4,568.00	0.00
1181	688221	前沿生物-U	468.00	4,567.68	0.00
1182	300576	容大感光	100.00	4,518.00	0.00
1183	002182	宝武镁业	400.00	4,512.00	0.00
1184	000062	深圳华强	200.00	4,480.00	0.00
1185	600428	中远海特	600.00	4,380.00	0.00
1186	002315	焦点科技	100.00	4,168.00	0.00
1187	300188	国投智能	300.00	4,137.00	0.00
1188	300358	楚天科技	600.00	4,116.00	0.00
1189	688266	泽璟制药-U	65.00	4,050.15	0.00
1190	002332	仙琚制药	400.00	3,976.00	0.00
1190	601718	际华集团	1,400.00	3,976.00	0.00

1191	600645	中源协和	200.00	3,860.00	0.00
1192	300457	赢合科技	200.00	3,828.00	0.00
1193	300236	上海新阳	100.00	3,737.00	0.00
1194	601519	大智慧	400.00	3,700.00	0.00
1195	002836	新宏泽	500.00	3,680.00	0.00
1196	002649	博彦科技	300.00	3,636.00	0.00
1197	300705	九典制药	200.00	3,590.00	0.00
1198	002541	鸿路钢构	200.00	3,586.00	0.00
1199	600266	城建发展	700.00	3,570.00	0.00
1200	688088	虹软科技	89.00	3,431.84	0.00
1201	600123	兰花科创	400.00	3,424.00	0.00
1202	300244	迪安诊断	300.00	3,405.00	0.00
1203	301508	中机认检	100.00	3,400.00	0.00
1204	601187	厦门银行	600.00	3,384.00	0.00
1205	002797	第一创业	400.00	3,340.00	0.00
1206	601518	吉林高速	1,200.00	3,336.00	0.00
1207	000702	正虹科技	500.00	3,315.00	0.00
1208	603709	中源家居	300.00	3,261.00	0.00
1209	300398	飞凯材料	200.00	3,152.00	0.00
1210	002488	金固股份	300.00	3,132.00	0.00
1211	002842	翔鹭钨业	500.00	3,105.00	0.00
1212	002099	海翔药业	600.00	3,096.00	0.00
1213	002375	亚厦股份	800.00	3,088.00	0.00
1214	002906	华阳集团	100.00	3,075.00	0.00
1215	002468	申通快递	300.00	3,039.00	0.00
1216	603393	新天然气	100.00	3,027.00	0.00
1217	600461	洪城环境	300.00	2,985.00	0.00
1218	001376	百通能源	200.00	2,924.00	0.00
1219	300655	晶瑞电材	300.00	2,808.00	0.00
1220	002004	华邦健康	600.00	2,712.00	0.00
1221	000012	南玻 A	500.00	2,640.00	0.00
1222	002100	天康生物	400.00	2,620.00	0.00
1223	600556	天下秀	500.00	2,600.00	0.00
1224	600057	厦门象屿	400.00	2,596.00	0.00
1225	600916	中国黄金	300.00	2,586.00	0.00
1226	600967	内蒙一机	300.00	2,550.00	0.00
1227	002276	万马股份	300.00	2,538.00	0.00
1228	300065	海兰信	300.00	2,460.00	0.00
1229	300682	朗新集团	200.00	2,440.00	0.00
1230	600717	天津港	500.00	2,435.00	0.00
1231	002492	恒基达鑫	500.00	2,405.00	0.00
1232	600328	中盐化工	300.00	2,361.00	0.00
1233	603183	建研院	600.00	2,310.00	0.00

1234	603220	中贝通信	100.00	2,297.00	0.00
1235	300685	艾德生物	100.00	2,280.00	0.00
1236	688289	圣湘生物	98.00	2,224.60	0.00
1237	605138	盛泰集团	400.00	2,208.00	0.00
1238	002091	江苏国泰	300.00	2,196.00	0.00
1239	000901	航天科技	200.00	2,194.00	0.00
1240	002011	盾安环境	200.00	2,162.00	0.00
1240	600480	凌云股份	200.00	2,162.00	0.00
1241	000089	深圳机场	300.00	2,067.00	0.00
1242	688718	唯赛勃	200.00	2,000.00	0.00
1243	002773	康弘药业	100.00	1,960.00	0.00
1244	603075	热威股份	100.00	1,863.00	0.00
1245	300323	华灿光电	200.00	1,656.00	0.00
1246	002539	云图控股	200.00	1,564.00	0.00
1247	300034	钢研高纳	100.00	1,560.00	0.00
1248	300203	聚光科技	100.00	1,523.00	0.00
1249	600055	万东医疗	100.00	1,510.00	0.00
1250	000758	中色股份	300.00	1,482.00	0.00
1251	000429	粤高速 A	100.00	1,470.00	0.00
1252	601390	中国中铁	200.00	1,278.00	0.00
1253	002958	青农商行	400.00	1,216.00	0.00
1254	603218	日月股份	100.00	1,205.00	0.00
1255	002643	万润股份	100.00	1,200.00	0.00
1256	600575	淮河能源	300.00	1,191.00	0.00
1257	000555	神州信息	100.00	1,120.00	0.00
1258	002079	苏州固锝	100.00	1,027.00	0.00
1259	000795	英洛华	100.00	973.00	0.00
1260	600017	日照港	300.00	960.00	0.00
1261	600248	陕建股份	200.00	896.00	0.00
1262	000683	远兴能源	100.00	559.00	0.00
1263	600409	三友化工	100.00	540.00	0.00
1264	600063	皖维高新	100.00	400.00	0.00
1265	002498	汉缆股份	100.00	339.00	0.00
1266	400174	中天 3	400.00	0.00	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	601318	中国平安	35,207,679.00	12.92
2	688111	金山办公	28,938,091.25	10.62
3	600519	贵州茅台	24,956,843.00	9.16

4	601899	紫金矿业	24,452,608.98	8.98
5	300498	温氏股份	23,813,651.00	8.74
6	600276	恒瑞医药	23,643,766.96	8.68
7	601601	中国太保	23,272,320.00	8.54
8	000568	泸州老窖	22,336,610.00	8.20
9	000333	美的集团	21,737,941.00	7.98
10	603501	韦尔股份	21,042,153.00	7.72
11	600690	海尔智家	20,518,548.00	7.53
12	603993	洛阳钼业	20,507,698.00	7.53
13	300308	中际旭创	20,354,010.60	7.47
14	600900	长江电力	20,327,757.00	7.46
15	300750	宁德时代	20,321,510.00	7.46
16	002027	分众传媒	20,123,526.52	7.39
17	600406	国电南瑞	19,579,394.00	7.19
18	601816	京沪高铁	19,469,376.00	7.15
19	601766	中国中车	19,139,449.00	7.03
20	601919	中远海控	19,004,487.10	6.98
21	600048	保利发展	18,967,854.00	6.96
22	600887	伊利股份	18,440,190.42	6.77
23	002714	牧原股份	18,396,582.20	6.75
24	300124	汇川技术	18,309,624.61	6.72
25	600489	中金黄金	16,986,776.00	6.24
26	000651	格力电器	16,714,112.37	6.14
27	601688	华泰证券	16,535,807.00	6.07
28	600115	中国东航	16,480,779.00	6.05
29	601288	农业银行	16,440,764.00	6.03
30	002241	歌尔股份	16,408,123.00	6.02
31	601006	大秦铁路	16,215,099.94	5.95
32	300059	东方财富	15,898,089.80	5.84
33	000625	长安汽车	15,598,349.00	5.73
34	603259	药明康德	15,328,699.60	5.63
35	600919	江苏银行	14,971,578.00	5.50
36	601127	赛力斯	14,827,841.00	5.44
37	600809	山西汾酒	14,822,092.00	5.44
38	601225	陕西煤业	14,816,680.00	5.44
39	601111	中国国航	14,779,932.00	5.43
40	600028	中国石化	14,521,901.00	5.33
41	601857	中国石油	14,474,871.00	5.31
42	600050	中国联通	14,415,188.00	5.29
43	600547	山东黄金	14,348,649.90	5.27
44	002475	立讯精密	14,133,841.00	5.19
45	601328	交通银行	14,067,583.00	5.16
46	000100	TCL 科技	14,025,889.18	5.15

47	600309	万华化学	13,854,264.00	5.09
48	600989	宝丰能源	13,852,870.00	5.08
49	601398	工商银行	13,842,414.00	5.08
50	300760	迈瑞医疗	13,692,350.00	5.03
51	600795	国电电力	13,560,792.00	4.98
52	003816	中国广核	13,559,085.00	4.98
53	002050	三花智控	13,472,504.51	4.95
54	600905	三峡能源	13,406,300.00	4.92
55	601166	兴业银行	13,332,214.00	4.89
56	000596	古井贡酒	13,330,399.00	4.89
57	600029	南方航空	13,246,205.00	4.86
58	600019	宝钢股份	13,148,247.00	4.83
59	300433	蓝思科技	13,059,942.00	4.79
60	300014	亿纬锂能	13,053,433.90	4.79
61	601633	长城汽车	12,972,845.00	4.76
62	601615	明阳智能	12,942,106.00	4.75
63	300502	新易盛	12,920,178.00	4.74
64	601669	中国电建	12,849,440.00	4.72
65	688008	澜起科技	12,740,930.91	4.68
66	000166	申万宏源	12,684,068.30	4.66
67	000338	潍柴动力	12,658,436.00	4.65
68	600150	中国船舶	12,644,912.00	4.64
69	000001	平安银行	12,589,865.20	4.62
70	601138	工业富联	12,461,536.65	4.57
71	601600	中国铝业	12,422,801.00	4.56
72	600346	恒力石化	12,288,948.00	4.51
73	601916	浙商银行	12,221,620.00	4.49
74	601865	福莱特	12,033,825.00	4.42
75	300394	天孚通信	11,941,255.21	4.38
76	600016	民生银行	11,826,218.00	4.34
77	002352	顺丰控股	11,773,459.39	4.32
78	002459	晶澳科技	11,627,100.96	4.27
79	002415	海康威视	11,547,055.00	4.24
80	688981	中芯国际	11,534,413.28	4.23
81	601169	北京银行	11,468,631.11	4.21
82	688599	天合光能	11,199,824.05	4.11
83	300759	康龙化成	11,168,422.48	4.10
84	000725	京东方 A	11,135,300.00	4.09
85	000858	五粮液	11,086,280.00	4.07
86	300896	爱美客	10,807,112.55	3.97
87	002736	国信证券	10,758,321.00	3.95
88	002938	鹏鼎控股	10,695,543.00	3.93
89	601898	中煤能源	10,598,689.00	3.89

90	300015	爱尔眼科	10,585,115.20	3.89
91	603019	中科曙光	10,506,604.00	3.86
92	600011	华能国际	10,480,748.00	3.85
93	601012	隆基绿能	10,392,495.00	3.81
94	300122	智飞生物	10,359,225.00	3.80
95	300782	卓胜微	10,262,811.00	3.77
96	001979	招商蛇口	10,141,218.00	3.72
97	688036	传音控股	10,041,417.07	3.69
98	002371	北方华创	9,848,094.00	3.61
99	601888	中国中免	9,641,925.00	3.54
100	688280	精进电动 -UW	9,625,594.41	3.53
101	600160	巨化股份	9,610,768.40	3.53
102	601985	中国核电	9,599,964.00	3.52
103	601628	中国人寿	9,534,503.00	3.50
104	000425	徐工机械	9,531,231.00	3.50
105	601989	中国重工	9,491,110.00	3.48
106	000792	盐湖股份	9,439,694.00	3.46
107	002230	科大讯飞	9,364,089.00	3.44
108	600588	用友网络	9,332,475.00	3.43
109	002992	宝明科技	9,320,199.80	3.42
110	601668	中国建筑	9,257,533.20	3.40
111	600023	浙能电力	9,202,642.00	3.38
112	601818	光大银行	9,116,962.00	3.35
113	601211	国泰君安	9,046,714.00	3.32
114	002001	新和成	8,896,345.00	3.27
115	002493	荣盛石化	8,731,236.20	3.20
116	300857	协创数据	8,680,249.00	3.19
117	002920	德赛西威	8,520,772.00	3.13
118	600893	航发动力	8,461,315.00	3.11
119	601881	中国银河	8,366,372.00	3.07
120	603806	福斯特	8,155,001.80	2.99
121	000157	中联重科	8,130,620.00	2.98
122	603369	今世缘	7,929,826.00	2.91
123	601868	中国能建	7,868,614.00	2.89
124	600886	国投电力	7,862,087.00	2.89
125	600183	生益科技	7,846,559.00	2.88
126	688012	中微公司	7,824,348.90	2.87
127	600225	*ST 卓朗	7,796,141.00	2.86
128	300274	阳光电源	7,749,379.00	2.84
129	002602	ST 华通	7,712,469.00	2.83
130	600482	中国动力	7,529,818.14	2.76
131	601336	新华保险	7,422,806.00	2.72

132	000630	铜陵有色	7,311,005.00	2.68
133	300142	沃森生物	7,145,202.00	2.62
134	601689	拓普集团	7,140,407.00	2.62
135	002311	海大集团	7,101,747.65	2.61
136	600188	兖矿能源	7,081,761.12	2.60
137	601728	中国电信	7,057,168.00	2.59
138	603799	华友钴业	6,996,185.20	2.57
139	603659	璞泰来	6,916,677.00	2.54
140	300979	华利集团	6,755,466.25	2.48
141	688579	山大地纬	6,703,686.84	2.46
142	002916	深南电路	6,565,763.00	2.41
143	000301	东方盛虹	6,537,480.00	2.40
144	600436	片仔癀	6,478,657.00	2.38
145	601658	邮储银行	6,437,106.00	2.36
146	600426	华鲁恒升	6,376,573.63	2.34
147	601319	中国人保	6,369,900.00	2.34
148	002648	卫星化学	6,273,500.00	2.30
149	000963	华东医药	6,136,800.00	2.25
150	002142	宁波银行	6,106,125.00	2.24
151	300832	新产业	6,087,569.00	2.23
152	600219	南山铝业	5,889,764.00	2.16
153	600161	天坛生物	5,877,691.00	2.16
154	600027	华电国际	5,744,262.00	2.11
155	601618	中国中冶	5,730,002.00	2.10
156	688041	海光信息	5,711,458.33	2.10
157	603288	海天味业	5,705,027.40	2.09
158	300033	同花顺	5,690,313.00	2.09
159	002594	比亚迪	5,615,922.00	2.06
160	600585	海螺水泥	5,551,586.00	2.04

注：“买入金额”按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	33,484,289.40	12.29
2	601318	中国平安	33,273,649.00	12.21
3	688111	金山办公	29,828,663.35	10.95
4	300750	宁德时代	25,548,600.10	9.38
5	600276	恒瑞医药	24,992,628.60	9.17
6	000568	泸州老窖	24,215,263.00	8.89
7	300498	温氏股份	23,934,129.00	8.79
8	601899	紫金矿业	22,579,668.00	8.29
9	300308	中际旭创	22,452,760.99	8.24

10	601601	中国太保	21,412,683.00	7.86
11	601816	京沪高铁	20,823,167.00	7.64
12	603993	洛阳钼业	20,320,058.00	7.46
13	600406	国电南瑞	20,280,604.00	7.44
14	600690	海尔智家	20,262,724.61	7.44
15	600900	长江电力	19,748,551.00	7.25
16	000651	格力电器	19,353,067.33	7.10
17	600048	保利发展	19,308,595.00	7.09
18	603501	韦尔股份	19,307,559.00	7.09
19	002027	分众传媒	18,980,014.04	6.97
20	601766	中国中车	17,506,830.00	6.43
21	000333	美的集团	17,478,389.00	6.42
22	002714	牧原股份	17,451,466.20	6.41
23	601919	中远海控	17,187,644.70	6.31
24	600489	中金黄金	17,173,612.00	6.30
25	300124	汇川技术	16,843,990.00	6.18
26	002241	歌尔股份	16,830,200.31	6.18
27	600115	中国东航	16,307,068.00	5.99
28	000858	五粮液	16,213,655.00	5.95
29	601288	农业银行	16,112,452.00	5.91
30	600887	伊利股份	16,092,260.00	5.91
31	000625	长安汽车	15,878,282.00	5.83
32	601398	工商银行	15,524,205.00	5.70
33	300059	东方财富	15,246,563.00	5.60
34	600547	山东黄金	15,117,363.50	5.55
35	601006	大秦铁路	14,896,615.00	5.47
36	601328	交通银行	14,530,671.00	5.33
37	600150	中国船舶	14,505,286.00	5.32
38	000338	潍柴动力	14,479,108.00	5.31
39	600029	南方航空	14,445,846.00	5.30
40	601138	工业富联	14,346,734.57	5.27
41	300014	亿纬锂能	14,289,528.20	5.25
42	300433	蓝思科技	14,183,743.00	5.21
43	300502	新易盛	14,126,249.00	5.19
44	600019	宝钢股份	14,064,409.00	5.16
45	002475	立讯精密	14,017,983.00	5.15
46	600989	宝丰能源	13,949,714.28	5.12
47	600346	恒力石化	13,872,153.00	5.09
48	000596	古井贡酒	13,825,649.00	5.07
49	600809	山西汾酒	13,733,853.00	5.04
50	688008	澜起科技	13,597,511.06	4.99
51	600919	江苏银行	13,576,077.00	4.98
52	000100	TCL 科技	13,556,304.30	4.98

53	601633	长城汽车	13,539,210.00	4.97
54	601127	赛力斯	13,490,837.03	4.95
55	603259	药明康德	13,479,681.00	4.95
56	601111	中国国航	13,439,877.00	4.93
57	601688	华泰证券	13,381,628.00	4.91
58	002050	三花智控	13,372,051.40	4.91
59	600905	三峡能源	13,134,618.00	4.82
60	300394	天孚通信	13,029,659.20	4.78
61	600795	国电电力	13,001,167.00	4.77
62	002415	海康威视	12,888,906.00	4.73
63	601857	中国石油	12,808,462.00	4.70
64	600050	中国联通	12,514,182.00	4.59
65	000001	平安银行	12,272,246.00	4.50
66	601615	明阳智能	12,205,793.00	4.48
67	600028	中国石化	12,147,772.00	4.46
68	003816	中国广核	12,064,641.00	4.43
69	601225	陕西煤业	11,798,631.00	4.33
70	600011	华能国际	11,790,974.00	4.33
71	600309	万华化学	11,771,156.00	4.32
72	601669	中国电建	11,645,743.00	4.27
73	601166	兴业银行	11,622,554.00	4.27
74	601888	中国中免	11,593,212.00	4.26
75	601600	中国铝业	11,555,842.00	4.24
76	300015	爱尔眼科	11,465,051.10	4.21
77	601865	福莱特	11,425,788.00	4.19
78	300759	康龙化成	11,305,246.40	4.15
79	601916	浙商银行	11,182,220.00	4.10
80	300896	爱美客	11,106,361.55	4.08
81	300760	迈瑞医疗	11,071,486.00	4.06
82	002938	鹏鼎控股	11,019,406.00	4.04
83	601898	中煤能源	10,945,744.00	4.02
84	300782	卓胜微	10,891,227.12	4.00
85	002352	顺丰控股	10,856,942.00	3.99
86	002736	国信证券	10,674,975.00	3.92
87	688599	天合光能	10,669,773.80	3.92
88	000166	申万宏源	10,633,789.55	3.90
89	001979	招商蛇口	10,620,687.00	3.90
90	002992	宝明科技	10,416,972.00	3.82
91	603019	中科曙光	10,353,604.00	3.80
92	600016	民生银行	10,349,662.00	3.80
93	601211	国泰君安	10,328,926.00	3.79
94	600893	航发动力	10,300,339.00	3.78
95	688036	传音控股	10,259,208.90	3.77

96	300122	智飞生物	10,181,258.00	3.74
97	002371	北方华创	10,118,146.00	3.71
98	300274	阳光电源	9,978,312.39	3.66
99	601012	隆基绿能	9,956,731.00	3.65
100	002493	荣盛石化	9,946,447.00	3.65
101	688280	精进电动 -UW	9,868,651.73	3.62
102	601985	中国核电	9,812,538.00	3.60
103	000425	徐工机械	9,545,202.00	3.50
104	002459	晶澳科技	9,487,270.00	3.48
105	000792	盐湖股份	9,352,954.00	3.43
106	002920	德赛西威	9,290,679.00	3.41
107	600588	用友网络	9,228,358.00	3.39
108	603806	福斯特	9,129,249.40	3.35
109	300857	协创数据	8,875,797.00	3.26
110	601169	北京银行	8,859,899.00	3.25
111	601668	中国建筑	8,822,394.00	3.24
112	601628	中国人寿	8,726,027.00	3.20
113	600886	国投电力	8,399,622.11	3.08
114	601989	中国重工	8,396,604.00	3.08
115	000725	京东方 A	8,219,089.00	3.02
116	000301	东方盛虹	8,195,763.48	3.01
117	688981	中芯国际	8,135,380.49	2.99
118	002230	科大讯飞	8,073,265.00	2.96
119	600183	生益科技	7,979,825.00	2.93
120	603369	今世缘	7,959,581.00	2.92
121	600160	巨化股份	7,913,510.40	2.90
122	601818	光大银行	7,884,113.00	2.89
123	000157	中联重科	7,791,959.00	2.86
124	002142	宁波银行	7,725,358.38	2.84
125	603799	华友钴业	7,607,935.80	2.79
126	600225	*ST 卓朗	7,403,971.00	2.72
127	002602	ST 华通	7,376,118.00	2.71
128	603659	璞泰来	7,325,394.00	2.69
129	601728	中国电信	7,263,857.76	2.67
130	601881	中国银河	7,249,595.00	2.66
131	600436	片仔癀	7,248,078.00	2.66
132	002001	新和成	7,226,706.80	2.65
133	601336	新华保险	7,030,917.00	2.58
134	600023	浙能电力	6,923,824.00	2.54
135	002311	海大集团	6,845,844.05	2.51
136	300979	华利集团	6,775,343.75	2.49
137	600482	中国动力	6,692,103.02	2.46

138	600816	建元信托	6,642,956.00	2.44
139	600188	兖矿能源	6,608,438.90	2.43
140	688579	山大地纬	6,484,130.54	2.38
141	002916	深南电路	6,345,040.00	2.33
142	002648	卫星化学	6,344,853.00	2.33
143	300832	新产业	6,309,951.00	2.32
144	000630	铜陵有色	6,297,984.44	2.31
145	300142	沃森生物	6,244,655.00	2.29
146	000963	华东医药	6,230,200.73	2.29
147	600426	华鲁恒升	6,226,316.00	2.29
148	688256	寒武纪-U	5,961,640.01	2.19
149	600161	天坛生物	5,879,060.80	2.16
150	601689	拓普集团	5,722,498.00	2.10
151	300033	同花顺	5,714,192.00	2.10
152	600027	华电国际	5,706,028.46	2.09
153	600585	海螺水泥	5,703,801.00	2.09
154	603986	兆易创新	5,602,495.00	2.06
155	002271	东方雨虹	5,582,931.69	2.05
156	601868	中国能建	5,577,561.00	2.05
157	601088	中国神华	5,542,991.00	2.03
158	002463	沪电股份	5,501,955.00	2.02
159	300751	迈为股份	5,462,519.20	2.01
160	300476	胜宏科技	5,455,549.00	2.00

注：“卖出金额”按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

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

买入股票的成本（成交）总额	3,062,430,776.86
卖出股票的收入（成交）总额	3,106,355,198.12

注：“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。卖出股票成交总额中扣除了股票投资收益中增值税的影响。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	14,851,613.10	5.55
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	公司债	-	-
10	地方债	-	-
11	定向工具	-	-
12	其他	-	-
13	合计	14,851,613.10	5.55

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	019740	24 国债 09	77,000.00	7,797,281.59	2.92
2	019749	24 国债 15	70,000.00	7,054,331.51	2.64

注：报告期末，本基金仅持有上述 2 支债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 基金投资前十名证券的发行主体未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内

受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	123,060.48
2	应收清算款	38,147.48
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	36,197.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	197,404.96

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
中信证券量 化优选 A	3,828	35,674.18	1,877,884.12	1.38%	134,682,864.64	98.62%
中信证券量 化优选 C	3,379	38,193.89	4,216,041.18	3.27%	124,841,125.82	96.73%
合计	7,207	36,855.55	6,093,925.30	2.29%	259,523,990.46	97.71%

注：持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对

合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

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	中信证券量化优选 A	410,063.79	0.30%
	中信证券量化优选 C	153,377.83	0.12%
	合计	563,441.62	0.21%

注：持有份额占总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

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的情况

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	中信证券量化优选 A	10~50
	中信证券量化优选 C	-
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	中信证券量化优选 A	-
	中信证券量化优选 C	-
	合计	-

9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的
产品情况

基金经理姓名	产品类型	持有本人管理的产品份额总量的数量区间（万份）
魏宇	公募基金	0
	私募资产管理计划	0
	合计	0

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中信证券量化优选 A	中信证券量化优选 C
基金合同生效日（2020 年 5 月 22 日）基金份额总额	10,480,536.08	-
本报告期期初基金份额总额	149,422,734.69	154,982,348.02
本报告期基金总申购份额	18,753,036.01	26,878,024.95
减：本报告期基金总赎回份额	31,615,021.94	52,803,205.97
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	136,560,748.76	129,057,167.00

注：基金合同生效日：2020 年 05 月 22 日

§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

报告期内基金管理人发生人事变动，变动情况详见管理人官网公告(<http://www.citicsam.com>)。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期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

本基金本报告期应支付给毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)的报酬为 24,300 元人民币，该会计师事务所自 2023 年 10 月 30 日至今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未受到稽查或处罚。

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，托管人及其高级管理人员未受到稽查或处罚等情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券	2	6,169,472,977.36	100.00%	2,025,900.53	100.00%	-

注：①本表“佣金”指本基金通过单一券商的交易单元进行股票、权证等交易而合计支付该等券商的佣金合计。

②交易单元的选择标准和程序：

- (1) 经营行为规范，在近一年内无重大违规行为；
- (2) 公司财务状况良好；

(3) 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉；

(4) 有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告。

基金管理人根据以上标准进行考察后确定使用券商的交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
中信证券	41,497,012.00	100.00%	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中信证券资产管理有限公司关于高级管理人员变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2024-01-11
2	中信证券资产管理有限公司中信证券量化优选股票型集合资产管理计划恢复申购（含转换转入、定期定额投资）公告	中国证监会指定报刊及网站	2024-01-15
3	900029_中信证券量化优选股票型集合资产管理计划（中信证券量化优选 A）基金产品资料概要(2024-06-18)	中国证监会指定报刊及网站	2024-06-18
4	900029_中信证券量化优选股票型集合资产管理计划（中信证券量化优选 C）基金产品资料概要(2024-06-18)	中国证监会指定报刊及网站	2024-06-18
5	中信证券资产管理有限公司关于高级管理人员变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2024-08-30
6	中信证券资产管理有限公司关于高级管理人员变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2024-10-28
7	中信证券资产管理有限公司关于高级管理人员变更公告	中国证监会指定报刊及网站	2024-11-25
8	关于资产管理计划代理销售机构账户信息变更的公告-中信证券华南股份有限公司变更基金销售结算专用账户情况说明函	中国证监会指定报刊及网站	2024-11-25
9	900029_中信证券量化优选股票型集合资产管理计划（中信证券量化优选 A）基金产品资料概要(2024-12-16)	中国证监会指定报刊及网站	2024-12-16
10	900029_中信证券量化优选股票型集合资产管理计划（中信证券量化优选 C）基金产品资料概要(2024-12-16)	中国证监会指定报刊及网站	2024-12-16
11	中信证券资产管理有限公司关于旗下部分大集合产品延长存续期限并修改资产管理合同、招募说明书的公告	中国证监会指定报刊及网站	2024-12-16
12	中信证券量化优选股票型集合资产管理计划招募说明书（2024-12-16 更新）	中国证监会指定报刊及网站	2024-12-16
13	中信证券量化优选股票型集合资产管理计划资产管理合同（2024-12-16 更新）	中国证监会指定报刊及网站	2024-12-16

14	中信证券资产管理有限公司中信证券量化优选股票型集合资产管理计划暂停申购（含转换转入、定期定额投资）公告	中国证监会指定报刊及网站	2024-12-26
----	---	--------------	------------

§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

本基金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

2023-11-01 中信证券股份有限公司与中信证券资产管理有限公司发布《关于中信证券股份有限公司管理的资产管理计划变更管理人的公告》，根据《中华人民共和国证券投资基金法》，按照《中信证券量化优选股票型集合资产管理计划资产管理合同》约定，经与托管人协商一致，本基金的管理人自 2023 年 11 月 1 日起由中信证券股份有限公司变更为中信证券资产管理有限公司。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会同意合同变更的文件；
- 2、中信证券量化优选股票型集合资产管理计划资产管理合同；
- 3、中信证券量化优选股票型集合资产管理计划托管协议；
- 4、中信证券量化优选股票型集合资产管理计划招募说明书及其更新；
- 5、管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、报告期内披露的各项公告。

13.2 存放地点

北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦 16 层。

13.3 查阅方式

投资者可到管理人、托管人的住所或管理人网站免费查阅备查文件。在支付工本费后，投资者可在合理时间内取得备查文件的复制件或复印件。

投资者对本报告如有疑问，可咨询本管理人。

咨询电话：95548 转 5

公司网址：<http://www.citicsam.com>

中信证券资产管理有限公司

二〇二五年三月三十一日