
中信证券债券优化一年持有期债券型集合资产 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	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	15
§6 审计报告	15
6.1 审计意见	16
6.2 形成审计意见的基础	16
6.3 其他信息	16
6.4 管理层和治理层对财务报表的责任	16
6.5 注册会计师对财务报表审计的责任	17
§7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	19
7.3 净资产变动表	20
7.4 报表附注	22
§8 投资组合报告	50
8.1 期末基金资产组合情况	50
8.2 期末按行业分类的股票投资组合	50
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	51

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	70
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	71
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	72
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	72
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	72
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	72
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	72
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	72
8.12 投资组合报告附注	72
§9 基金份额持有人信息	73
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	73
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	74
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	74
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	74
§10 开放式基金份额变动	74
§11 重大事件揭示	75
11.1 基金份额持有人大会决议	75
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	75
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	75
11.4 基金投资策略的改变	75
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	75
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	75
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	76
11.8 其他重大事件	76
§12 影响投资者决策的其他重要信息	77
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	77
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	78
§13 备查文件目录	78
13.1 备查文件目录	78
13.2 存放地点	78
13.3 查阅方式	78

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中信证券债券优化一年持有期债券型集合资产管理计划	
基金简称	中信证券债券优化	
基金主代码	900007	
交易代码	900007	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2021 年 5 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	
报告期末基金份额总额	679,004,004.97 份	
基金合同存续期	自 2021 年 5 月 31 日起至 2025 年 5 月 29 日	
下属分级基金的基金简称	中信证券债券优化 A	中信证券债券优化 C
下属分级基金的交易代码	900007	900097
报告期末下属分级基金的份额总额	474,027,787.65 份	204,976,217.32 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	在严格控制风险的基础上持续追求稳健回报。
投资策略	本集合计划在分析和判断国内外宏观经济形势的基础上，通过“自上而下”的定性分析和定量分析相结合，形成对大类资产的预测和判断，在资产管理合同约定的范围内确定债权类资产、权益类资产、现金类资产等的配置比例，主要投资策略有大类资产配置策略、债权类资产投资策略、权益类资产投资策略、资产支持证券投资策略、国债期货投资策略等。
业绩比较基准	中债综合财富(总值)指数收益率*80%+沪深 300 指数收益率*10%+恒生指数收益率*10%
风险收益特征	本集合计划为债券型集合计划，其风险收益水平低于股票型基金和混合型基金，高于货币市场基金。

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 号中信证券大厦 16 层	北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层
邮政编码	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	中国证券报
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	
	中信证券债券优化 A	中信证券债券优化 C	中信证券债券优化 A	中信证券债券优化 C	中信证券债券优化 A	中信证券债券优化 C
本期已实现收益	36,433,094.43	13,498,913.77	-27,193,191.12	-12,459,022.03	-19,251,061.31	-12,118,551.65
本期利润	29,089,164.97	9,793,879.74	4,664,907.41	-573,630.92	-53,736,534.08	-25,957,628.88
加权平均基金份额本期利润	0.0405	0.0336	0.0032	-0.0011	-0.0241	-0.0259
本期加权平均净值利润率	3.76%	3.15%	0.30%	-0.10%	-2.25%	-2.42%
本期基金份额净值增长率	2.21%	1.80%	0.11%	-0.29%	-2.66%	-3.05%
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末		2023 年末		2022 年末	
	中信证券债券优化 A	中信证券债券优化 C	中信证券债券优化 A	中信证券债券优化 C	中信证券债券优化 A	中信证券债券优化 C

期末可供分配利润	39,239,588.91	13,998,355.24	68,687,710.26	18,201,360.60	104,008,290.66	34,998,646.03
期末可供分配基金份额利润	0.0828	0.0683	0.0594	0.0414	0.0582	0.0525
期末基金资产净值	513,267,376.56	218,974,572.56	1,225,655,589.09	461,529,396.92	1,890,494,552.87	702,027,003.14
期末基金份额净值	1.0828	1.0683	1.0594	1.0494	1.0582	1.0525
3.1.3 累计期末指标	2024 年末		2023 年末		2022 年末	
	中信证券债券优化 A	中信证券债券优化 C	中信证券债券优化 A	中信证券债券优化 C	中信证券债券优化 A	中信证券债券优化 C
基金份额累计净值增长率	2.38%	1.01%	0.17%	-0.78%	0.06%	-0.48%

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. 中信证券债券优化 A：

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去三个月	-0.43%	0.27%	1.61%	0.27%	-2.04%	0.00%
过去六个月	-0.09%	0.23%	5.85%	0.26%	-5.94%	-0.03%
过去一年	2.21%	0.20%	9.71%	0.23%	-7.50%	-0.03%
过去三年	-0.40%	0.19%	10.13%	0.25%	-10.53%	-0.06%
自基金合同生效起至今	2.38%	0.18%	9.78%	0.24%	-7.40%	-0.06%

2. 中信证券债券优化 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	-0.53%	0.28%	1.61%	0.27%	-2.14%	0.01%
过去六个月	-0.30%	0.23%	5.85%	0.26%	-6.15%	-0.03%
过去一年	1.80%	0.20%	9.71%	0.23%	-7.91%	-0.03%
过去三年	-1.59%	0.19%	10.13%	0.25%	-11.72%	-0.06%
自基金合同生效起至今	1.01%	0.18%	9.78%	0.24%	-8.77%	-0.06%

效起至今						
------	--	--	--	--	--	--

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

中信证券债券优化一年持有期债券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

(2021 年 5 月 31 日至 2024 年 12 月 31 日)

1、中信证券债券优化 A



2、中信证券债券优化 C

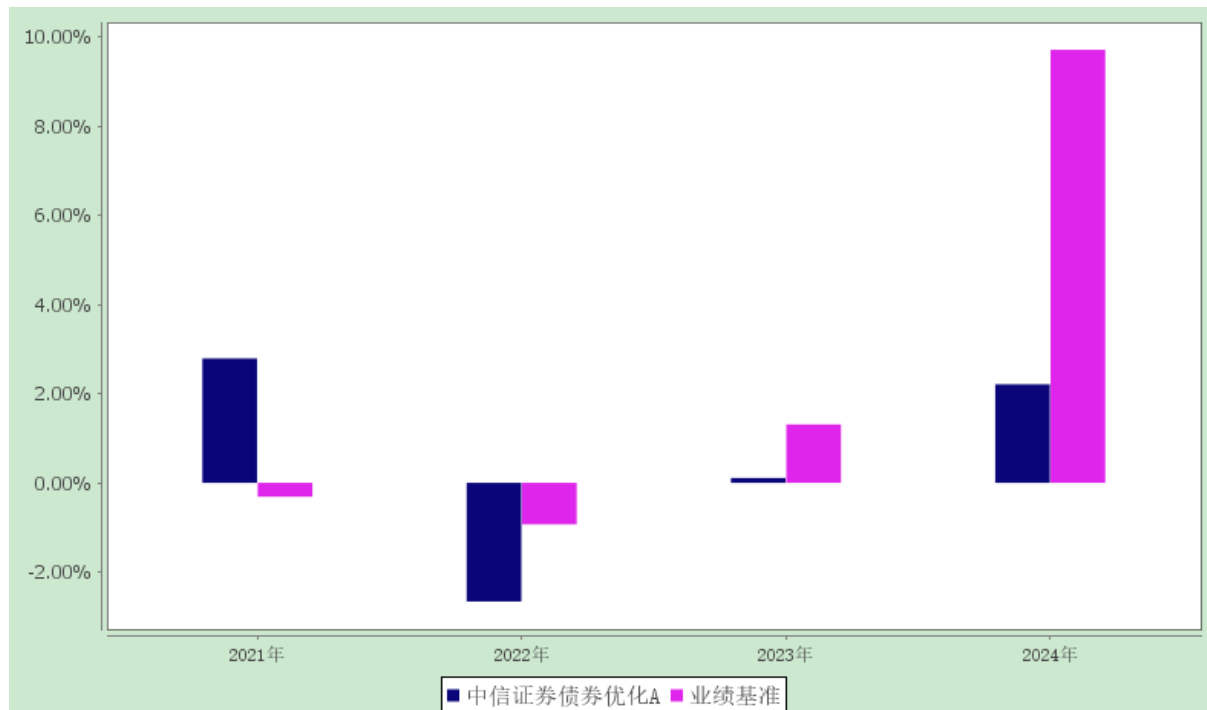


3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

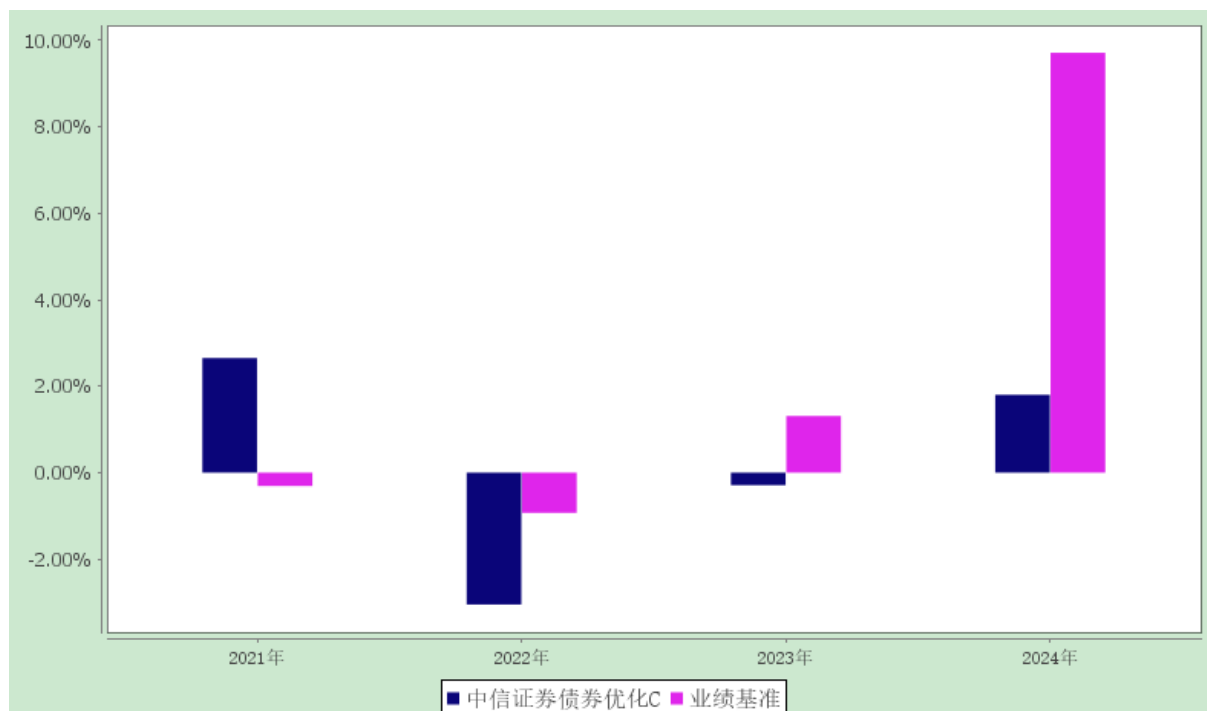
中信证券债券优化一年持有期债券型集合资产管理计划

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、中信证券债券优化 A



2、中信证券债券优化 C



注：本基金基金合同生效日为 2021 年 05 月 31 日,2021 年度的相关数据根据当年实际存续期(2021 年 05 月 31 日至 2021 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《中信证券债券优化一年持有期债券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		
田宇	本基金的基金经理	2021-05-31	-	13	男，北京大学经济学硕士。现任中信证券资产管理有限公司大集合投资部 B 角。2011 年 9 月至 2013 年 6 月任中信证券股份有限公司资金运营部研究员。2013 年 6 月至 2016 年 10 月任中信建投证券股份有限公司固定收益部投资经理。2016 年 11 月至 2020 年 3 月任易方达基金管理有限公司基金经理助理、基金经理。2020 年 3 月加入中信证券资产管理业务。

刘琦	本基金的基金经理	2022-10-11	-	21	男，北方交通大学工商管理硕士。现任中信证券资产管理有限公司权益投资部负责人、权益投资经理。曾在天相投资顾问公司从事行业和上市公司研究。2006 年加入中信证券资产管理业务，长期从事股票研究和投资，具备丰富的投资研究经验。
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。
厉多伊	本基金的基金经理助理	2024-08-16	-	6	男，美国罗切斯特大学西蒙商学院金融学硕士。现任中信证券资产管理有限公司基金经理助理，2018 年加入中信证券股份有限公司资产管理业务，曾任权益策略研究员、宏观利率研究员、行业研究员等岗位。

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。

⑥2025 年 2 月 17 日，本基金管理人发布《中信证券债券优化一年持有期债券型集合资产管理计划基金经理变更公告》，田宇先生不再担任本基金基金经理职务，增聘李天颖女士担任本基金基金经理职务，与现任基金经理刘琦先生共同管理本基金。

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
刘琦	公募基金	3	4,738,424,697.96	2019 年 10 月 22 日
	私募资产管理计划	1	2,491,167,780.69	2014 年 10 月 16 日
	其他组合	-	-	-
	合计	4	7,229,592,478.65	

注：①任职时间为投资经理在行业内首次管理本类产品的时间。

②本报告期内，刘琦于 2024 年 08 月 29 日离任其原管理的 1 只私募资产管理计划。

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

2024 年国内权益市场整体上涨。一季度国内经济出现企稳迹象，监管部门出台平抑股票市场波动相关政策，股票市场总体上行；二季度，随着各项政策陆续出台，市场开始观察前期政策效果，6 月经济数据显示国内需求有走弱迹象，外资开始转向流出带动股票市场下跌；三季度国内权益市场经历调整，9 月下旬一系列政策出台支持实体经济和资本市场，股票市场快速上涨；四季度股票市场整体震荡波动，国庆期间港股上涨带动市场热情到达顶峰，节后第一天 A 股大幅高开，后续交投情绪走弱，市场快速调整；11-12 月美国大选引发外部不确定性，国内稳增长政策持续加码对冲海外扰动，市场在政策支持下整体偏震荡。总体来看，2024 年股票市场整体上涨。行业方面，银行、非银金融、通信、家用电器以及电子等行业表现较好，医药生物和农林牧渔等领域股票表现一般。

2024 年国内债券市场收益率平坦化下行，信用利差大幅压缩。一季度债券收益率大幅下行，1-2 月受益于机构配置行为以及资金面宽松，债券收益率持续下行；3 月经济数据回升、供给压力担忧以及机构止盈操作使得债券市场进入区间波动行情。二季度债券收益率整体下行，4 月在手工补息监管政策影响下，债券基金和理财规模显著增长，叠加债券发行速度偏慢，债券收益率明显下行；5-6 月，国内经济有走弱迹象，资产荒格局延续，收益率曲线陡峭化之后，机构尝试交易中长期品种，中长久期利率债收益率明显下行。三季度债券收益率先下后上，9 月下旬一系列支持实体经济和资本市场的政策出台带动风险偏好迅速上升，债券收益率快速调整，信用利差明显扩张。四季度债券收益率明显下行，9 月底 10 月初利率出现快速调整，但基本面数据显示通胀回升动力仍不足，赎回潮缓解后债券收益率有所回落；12 月，非银同业存款自律落地、货币政策重提“适度宽松”点燃债市做多情绪，收益率快速下行。总体来看，2024 年债券市场收益率明显下行，信用利差压缩，债券资产获得较好回报。

组合股票部分全年总体保持中性仓位，仅于 2 月和三季度末将股票仓位提升至较高水平；债券部分年初久期拉长到偏长水平，随着收益率下行逐步缩短久期，二季度后保持中性久期水平，将部分信用债持仓置换成利率债以提升组合流动性。组合权益仓位和债券久期操作总体有效。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2024 年 12 月 31 日，中信证券债券优化 A 基金份额净值为 1.0828 元，本报告期份额净值增长率为 2.21%；中信证券债券优化 C 基金份额净值为 1.0683 元，本报告期份额净值增长率为 1.80%；同期业绩比较基准增长率为 9.71%。

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，管理人判断国内经济延续弱复苏格局。尽管经济恢复基础还有待夯实，通胀读数仍偏低，但随着支持经济中薄弱环节的相关政策陆续出台以及经济自身调整将支持经济逐步筑底回升。权益市场经过修复后，估值仍具有一定吸引力；债券市场大幅上涨后，性价比有所下降。

下一阶段组合操作上，组合权益部分将保持偏高仓位，根据基本面和估值匹配度选择符合预期收益率的优质个股进行投资；债券部分将保持当前流动性较高的持仓结构，关注止盈时点。

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 2506513 号

中信证券债券优化一年持有期债券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债券优化一年持有期债券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 楼竹君

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：中信证券债券优化一年持有期债券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	27,470,593.10	31,544,671.37
结算备付金		17,487,247.18	27,006,909.72
存出保证金		149,124.34	280,885.49
交易性金融资产	7.4.7.2	745,324,993.93	2,105,915,038.24
其中：股票投资		127,978,692.49	235,149,537.91
基金投资		-	-
债券投资		617,346,301.44	1,750,488,519.26
资产支持证券投资		-	120,276,981.07
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		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	1,911,504.43
应收股利		-	-
应收申购款		1,624.60	347.58
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		790,433,583.15	2,166,659,356.83
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		49,301,834.04	464,602,188.20

应付清算款		0.11	8,285,576.41
应付赎回款		7,662,492.06	3,826,451.84
应付管理人报酬		447,385.93	1,023,951.75
应付托管费		95,868.41	219,418.24
应付销售服务费		233,491.87	317,573.14
应付投资顾问费		-	-
应交税费		40,188.10	489,806.78
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.7	410,373.51	709,404.46
负债合计		58,191,634.03	479,474,370.82
净资产：			
实收基金	7.4.7.8	679,004,004.97	1,596,771,483.16
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.9	53,237,944.15	90,413,502.85
净资产合计		732,241,949.12	1,687,184,986.01
负债和净资产总计		790,433,583.15	2,166,659,356.83

注：报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额总额 679,004,004.97 份，其中 A 类基金份额净值 1.0828 元，基金份额总额 474,027,787.65 份；C 类基金份额净值 1.0683 元，基金份额总额 204,976,217.32 份。

7.2 利润表

会计主体：中信证券债券优化一年持有期债券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		54,539,050.13	39,779,329.87
1.利息收入		656,720.87	1,155,407.95
其中：存款利息收入	7.4.7.10	647,758.51	1,129,891.74
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		8,962.36	25,516.21
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		64,931,292.75	-5,119,567.72
其中：股票投资收益	7.4.7.11	-4,503,558.62	-62,724,853.59
基金投资收益	7.4.7.12	-	-
债券投资收益	7.4.7.13	63,357,735.58	47,566,654.61
资产支持证券投资收益	7.4.7.14	1,674,064.40	4,414,836.34
贵金属投资收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-	-497,865.51

股利收益	7.4.7.17	4,403,051.39	6,121,660.43
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）	7.4.7.18	-11,048,963.49	43,743,489.64
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.19	-	-
减：二、营业总支出		15,656,005.42	35,688,053.38
1. 管理人报酬		7,650,035.81	14,931,954.37
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费		1,639,293.37	3,199,704.49
3. 销售服务费		1,250,259.63	2,314,928.28
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		4,539,956.31	14,562,317.10
其中：卖出回购金融资产支出		4,539,956.31	14,562,317.10
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		219,560.64	187,043.87
8. 其他费用	7.4.7.20	356,899.66	492,105.27
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		38,883,044.71	4,091,276.49
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		38,883,044.71	4,091,276.49
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		38,883,044.71	4,091,276.49

7.3 净资产变动表

会计主体：中信证券债券优化一年持有期债券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	1,596,771,483.16	90,413,502.85	1,687,184,986.01
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
二、本期期初净资产	1,596,771,483.16	90,413,502.85	1,687,184,986.01
三、本期增减变动	-917,767,478.19	-37,175,558.70	-954,943,036.

额（减少以“-”号填列）			89
（一）、综合收益总额	-	38,883,044.71	38,883,044.71
（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）	-917,767,478.19	-76,058,603.41	-993,826,081.60
其中：1.基金申购款	1,203,405.88	96,910.50	1,300,316.38
2.基金赎回款	-918,970,884.07	-76,155,513.91	-995,126,397.98
（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	679,004,004.97	53,237,944.15	732,241,949.12
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	2,453,514,619.32	139,006,936.69	2,592,521,556.01
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
二、本期期初净资产	2,453,514,619.32	139,006,936.69	2,592,521,556.01
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-856,743,136.16	-48,593,433.84	-905,336,570.00
（一）、综合收益总额	-	4,091,276.49	4,091,276.49
（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）	-856,743,136.16	-52,684,710.33	-909,427,846.49
其中：1.基金申购	1,344,251.66	86,266.39	1,430,518.05

款			
2.基金赎回款	-858,087,387.82	-52,770,976.72	-910,858,364.54
(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	1,596,771,483.16	90,413,502.85	1,687,184,986.01

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

中信证券债券优化一年持有期债券型集合资产管理计划(以下简称“本基金”)是由中信证券“债券优化”集合资产管理计划变更而来。中信证券债券优化一年持有期债券型集合资产管理计划的管理人中信证券股份有限公司于 2021 年 4 月 22 日发布《中信证券“债券优化”集合资产管理计划变更征询公告》。根据公告，中信证券“债券优化”集合资产管理计划名称变更为“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“债券优化”集合资产管理计划份额转换为中信证券债券优化一年持有期债券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 2021 年 5 月 31 日起《中信证券债券优化一年持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同》、《中信证券债券优化一年持有期债券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 5 月 29 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《中信证券债券优化一年持有期债券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《中信证券债券优化一年持有期债券型集合资产管

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债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府机构债券、地方政府债券、可交换债券、可转换债券(含分离交易可转债) 等)、资产支持证券、债券回购、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、同业存单、国债期货、股票(含中小板、创业板及其他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)、存托凭证、港股通标的股票、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：本基金投资于债券的比例不低于基金资产的 80%，其中投资于可转换债券(含分离交易可转债) 的比例不超过基金资产的 20%，投资于股票及存托凭证等权益类资产的投资比例不超过基金资产的 20%，投资于港股通标的股票比例占股票及存托凭证资产合计的 0-50%。每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值 5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中债综合财富(总值) 指数收益率×80%+沪深 300 指数收益率×10%+恒生指数收益率×10%。

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（包括于估值日采用合同约定的估值汇率将外币折算为人民币所产生的折算差额）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	27,470,593.10	31,544,671.37
等于: 本金	27,464,836.86	31,536,616.15
加: 应计利息	5,756.24	8,055.22
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	27,470,593.10	31,544,671.37

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		134,395,940.02	-	127,978,692.49	-6,417,247.53
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	604,235,184.18	6,637,601.16	617,346,301.44	6,473,516.10
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	604,235,184.18	6,637,601.16	617,346,301.44	6,473,516.10
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		738,631,124.20	6,637,601.16	745,324,993.93	56,268.57
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		238,422,221.41	-	235,149,537.91	-3,272,683.50
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	574,818,230.00	8,662,862.72	582,304,562.72	-1,176,530.00
	银行间市场	1,133,341,467.96	19,341,606.54	1,168,183,956.54	15,500,882.04
	合计	1,708,159,697.96	28,004,469.26	1,750,488,519.26	14,324,352.04
资产支持证券		119,065,250.00	785,581.07	120,276,981.07	426,150.00
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		2,065,647,169.37	28,790,050.33	2,105,915,038.24	11,477,818.54

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 其他资产

无。

7.4.7.7 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	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	257,973.51	557,004.46
其中：交易所市场	257,973.51	516,282.26
银行间市场	-	40,722.20
应付利息	-	-
预提信息披露费	120,000.00	120,000.00
预提审计费	32,400.00	32,400.00
合计	410,373.51	709,404.46

7.4.7.8 实收基金

中信证券债券优化 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	1,156,967,878.83	1,156,967,878.83
本期申购	765,015.02	765,015.02
本期赎回（以“-”号填列）	-683,705,106.20	-683,705,106.20
本期末	474,027,787.65	474,027,787.65

中信证券债券优化 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	439,803,604.33	439,803,604.33
本期申购	438,390.86	438,390.86

本期赎回（以“-”号填列）	-235,265,777.87	-235,265,777.87
本期末	204,976,217.32	204,976,217.32

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.9 未分配利润

中信证券债券优化 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	117,823,613.12	-49,135,902.86	68,687,710.26
本期期初	117,823,613.12	-49,135,902.86	68,687,710.26
本期利润	36,433,094.43	-7,343,929.46	29,089,164.97
本期基金份额交易产生的变动数	-85,062,702.09	26,525,415.77	-58,537,286.32
其中：基金申购款	93,672.65	-29,955.81	63,716.84
基金赎回款	-85,156,374.74	26,555,371.58	-58,601,003.16
本期已分配利润	-	-	-
本期末	69,194,005.46	-29,954,416.55	39,239,588.91

中信证券债券优化 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	18,201,360.60	3,524,431.99	21,725,792.59
本期期初	18,201,360.60	3,524,431.99	21,725,792.59
本期利润	13,498,913.77	-3,705,034.03	9,793,879.74
本期基金份额交易产生的变动数	-15,148,782.89	-2,372,534.20	-17,521,317.09
其中：基金申购款	31,765.40	1,428.26	33,193.66
基金赎回款	-15,180,548.29	-2,373,962.46	-17,554,510.75
本期已分配利润	-	-	-
本期末	16,551,491.48	-2,553,136.24	13,998,355.24

7.4.7.10 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 31 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	264,932.37	444,713.98
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	380,073.72	678,531.54
其他	2,752.42	6,646.22
合计	647,758.51	1,129,891.74

7.4.7.11 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	879,174,811.32	1,707,806,868.61
减：卖出股票成本总额	882,124,711.75	1,766,131,864.56
减：交易费用	1,553,658.19	4,399,857.64
买卖股票差价收入	-4,503,558.62	-62,724,853.59

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。

7.4.7.12 基金投资收益

无。

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 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	33,231,788.21	68,925,374.31
债券投资收益——买卖债券 (债转股及债券到期兑付)差 价收入	30,125,947.37	-21,358,719.70
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	63,357,735.58	47,566,654.61

7.4.7.13.2 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	3,222,933,844.75	6,822,861,045.74
减：卖出债券(债转股及债 券到期兑付)成本总额	3,138,328,593.94	6,752,356,104.77
减：应计利息总额	54,241,221.60	91,543,959.41
减：交易费用	238,081.84	319,701.26
买卖债券差价收入	30,125,947.37	-21,358,719.70

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。

7.4.7.14 资产支持证券投资收益

7.4.7.14.1 资产支持证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
资产支持证券投资收益——利息收入	1,776,001.61	4,407,961.70
资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入	-101,937.21	6,874.64
资产支持证券投资收益——赎回差价收入	-	-
资产支持证券投资收益——申购差价收入	-	-
合计	1,674,064.40	4,414,836.34

7.4.7.14.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

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
卖出资产支持证券成交总额	120,965,595.46	204,426,319.87
减：卖出资产支持证券成本总额	119,065,250.00	200,487,600.00
减：应计利息总额	1,999,923.84	3,926,059.87
减：交易费用	2,358.83	5,785.36
资产支持证券投资收益	-101,937.21	6,874.64

注：卖出资产支持证券成交总额中扣除了资产支持证券投资收益中增值税的影响。

7.4.7.15 贵金属投资收益

无。

7.4.7.16 衍生工具收益

7.4.7.16.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.16.2 衍生工具收益——其他投资收益

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
----	--	---

国债期货投资 (损失) / 收益	-	-497,865.51
------------------	---	-------------

7.4.7.17 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	4,403,051.39	6,121,660.43
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	4,403,051.39	6,121,660.43

7.4.7.18 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	-11,421,549.97	44,117,911.68
——股票投资	-3,144,564.03	-3,946,214.91
——债券投资	-7,850,835.94	47,253,776.59
——资产支持证券投资	-426,150.00	810,350.00
——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	-372,586.48	374,422.04
合计	-11,048,963.49	43,743,489.64

7.4.7.19 其他收入

无。

7.4.7.20 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	32,400.00	32,400.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行手续费	13,314.53	31,917.20
账户维护费	31,500.00	36,000.00

证券组合费	923.17	2,827.15
其他	158,761.96	268,960.92
合计	356,899.66	492,105.27

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
中信证券华南股份有限公司	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(山东)有限责任公司	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	1,657,354,024.30	100.00%	3,335,489,262.86	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	上年度可比期间
-------	----	---------

	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		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	2,090,222,566.39	100.00%	2,465,677,949.62	100.00%

7.4.10.1.4 债券回购交易

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	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例
中信证券股份有限公司	29,271,070,000.00	100.00%	86,087,503,000.00	100.00%

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	1,462,747.68	100.00%	257,973.51	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	3,537,329.87	100.00%	516,282.26	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	7,650,035.81	14,931,954.37
其中：应支付销售机构的客户维护费	3,263,440.89	6,066,582.57
应支付基金管理人的净管理费	4,386,594.92	8,865,371.80

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《中信证券债券优化一年持有期债券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 7,650,035.81 元，本基金管理费按前一日基金资产净值 0.70%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×0.70%/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	1,639,293.37	3,199,704.49

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		
	中信证券债券优化 A	中信证券债券优化 C	合计
中信证券股份有限公司	-	63,062.09	63,062.09
中信银行股份有限公司	-	1,112,082.95	1,112,082.95
中信证券(山东)有限责任公司	-	557.73	557.73
中信证券华南股份有限公司	-	9,470.12	9,470.12
中信期货有限公司	-	3,189.57	3,189.57
合计	-	1,188,362.46	1,188,362.46
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		
	中信证券债券优化 A	中信证券债券优化 C	合计
中信银行股份有限公司	-	2,028,716.03	2,028,716.03

公司			
中信证券股份有限公司	-	127,266.85	127,266.85
中信证券(山东)有限责任公司	-	4,249.08	4,249.08
中信证券华南股份有限公司	-	12,382.91	12,382.91
中信期货有限公司	-	6,040.01	6,040.01
合计	-	2,178,654.88	2,178,654.88

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 0.40% 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 × 0.40% / 当年天数

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 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

份额单位：份

项目	本期		上年度可比期间	
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日		2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	中信证券债券优化 A	中信证券债券优化 C	中信证券债券优化 A	中信证券债券优化 C
期初持有的基金份额	-	-	46,321,104.32	-
期间申购/买入总份额	-	-	-	-
期间因拆分变动份额	-	-	-	-
减：期间赎回/卖出总份额	-	-	46,321,104.32	-
期末持有的基金份额	-	-	-	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-	-	-

注：①基金管理人持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

②2023 年 11 月 1 日，本基金管理人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，原中信证券股份有限公司固有资金现视为管理人股东固有资金，中信证券资产管理有限公司未运用固有资金投资本基金。

③期间卖出/赎回份额数据是因基金管理人发生变更而产生的，实际中信证券股份有限公司未赎回固有资金投资份额。

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

中信证券债券优化 A

份额单位：份

关联方名称	中信证券债券优化 A 本期末 2024 年 12 月 31 日		中信证券债券优化 A 上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
中信证券股份有限公司	46,321,104.32	6.82%	46,321,104.32	2.90%

注：其他关联方持有本基金基金份额的交易费用按市场公开的交易费率计算并支付。

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	27,470,593.10	264,932.37	31,544,671.37	444,713.98

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

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

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

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2024 年 12 月 31 日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额 49,301,834.04 元，于 2025 年 01 月 06 日到期。该类交易要求本基金在回购期内持有的证券交易所交易的债券和/或在新质押式回购下转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

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行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息，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	89,195,706.30	40,471,727.87
合计	89,195,706.30	40,471,727.87

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

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
AAA	369,869,208.31	767,083,998.24
AAA 以下	55,925,213.66	505,103,146.91
未评级	102,356,173.17	437,829,646.24
合计	528,150,595.14	1,710,016,791.39

注：①债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

②未评级债券包括期限大于一年的国债、政策性金融债、央行票据及未有第三方机构评级的其他债券等。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
AAA	-	120,276,981.07
AAA 以下	-	-
未评级	-	-
合计	-	120,276,981.07

注：①本报告期末无余额。

②资产支持证券评级取自第三方评级机构的债项评级。

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	27,470,593.10	-	-	-	27,470,593.10
交易性金融资产	505,617,827.17	29,925,547.67	81,802,926.60	127,978,692.49	745,324,993.93
存出保证金	149,124.34	-	-	-	149,124.34
结算备付金	17,487,247.18	-	-	-	17,487,247.18
应收申购款	-	-	-	1,624.60	1,624.60
资产总计	550,724,791.79	29,925,547.67	81,802,926.60	127,980,317.09	790,433,583.15
负债					
卖出回购金融资产款	49,301,834.04	-	-	-	49,301,834.04
应付清算款	-	-	-	0.11	0.11
应付赎回款	-	-	-	7,662,492.06	7,662,492.06
应付管理人报酬	-	-	-	447,385.93	447,385.93
应付托管费	-	-	-	95,868.41	95,868.41
应付销售服务费	-	-	-	233,491.87	233,491.87
应交税费	-	-	-	40,188.10	40,188.10
其他负债	-	-	-	410,373.51	410,373.51
负债总计	49,301,834.04	-	-	8,889,799.99	58,191,634.03
利率敏感度缺口	501,422,957.75	29,925,547.67	81,802,926.60	119,090,517.10	732,241,949.12
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	31,544,671.37	-	-	-	31,544,671.37
交易性金融资产	751,209,814.08	969,360,569.86	150,195,116.39	235,149,537.91	2,105,915,038.24
存出保证金	280,885.49	-	-	-	280,885.49
结算备付金	27,006,909.72	-	-	-	27,006,909.72
应收清算款	-	-	-	1,911,504.43	1,911,504.43
应收申购款	-	-	-	347.58	347.58
资产总计	810,042,280.66	969,360,569.86	150,195,116.39	237,061,389.92	2,166,659,356.83
负债					

卖出回购金融资产款	464,602,188.20	-	-	-	464,602,188.20
应付清算款	-	-	-	8,285,576.41	8,285,576.41
应付赎回款	-	-	-	3,826,451.84	3,826,451.84
应付管理人报酬	-	-	-	1,023,951.75	1,023,951.75
应付托管费	-	-	-	219,418.24	219,418.24
应付销售服务费	-	-	-	317,573.14	317,573.14
应交税费	-	-	-	489,806.78	489,806.78
其他负债	-	-	-	709,404.46	709,404.46
负债总计	464,602,188.20	-	-	14,872,182.62	479,474,370.82
利率敏感度缺口	345,440,092.46	969,360,569.86	150,195,116.39	222,189,207.30	1,687,184,986.01

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	-4,194,970.07	-14,991,171.36
	市场利率下降 25 个基点	4,386,598.26	15,553,919.48

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。本基金持有以非记账本位币人民币计价的资产和负债，因此存在相应的外汇风险。

7.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日		
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	合计
以外币计价的资产			
交易性金融资产	-	1,428.86	1,428.86
资产合计	-	1,428.86	1,428.86
以外币计价的负债			
应付清算款	-	0.04	0.04
负债合计	-	0.04	0.04
资产负债表外	-	1,428.82	1,428.82

汇风险敞口净额			
项目	上年度末 2023 年 12 月 31 日		
	美元 折合人民币	港币 折合人民币	合计
以外币计价的资产			
交易性金融资产	-	5,454,844.05	5,454,844.05
资产合计	-	5,454,844.05	5,454,844.05
以外币计价的负债			
应付清算款	-	2,293,193.70	2,293,193.70
负债合计	-	2,293,193.70	2,293,193.70
资产负债表外汇风险敞口净额	-	3,161,650.35	3,161,650.35

7.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

假设	除汇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
	港币相对人民币升值 5%	71.44	158,082.52
	港币相对人民币贬值 5%	-71.44	-158,082.52

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	127,978,692.49	17.48	235,149,537.91	13.94
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	127,978,692.49	17.48	235,149,537.91	13.94

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%	-23,101,738.22	-55,119,551.72
	业绩比较基准上升 5%	23,101,738.22	55,119,551.72

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	179,314,030.06	235,149,537.91
第二层次	566,010,963.87	1,870,765,500.33
第三层次	-	-
合计	745,324,993.93	2,105,915,038.24

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

无。

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	127,978,692.49	16.19
	其中：股票	127,978,692.49	16.19
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	617,346,301.44	78.10
	其中：债券	617,346,301.44	78.10
	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	44,957,840.28	5.69
8	其他各项资产	150,748.94	0.02
9	合计	790,433,583.15	100.00

注：通过港股通交易机制投资的港股公允价值为人民币 1,428.86 元，占期末净值比例为 0.00%。

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	1,069,302.00	0.15

B	采矿业	5,704,387.88	0.78
C	制造业	70,653,475.87	9.65
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,708,501.00	0.64
E	建筑业	2,337,265.00	0.32
F	批发和零售业	1,107,821.00	0.15
G	交通运输、仓储和邮政业	3,852,907.00	0.53
H	住宿和餐饮业	106,036.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,028,588.03	0.96
J	金融业	26,629,608.00	3.64
K	房地产业	1,276,950.00	0.17
L	租赁和商务服务业	953,893.00	0.13
M	科学研究和技术服务业	1,123,703.85	0.15
N	水利、环境和公共设施管理业	186,900.00	0.03
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	67,320.00	0.01
Q	卫生和社会工作	481,101.00	0.07
R	文化、体育和娱乐业	521,505.00	0.07
S	综合	167,999.00	0.02
	合计	127,977,263.63	17.48

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

行业类别	公允价值（人民币）	占基金资产净值比例（%）
非日常生活消费品	1,428.86	0.00
合计	1,428.86	0.00

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

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	2,900.00	4,419,600.00	0.60
2	300750	宁德时代	12,200.00	3,245,200.00	0.44
3	601318	中国平安	53,600.00	2,822,040.00	0.39
4	600036	招商银行	57,400.00	2,255,820.00	0.31
5	300059	东方财富	64,500.00	1,665,390.00	0.23
6	600900	长江电力	55,600.00	1,642,980.00	0.22
7	000333	美的集团	21,100.00	1,587,142.00	0.22
8	601166	兴业银行	67,400.00	1,291,384.00	0.18
9	000858	五粮液	9,200.00	1,288,368.00	0.18
10	601398	工商银行	174,700.00	1,208,924.00	0.17
11	002594	比亚迪	4,200.00	1,187,172.00	0.16
12	601899	紫金矿业	77,599.00	1,173,296.88	0.16
13	002475	立讯精密	23,900.00	974,164.00	0.13

14	600276	恒瑞医药	20,900.00	959,310.00	0.13
15	000651	格力电器	20,700.00	940,815.00	0.13
16	600887	伊利股份	29,700.00	896,346.00	0.12
17	688981	中芯国际	9,357.00	885,359.34	0.12
18	601328	交通银行	107,600.00	836,052.00	0.11
19	601816	京沪高铁	135,700.00	835,912.00	0.11
20	601288	农业银行	145,700.00	778,038.00	0.11
21	000725	京东方 A	171,300.00	752,007.00	0.10
22	300760	迈瑞医疗	2,900.00	739,500.00	0.10
23	600919	江苏银行	67,800.00	665,796.00	0.09
24	601088	中国神华	15,000.00	652,200.00	0.09
25	688041	海光信息	4,330.00	648,590.70	0.09
26	688256	寒武纪-U	984.00	647,472.00	0.09
27	603259	药明康德	11,600.00	638,464.00	0.09
28	600309	万华化学	8,900.00	635,015.00	0.09
29	601601	中国太保	17,900.00	610,032.00	0.08
30	601668	中国建筑	99,900.00	599,400.00	0.08
31	300124	汇川技术	10,200.00	597,516.00	0.08
32	000063	中兴通讯	14,600.00	589,840.00	0.08
33	002371	北方华创	1,500.00	586,500.00	0.08
34	600000	浦发银行	54,600.00	561,834.00	0.08
35	600837	海通证券	50,300.00	559,336.00	0.08
36	601988	中国银行	96,800.00	533,368.00	0.07
37	002415	海康威视	17,300.00	531,110.00	0.07
38	300308	中际旭创	4,300.00	531,093.00	0.07
39	000001	平安银行	45,100.00	527,670.00	0.07
40	002714	牧原股份	13,200.00	507,408.00	0.07
41	601728	中国电信	69,900.00	504,678.00	0.07
42	300274	阳光电源	6,800.00	502,044.00	0.07
43	600690	海尔智家	17,300.00	492,531.00	0.07
44	603019	中科曙光	6,800.00	491,776.00	0.07
45	600941	中国移动	4,100.00	484,456.00	0.07
46	601766	中国中车	56,800.00	475,984.00	0.07
47	600406	国电南瑞	18,824.00	474,741.28	0.06
48	600016	民生银行	114,800.00	474,124.00	0.06
49	601688	华泰证券	26,700.00	469,653.00	0.06
50	601127	赛力斯	3,500.00	466,865.00	0.06
51	600660	福耀玻璃	7,400.00	461,760.00	0.06
52	002352	顺丰控股	11,400.00	459,420.00	0.06
53	601857	中国石油	51,300.00	458,622.00	0.06
54	600104	上汽集团	22,000.00	456,720.00	0.06
55	600031	三一重工	27,700.00	456,496.00	0.06
56	600028	中国石化	66,600.00	444,888.00	0.06

57	601919	中远海控	28,700.00	444,850.00	0.06
58	601012	隆基绿能	28,300.00	444,593.00	0.06
59	601985	中国核电	42,500.00	443,275.00	0.06
60	000100	TCL 科技	87,200.00	438,616.00	0.06
61	601211	国泰君安	23,500.00	438,275.00	0.06
62	000568	泸州老窖	3,500.00	438,200.00	0.06
63	300502	新易盛	3,700.00	427,646.00	0.06
64	300498	温氏股份	25,800.00	425,958.00	0.06
65	600809	山西汾酒	2,300.00	423,683.00	0.06
66	601169	北京银行	68,200.00	419,430.00	0.06
67	002230	科大讯飞	8,600.00	415,552.00	0.06
68	601229	上海银行	45,300.00	414,495.00	0.06
69	601225	陕西煤业	17,700.00	411,702.00	0.06
70	603501	韦尔股份	3,900.00	407,199.00	0.06
71	600050	中国联通	72,300.00	383,913.00	0.05
72	688012	中微公司	2,027.00	383,427.32	0.05
73	002142	宁波银行	15,500.00	376,805.00	0.05
74	601138	工业富联	17,400.00	374,100.00	0.05
75	600999	招商证券	19,400.00	371,704.00	0.05
76	601628	中国人寿	8,700.00	364,704.00	0.05
77	603288	海天味业	7,800.00	358,020.00	0.05
78	688008	澜起科技	5,162.00	350,499.80	0.05
79	000338	潍柴动力	25,500.00	349,350.00	0.05
80	600150	中国船舶	9,600.00	345,216.00	0.05
81	601818	光大银行	86,200.00	333,594.00	0.05
82	688111	金山办公	1,156.00	331,066.84	0.05
83	002625	光启技术	6,900.00	329,820.00	0.05
84	002027	分众传媒	46,700.00	328,301.00	0.04
85	600418	江淮汽车	8,400.00	315,000.00	0.04
86	000425	徐工机械	39,700.00	314,821.00	0.04
87	000625	长安汽车	23,500.00	313,960.00	0.04
88	600019	宝钢股份	44,300.00	310,100.00	0.04
89	603986	兆易创新	2,900.00	309,720.00	0.04
90	601390	中国中铁	47,900.00	306,081.00	0.04
91	600048	保利发展	34,300.00	303,898.00	0.04
92	600089	特变电工	23,800.00	303,212.00	0.04
93	601888	中国中免	4,500.00	301,545.00	0.04
94	600436	片仔癀	1,400.00	300,300.00	0.04
95	002241	歌尔股份	11,400.00	294,234.00	0.04
96	000792	盐湖股份	17,600.00	289,696.00	0.04
97	601658	邮储银行	51,000.00	289,680.00	0.04
98	600958	东方证券	27,400.00	289,344.00	0.04
99	600905	三峡能源	66,100.00	288,857.00	0.04

100	300015	爱尔眼科	21,800.00	288,850.00	0.04
101	300033	同花顺	1,000.00	287,500.00	0.04
102	000938	紫光股份	10,300.00	286,649.00	0.04
103	600438	通威股份	12,900.00	285,219.00	0.04
104	601006	大秦铁路	41,800.00	283,404.00	0.04
105	601939	建设银行	32,100.00	282,159.00	0.04
106	600938	中国海油	9,500.00	280,345.00	0.04
107	600585	海螺水泥	11,700.00	278,226.00	0.04
108	601600	中国铝业	37,700.00	277,095.00	0.04
109	600584	长电科技	6,600.00	269,676.00	0.04
110	300014	亿纬锂能	5,700.00	266,418.00	0.04
111	601009	南京银行	24,900.00	265,185.00	0.04
112	601989	中国重工	53,500.00	257,335.00	0.04
113	600893	航发动力	6,200.00	256,990.00	0.04
114	600760	中航沈飞	5,000.00	253,600.00	0.03
115	600111	北方稀土	11,900.00	252,518.00	0.03
116	000166	申万宏源	47,000.00	251,450.00	0.03
117	000776	广发证券	15,400.00	249,634.00	0.03
118	000977	浪潮信息	4,800.00	249,024.00	0.03
119	605499	东鹏饮料	1,000.00	248,520.00	0.03
120	002463	沪电股份	6,200.00	245,830.00	0.03
121	000538	云南白药	4,100.00	245,795.00	0.03
122	600926	杭州银行	16,700.00	243,987.00	0.03
123	300408	三环集团	6,300.00	242,613.00	0.03
124	688271	联影医疗	1,899.00	240,033.60	0.03
125	002179	中航光电	6,000.00	235,800.00	0.03
126	600015	华夏银行	29,300.00	234,693.00	0.03
127	002304	洋河股份	2,800.00	233,884.00	0.03
128	000002	万科 A	32,000.00	232,320.00	0.03
129	002050	三花智控	9,800.00	230,398.00	0.03
130	601377	兴业证券	36,000.00	225,360.00	0.03
131	600886	国投电力	13,400.00	222,708.00	0.03
132	603993	洛阳钼业	33,400.00	222,110.00	0.03
133	601669	中国电建	40,100.00	218,946.00	0.03
134	600010	包钢股份	116,200.00	216,132.00	0.03
135	601901	方正证券	25,800.00	214,914.00	0.03
136	601336	新华保险	4,300.00	213,710.00	0.03
137	002028	思源电气	2,900.00	210,830.00	0.03
138	601995	中金公司	6,100.00	205,509.00	0.03
139	601916	浙商银行	69,900.00	203,409.00	0.03
140	002273	水晶光电	9,100.00	202,202.00	0.03
141	688036	传音控股	2,122.00	201,590.00	0.03
142	300433	蓝思科技	9,200.00	201,480.00	0.03

143	002049	紫光国微	3,100.00	199,547.00	0.03
144	000988	华工科技	4,600.00	199,180.00	0.03
145	600570	恒生电子	7,100.00	198,729.00	0.03
146	600009	上海机场	5,800.00	198,070.00	0.03
147	601186	中国铁建	21,400.00	196,238.00	0.03
148	002311	海大集团	4,000.00	196,200.00	0.03
149	600547	山东黄金	8,600.00	194,618.00	0.03
150	603799	华友钴业	6,500.00	190,190.00	0.03
151	300339	润和软件	3,800.00	190,114.00	0.03
152	002460	赣锋锂业	5,400.00	189,054.00	0.03
153	002384	东山精密	6,400.00	186,880.00	0.03
154	601788	光大证券	10,300.00	186,533.00	0.03
155	600795	国电电力	40,500.00	185,490.00	0.03
156	601838	成都银行	10,800.00	184,788.00	0.03
157	000768	中航西飞	6,500.00	183,560.00	0.03
158	002797	第一创业	21,800.00	182,030.00	0.02
159	002422	科伦药业	6,000.00	179,580.00	0.02
160	601066	中信建投	6,800.00	175,100.00	0.02
161	601360	三六零	16,800.00	173,880.00	0.02
162	601800	中国交建	16,600.00	173,470.00	0.02
163	001979	招商蛇口	16,900.00	173,056.00	0.02
164	600415	小商品城	12,900.00	172,989.00	0.02
165	600157	永泰能源	100,900.00	172,539.00	0.02
166	601881	中国银河	11,300.00	172,099.00	0.02
167	600989	宝丰能源	10,200.00	171,768.00	0.02
168	300442	润泽科技	3,300.00	171,468.00	0.02
169	601878	浙商证券	14,000.00	171,360.00	0.02
170	600029	南方航空	26,200.00	170,038.00	0.02
171	600839	四川长虹	17,600.00	169,840.00	0.02
172	002736	国信证券	15,100.00	169,120.00	0.02
173	000157	中联重科	23,300.00	168,459.00	0.02
174	600674	川投能源	9,700.00	167,325.00	0.02
175	600489	中金黄金	13,800.00	166,014.00	0.02
176	600115	中国东航	40,800.00	163,200.00	0.02
177	601162	天风证券	36,400.00	163,072.00	0.02
178	603369	今世缘	3,600.00	162,828.00	0.02
179	002466	天齐锂业	4,900.00	161,700.00	0.02
180	300782	卓胜微	1,800.00	161,460.00	0.02
180	601555	东吴证券	20,700.00	161,460.00	0.02
181	600066	宇通客车	6,100.00	160,918.00	0.02
182	600745	闻泰科技	4,100.00	158,998.00	0.02
183	301236	软通动力	2,700.00	158,517.00	0.02
184	600487	亨通光电	9,200.00	158,424.00	0.02

185	002001	新和成	7,200.00	158,184.00	0.02
186	300418	昆仑万维	4,100.00	157,768.00	0.02
187	002340	格林美	24,100.00	157,373.00	0.02
188	601689	拓普集团	3,200.00	156,800.00	0.02
189	600160	巨化股份	6,400.00	154,368.00	0.02
190	300207	欣旺达	6,900.00	153,939.00	0.02
191	601099	太平洋	35,900.00	152,934.00	0.02
192	601633	长城汽车	5,800.00	152,714.00	0.02
193	600346	恒力石化	9,800.00	150,430.00	0.02
194	000661	长春高新	1,500.00	149,160.00	0.02
195	600426	华鲁恒升	6,900.00	149,109.00	0.02
196	600196	复星医药	6,000.00	149,100.00	0.02
197	688126	沪硅产业	7,894.00	148,565.08	0.02
198	002648	卫星化学	7,900.00	148,441.00	0.02
199	002156	通富微电	5,000.00	147,750.00	0.02
200	300122	智飞生物	5,600.00	147,280.00	0.02
201	002236	大华股份	9,200.00	147,200.00	0.02
202	003816	中国广核	35,600.00	147,028.00	0.02
203	688777	中控技术	2,954.00	146,725.18	0.02
204	300394	天孚通信	1,600.00	146,176.00	0.02
205	000786	北新建材	4,800.00	145,488.00	0.02
206	000963	华东医药	4,200.00	145,320.00	0.02
207	601111	中国国航	18,200.00	143,962.00	0.02
208	002966	苏州银行	17,700.00	143,547.00	0.02
209	688169	石头科技	653.00	143,196.37	0.02
210	002920	德赛西威	1,300.00	143,143.00	0.02
211	600460	士兰微	5,500.00	143,110.00	0.02
212	601117	中国化学	16,900.00	140,101.00	0.02
213	600372	中航机载	11,300.00	139,329.00	0.02
214	002185	华天科技	12,000.00	139,320.00	0.02
215	000596	古井贡酒	800.00	138,640.00	0.02
216	601108	财通证券	16,900.00	138,073.00	0.02
217	002601	龙佰集团	7,800.00	137,826.00	0.02
218	600600	青岛啤酒	1,700.00	137,564.00	0.02
219	601100	恒立液压	2,600.00	137,202.00	0.02
220	601868	中国能建	59,900.00	137,171.00	0.02
221	002129	TCL 中环	15,300.00	135,711.00	0.02
222	000066	中国长城	9,300.00	135,501.00	0.02
223	600011	华能国际	20,000.00	135,400.00	0.02
224	688223	晶科能源	18,890.00	134,307.90	0.02
225	600096	云天化	6,000.00	133,800.00	0.02
226	002202	金风科技	12,900.00	133,257.00	0.02
227	601021	春秋航空	2,300.00	132,641.00	0.02

228	000807	云铝股份	9,800.00	132,594.00	0.02
229	000423	东阿阿胶	2,100.00	131,712.00	0.02
230	300347	泰格医药	2,400.00	131,088.00	0.02
231	600536	中国软件	2,800.00	130,732.00	0.02
232	600085	同仁堂	3,200.00	129,888.00	0.02
233	600482	中国动力	5,300.00	129,691.00	0.02
234	002180	纳思达	4,600.00	129,582.00	0.02
235	002459	晶澳科技	9,400.00	129,250.00	0.02
236	600741	华域汽车	7,300.00	128,553.00	0.02
237	002493	荣盛石化	14,200.00	128,510.00	0.02
238	600219	南山铝业	32,700.00	127,857.00	0.02
239	300896	爱美客	700.00	127,750.00	0.02
240	600176	中国巨石	11,200.00	127,568.00	0.02
241	300832	新产业	1,800.00	127,530.00	0.02
242	600183	生益科技	5,300.00	127,465.00	0.02
243	603392	万泰生物	1,800.00	126,828.00	0.02
244	600079	人福医药	5,400.00	126,252.00	0.02
245	002709	天赐材料	6,400.00	126,208.00	0.02
246	300759	康龙化成	4,900.00	125,930.00	0.02
247	601319	中国人保	16,500.00	125,730.00	0.02
248	001965	招商公路	9,000.00	125,550.00	0.02
249	688617	惠泰医疗	337.00	125,475.21	0.02
250	601168	西部矿业	7,800.00	125,346.00	0.02
251	002738	中矿资源	3,500.00	124,250.00	0.02
252	600885	宏发股份	3,900.00	124,098.00	0.02
253	600352	浙江龙盛	12,000.00	123,480.00	0.02
254	600988	赤峰黄金	7,900.00	123,319.00	0.02
255	601933	永辉超市	19,400.00	122,996.00	0.02
256	300661	圣邦股份	1,500.00	122,670.00	0.02
257	000895	双汇发展	4,700.00	122,012.00	0.02
258	301269	华大九天	1,000.00	121,100.00	0.02
259	002271	东方雨虹	9,300.00	120,714.00	0.02
260	600515	海南机场	31,900.00	120,582.00	0.02
261	002138	顺络电子	3,800.00	119,624.00	0.02
262	601877	正泰电器	5,100.00	119,391.00	0.02
263	600109	国金证券	13,500.00	117,855.00	0.02
264	300476	胜宏科技	2,800.00	117,852.00	0.02
265	600188	兖矿能源	8,300.00	117,611.00	0.02
266	688099	晶晨股份	1,710.00	117,442.80	0.02
267	300017	网宿科技	11,100.00	117,327.00	0.02
268	000783	长江证券	17,200.00	117,304.00	0.02
269	600845	宝信软件	4,000.00	117,040.00	0.02
270	688396	华润微	2,480.00	117,031.20	0.02

271	002938	鹏鼎控股	3,200.00	116,736.00	0.02
272	601577	长沙银行	13,100.00	116,459.00	0.02
273	002078	太阳纸业	7,800.00	115,986.00	0.02
274	002555	三七互娱	7,400.00	115,736.00	0.02
275	000630	铜陵有色	35,800.00	115,634.00	0.02
276	300803	指南针	1,200.00	115,140.00	0.02
277	002673	西部证券	14,100.00	114,915.00	0.02
278	300136	信维通信	4,500.00	114,480.00	0.02
279	000728	国元证券	13,600.00	113,696.00	0.02
280	689009	九号公司 -WD	2,388.00	113,430.00	0.02
281	002444	巨星科技	3,500.00	113,225.00	0.02
282	300058	蓝色光标	12,200.00	113,216.00	0.02
283	002517	恺英网络	8,300.00	112,963.00	0.02
284	002916	深南电路	900.00	112,500.00	0.02
285	601198	东兴证券	10,200.00	112,302.00	0.02
286	300474	景嘉微	1,200.00	112,188.00	0.02
287	600233	圆通速递	7,900.00	112,101.00	0.02
288	600161	天坛生物	5,400.00	110,700.00	0.02
289	600879	航天电子	12,300.00	110,208.00	0.02
290	603893	瑞芯微	1,000.00	110,060.00	0.02
291	002085	万丰奥威	5,800.00	109,910.00	0.02
292	601607	上海医药	5,200.00	109,200.00	0.01
293	300223	北京君正	1,600.00	109,120.00	0.01
294	601128	常熟银行	14,400.00	109,008.00	0.01
295	300002	神州泰岳	9,400.00	108,946.00	0.01
296	601618	中国中冶	33,000.00	108,900.00	0.01
297	601615	明阳智能	8,600.00	108,446.00	0.01
298	002074	国轩高科	5,100.00	108,222.00	0.01
299	002353	杰瑞股份	2,900.00	107,271.00	0.01
300	000999	华润三九	2,400.00	106,416.00	0.01
301	000983	山西焦煤	12,900.00	106,296.00	0.01
302	300024	机器人	5,900.00	105,905.00	0.01
303	603160	汇顶科技	1,300.00	104,702.00	0.01
304	688072	拓荆科技	680.00	104,495.60	0.01
305	002281	光迅科技	2,000.00	104,340.00	0.01
306	688120	华海清科	637.00	103,824.63	0.01
307	002128	电投能源	5,300.00	103,774.00	0.01
308	688047	龙芯中科	784.00	103,707.52	0.01
309	600023	浙能电力	18,300.00	103,578.00	0.01
310	601898	中煤能源	8,500.00	103,530.00	0.01
311	688469	芯联集成-U	20,129.00	103,261.77	0.01
312	600588	用友网络	9,600.00	103,008.00	0.01

313	000408	藏格矿业	3,700.00	102,601.00	0.01
314	002223	鱼跃医疗	2,800.00	102,172.00	0.01
315	002465	海格通信	9,300.00	102,114.00	0.01
316	300450	先导智能	5,100.00	102,102.00	0.01
317	000301	东方盛虹	12,400.00	101,804.00	0.01
318	605117	德业股份	1,200.00	101,760.00	0.01
319	600061	国投资本	13,500.00	101,520.00	0.01
320	601567	三星医疗	3,300.00	101,508.00	0.01
321	300496	中科创达	1,700.00	101,252.00	0.01
322	600362	江西铜业	4,900.00	101,136.00	0.01
323	600862	中航高科	4,000.00	101,040.00	0.01
324	600298	安琪酵母	2,800.00	100,940.00	0.01
325	002532	天山铝业	12,800.00	100,736.00	0.01
326	688599	天合光能	5,215.00	100,649.50	0.01
327	000750	国海证券	23,500.00	100,580.00	0.01
328	300114	中航电测	1,400.00	100,492.00	0.01
329	002195	岩山科技	25,200.00	100,044.00	0.01
330	002008	大族激光	4,000.00	100,000.00	0.01
331	603606	东方电缆	1,900.00	99,845.00	0.01
332	301358	湖南裕能	2,200.00	99,704.00	0.01
333	603296	华勤技术	1,400.00	99,330.00	0.01
334	300316	晶盛机电	3,100.00	98,890.00	0.01
335	600765	中航重机	4,800.00	98,256.00	0.01
336	000831	中国稀土	3,500.00	98,175.00	0.01
337	600369	西南证券	21,000.00	98,070.00	0.01
338	002472	双环传动	3,200.00	97,984.00	0.01
339	000876	新希望	10,900.00	97,882.00	0.01
340	300866	安克创新	1,000.00	97,640.00	0.01
341	601872	招商轮船	15,200.00	97,432.00	0.01
342	601238	广汽集团	10,400.00	97,136.00	0.01
343	600895	张江高科	3,600.00	96,480.00	0.01
344	601696	中银证券	8,600.00	95,976.00	0.01
345	002595	豪迈科技	1,900.00	95,361.00	0.01
346	600918	中泰证券	14,500.00	95,265.00	0.01
347	601990	南京证券	11,000.00	95,260.00	0.01
348	300383	光环新网	6,500.00	94,835.00	0.01
349	300999	金龙鱼	2,900.00	94,569.00	0.01
350	300012	华测检测	7,600.00	94,468.00	0.01
351	300413	芒果超媒	3,500.00	94,115.00	0.01
352	688213	思特威-W	1,208.00	93,885.76	0.01
353	600332	白云山	3,300.00	93,786.00	0.01
354	300054	鼎龙股份	3,600.00	93,672.00	0.01
355	300037	新宙邦	2,500.00	93,600.00	0.01

356	300699	光威复材	2,700.00	93,555.00	0.01
357	601799	星宇股份	700.00	93,436.00	0.01
358	688249	晶合集成	4,001.00	93,383.34	0.01
359	600873	梅花生物	9,300.00	93,279.00	0.01
360	603605	珀莱雅	1,100.00	93,170.00	0.01
361	300604	长川科技	2,100.00	92,673.00	0.01
362	300142	沃森生物	7,600.00	91,808.00	0.01
363	600177	雅戈尔	10,300.00	91,670.00	0.01
364	000617	中油资本	13,200.00	90,948.00	0.01
365	601233	桐昆股份	7,700.00	90,860.00	0.01
366	000400	许继电气	3,300.00	90,849.00	0.01
367	300395	菲利华	2,400.00	90,264.00	0.01
368	688122	西部超导	2,106.00	90,178.92	0.01
369	002812	恩捷股份	2,800.00	89,572.00	0.01
370	000932	华菱钢铁	21,400.00	89,452.00	0.01
371	603596	伯特利	2,000.00	89,180.00	0.01
372	603260	合盛硅业	1,600.00	88,896.00	0.01
373	300628	亿联网络	2,300.00	88,780.00	0.01
374	600909	华安证券	14,600.00	88,476.00	0.01
375	600039	四川路桥	12,100.00	88,088.00	0.01
376	002850	科达利	900.00	87,912.00	0.01
377	002261	拓维信息	4,800.00	87,888.00	0.01
378	000009	中国宝安	9,600.00	87,840.00	0.01
379	688472	阿特斯	6,961.00	87,430.16	0.01
380	600027	华电国际	15,500.00	86,955.00	0.01
381	600803	新奥股份	4,000.00	86,720.00	0.01
382	600153	建发股份	8,200.00	86,264.00	0.01
383	688361	中科飞测	982.00	85,974.10	0.01
384	002007	华兰生物	5,100.00	85,935.00	0.01
385	600155	华创云信	11,600.00	85,840.00	0.01
386	600143	金发科技	9,900.00	85,536.00	0.01
387	601456	国联证券	6,300.00	85,176.00	0.01
388	000623	吉林敖东	4,900.00	84,623.00	0.01
389	600642	申能股份	8,900.00	84,461.00	0.01
390	688525	佰维存储	1,356.00	84,031.32	0.01
391	000021	深科技	4,400.00	83,864.00	0.01
392	002821	凯莱英	1,100.00	83,699.00	0.01
393	002294	信立泰	2,700.00	83,511.00	0.01
394	002436	兴森科技	7,500.00	83,325.00	0.01
395	000738	航发控制	3,700.00	82,288.00	0.01
396	300724	捷佳伟创	1,300.00	82,173.00	0.01
397	002318	久立特材	3,500.00	81,935.00	0.01
398	600398	海澜之家	10,900.00	81,750.00	0.01

399	601997	贵阳银行	13,600.00	81,600.00	0.01
400	603345	安井食品	1,000.00	81,480.00	0.01
401	002558	巨人网络	6,400.00	81,216.00	0.01
402	603659	璞泰来	5,100.00	81,141.00	0.01
403	002409	雅克科技	1,400.00	81,130.00	0.01
404	600875	东方电气	5,100.00	81,039.00	0.01
405	000878	云南铜业	6,600.00	80,454.00	0.01
406	600673	东阳光	7,100.00	80,159.00	0.01
407	000733	振华科技	1,900.00	80,123.00	0.01
408	688521	芯原股份	1,526.00	80,008.18	0.01
409	600529	山东药玻	3,100.00	79,887.00	0.01
410	300919	中伟股份	2,200.00	79,464.00	0.01
411	601216	君正集团	15,100.00	79,426.00	0.01
412	600497	驰宏锌锗	14,200.00	79,094.00	0.01
413	600018	上港集团	12,800.00	78,336.00	0.01
414	000729	燕京啤酒	6,500.00	78,260.00	0.01
415	600141	兴发集团	3,600.00	78,120.00	0.01
416	600025	华能水电	8,200.00	77,982.00	0.01
417	002065	东华软件	10,700.00	77,682.00	0.01
418	002410	广联达	6,600.00	77,616.00	0.01
419	601699	潞安环能	5,400.00	77,544.00	0.01
420	603338	浙江鼎力	1,200.00	77,424.00	0.01
421	688002	睿创微纳	1,645.00	77,331.45	0.01
422	000034	神州数码	2,200.00	77,110.00	0.01
423	600549	厦门钨业	4,000.00	77,080.00	0.01
424	300073	当升科技	1,900.00	76,532.00	0.01
425	601059	信达证券	5,100.00	76,398.00	0.01
426	600390	五矿资本	11,800.00	76,110.00	0.01
427	000997	新大陆	3,800.00	75,810.00	0.01
428	601665	齐鲁银行	13,500.00	75,465.00	0.01
429	600026	中远海能	6,500.00	75,400.00	0.01
430	002739	万达电影	6,200.00	75,268.00	0.01
431	002064	华峰化学	9,200.00	75,256.00	0.01
432	600521	华海药业	4,200.00	75,054.00	0.01
433	603087	甘李药业	1,700.00	74,970.00	0.01
434	688009	中国通号	11,928.00	74,669.28	0.01
435	300001	特锐德	3,400.00	74,630.00	0.01
436	002841	视源股份	2,000.00	73,820.00	0.01
437	600060	海信视像	3,700.00	73,778.00	0.01
438	600118	中国卫星	2,700.00	73,710.00	0.01
439	300751	迈为股份	700.00	73,605.00	0.01
440	688303	大全能源	3,041.00	73,409.74	0.01
441	002432	九安医疗	1,800.00	73,404.00	0.01

442	600820	隧道股份	10,200.00	73,338.00	0.01
443	300763	锦浪科技	1,200.00	73,284.00	0.01
444	600637	东方明珠	9,400.00	72,944.00	0.01
445	600704	物产中大	14,400.00	72,864.00	0.01
446	601865	福莱特	3,700.00	72,853.00	0.01
447	603806	福斯特	4,900.00	72,520.00	0.01
448	688188	柏楚电子	372.00	72,261.00	0.01
449	600580	卧龙电驱	4,200.00	72,198.00	0.01
450	600699	均胜电子	4,600.00	72,082.00	0.01
451	002385	大北农	16,600.00	71,878.00	0.01
452	002984	森麒麟	2,900.00	71,514.00	0.01
453	600563	法拉电子	600.00	71,352.00	0.01
454	601179	中国西电	9,400.00	71,346.00	0.01
455	600312	平高电气	3,700.00	71,040.00	0.01
456	002262	恩华药业	2,900.00	70,615.00	0.01
457	002624	完美世界	6,800.00	70,244.00	0.01
458	688506	百利天恒-U	366.00	70,173.18	0.01
459	002568	百润股份	2,500.00	70,025.00	0.01
460	002500	山西证券	11,100.00	69,708.00	0.01
461	600132	重庆啤酒	1,100.00	69,322.00	0.01
462	603568	伟明环保	3,200.00	69,216.00	0.01
463	300003	乐普医疗	6,100.00	69,174.00	0.01
464	600516	方大炭素	14,300.00	69,069.00	0.01
465	002152	广电运通	5,900.00	68,794.00	0.01
466	688180	君实生物-U	2,510.00	68,598.30	0.01
467	603179	新泉股份	1,600.00	68,320.00	0.01
468	002926	华西证券	8,200.00	68,142.00	0.01
469	601666	平煤股份	6,800.00	68,136.00	0.01
470	002939	长城证券	8,300.00	68,060.00	0.01
471	000629	钒钛股份	23,600.00	67,968.00	0.01
472	600392	盛和资源	6,600.00	67,848.00	0.01
473	000683	远兴能源	12,100.00	67,639.00	0.01
474	600316	洪都航空	2,100.00	67,452.00	0.01
475	002607	中公教育	19,800.00	67,320.00	0.01
476	002407	多氟多	5,600.00	67,200.00	0.01
477	002044	美年健康	14,600.00	67,014.00	0.01
478	300144	宋城演艺	7,200.00	66,888.00	0.01
479	000039	中集集团	8,600.00	66,822.00	0.01
480	603589	口子窖	1,700.00	66,708.00	0.01
481	600763	通策医疗	1,500.00	66,600.00	0.01
482	603816	顾家家居	2,400.00	66,192.00	0.01
483	300251	光线传媒	7,000.00	66,080.00	0.01
484	000960	锡业股份	4,700.00	65,941.00	0.01

485	600008	首创环保	20,000.00	65,600.00	0.01
486	603979	金诚信	1,800.00	65,340.00	0.01
487	300373	扬杰科技	1,500.00	65,280.00	0.01
488	600170	上海建工	24,600.00	65,190.00	0.01
489	603939	益丰药房	2,700.00	65,151.00	0.01
490	601717	郑煤机	5,000.00	64,900.00	0.01
491	300558	贝达药业	1,200.00	64,716.00	0.01
492	000513	丽珠集团	1,700.00	64,600.00	0.01
493	300529	健帆生物	2,200.00	64,548.00	0.01
494	600863	内蒙华电	14,900.00	64,517.00	0.01
495	000426	兴业银锡	5,800.00	64,496.00	0.01
496	600498	烽火通信	3,300.00	64,218.00	0.01
497	000703	恒逸石化	10,200.00	64,056.00	0.01
498	002603	以岭药业	4,000.00	64,040.00	0.01
499	600872	中炬高新	2,900.00	63,858.00	0.01
500	600486	扬农化工	1,100.00	63,657.00	0.01
501	000723	美锦能源	14,100.00	63,591.00	0.01
502	603195	公牛集团	900.00	63,216.00	0.01
503	002025	航天电器	1,300.00	63,128.00	0.01
504	601000	唐山港	13,400.00	63,114.00	0.01
505	300285	国瓷材料	3,700.00	63,048.00	0.01
506	002958	青农商行	20,700.00	62,928.00	0.01
507	002155	湖南黄金	4,000.00	62,920.00	0.01
508	603129	春风动力	400.00	62,828.00	0.01
509	688578	艾力斯	1,048.00	62,775.20	0.01
510	300390	天华新能	2,700.00	62,235.00	0.01
511	600901	江苏金租	11,900.00	62,118.00	0.01
512	603833	欧派家居	900.00	62,046.00	0.01
513	601236	红塔证券	7,300.00	61,977.00	0.01
514	000830	鲁西化工	5,300.00	61,957.00	0.01
515	605358	立昂微	2,500.00	61,925.00	0.01
516	000636	风华高科	4,300.00	61,705.00	0.01
517	601136	首创证券	2,800.00	61,600.00	0.01
518	600511	国药股份	1,800.00	61,596.00	0.01
519	601966	玲珑轮胎	3,400.00	61,336.00	0.01
520	002429	兆驰股份	10,600.00	61,268.00	0.01
521	688052	纳芯微	467.00	60,850.10	0.01
522	600535	天士力	4,200.00	60,732.00	0.01
523	000921	海信家电	2,100.00	60,690.00	0.01
524	000893	亚钾国际	3,000.00	60,480.00	0.01
525	000591	太阳能	12,700.00	60,452.00	0.01
526	603885	吉祥航空	4,400.00	60,280.00	0.01
527	002203	海亮股份	5,600.00	60,200.00	0.01

528	600325	华发股份	10,400.00	59,904.00	0.01
529	601880	辽港股份	34,600.00	59,858.00	0.01
530	600970	中材国际	6,300.00	59,724.00	0.01
531	600021	上海电力	6,500.00	59,605.00	0.01
532	002414	高德红外	8,000.00	59,440.00	0.01
533	600998	九州通	11,600.00	59,392.00	0.01
534	601698	中国卫通	2,900.00	59,160.00	0.01
535	600754	锦江酒店	2,200.00	59,092.00	0.01
536	300748	金力永磁	3,300.00	59,004.00	0.01
537	002423	中粮资本	4,400.00	58,916.00	0.01
538	600348	华阳股份	8,300.00	58,847.00	0.01
539	600380	健康元	5,200.00	58,604.00	0.01
540	603927	中科软	2,700.00	58,590.00	0.01
541	600208	衢州发展	19,700.00	58,312.00	0.01
542	603077	和邦生物	28,400.00	57,936.00	0.01
543	300567	精测电子	900.00	57,870.00	0.01
544	600038	中直股份	1,500.00	57,840.00	0.01
545	000060	中金岭南	12,300.00	57,687.00	0.01
546	002670	国盛金控	4,400.00	57,596.00	0.01
547	300487	蓝晓科技	1,200.00	57,444.00	0.01
548	603000	人民网	2,600.00	57,304.00	0.01
549	600655	豫园股份	8,900.00	57,227.00	0.01
550	688385	复旦微电	1,484.00	56,970.76	0.01
551	688187	时代电气	1,185.00	56,785.20	0.01
552	601016	节能风电	17,900.00	56,743.00	0.01
553	300146	汤臣倍健	4,700.00	56,635.00	0.01
554	000563	陕国投 A	15,900.00	56,604.00	0.01
555	002756	永兴材料	1,500.00	56,580.00	0.01
556	000519	中兵红箭	3,900.00	56,355.00	0.01
557	300212	易华录	2,400.00	56,160.00	0.01
558	002683	广东宏大	2,100.00	55,608.00	0.01
559	600583	海油工程	10,100.00	55,247.00	0.01
560	300979	华利集团	700.00	55,055.00	0.01
561	603156	养元饮品	2,400.00	54,816.00	0.01
562	600166	福田汽车	21,800.00	54,718.00	0.01
563	600859	王府井	3,500.00	53,935.00	0.01
564	688278	特宝生物	735.00	53,926.95	0.01
565	603290	斯达半导	600.00	53,892.00	0.01
566	002439	启明星辰	3,400.00	53,788.00	0.01
567	002373	千方科技	5,300.00	53,742.00	0.01
568	002507	涪陵榨菜	3,800.00	53,694.00	0.01
569	600707	彩虹股份	6,500.00	53,430.00	0.01
570	603529	爱玛科技	1,300.00	53,326.00	0.01

571	600546	山煤国际	4,500.00	53,235.00	0.01
572	002653	海思科	1,600.00	53,200.00	0.01
573	300765	新诺威	2,000.00	53,180.00	0.01
574	300601	康泰生物	3,100.00	53,165.00	0.01
575	300677	英科医疗	2,100.00	53,088.00	0.01
576	600131	国网信通	2,800.00	52,948.00	0.01
577	600004	白云机场	5,500.00	52,800.00	0.01
578	601918	新集能源	7,300.00	52,414.00	0.01
579	002430	杭氧股份	2,400.00	52,320.00	0.01
580	600737	中粮糖业	5,100.00	52,071.00	0.01
581	601001	晋控煤业	3,800.00	51,946.00	0.01
582	600483	福能股份	5,200.00	51,844.00	0.01
583	603486	科沃斯	1,100.00	51,700.00	0.01
584	002244	滨江集团	6,000.00	51,660.00	0.01
585	000598	兴蓉环境	6,800.00	51,612.00	0.01
586	688220	翱捷科技-U	954.00	51,601.86	0.01
587	301308	江波龙	600.00	51,600.00	0.01
588	600867	通化东宝	6,400.00	51,584.00	0.01
589	000050	深天马 A	5,700.00	51,471.00	0.01
590	601155	新城控股	4,300.00	51,428.00	0.01
591	603899	晨光股份	1,700.00	51,425.00	0.01
592	601231	环旭电子	3,100.00	51,150.00	0.01
593	002120	韵达股份	6,800.00	51,136.00	0.01
594	688017	绿的谐波	473.00	51,112.38	0.01
595	300070	碧水源	10,100.00	51,106.00	0.01
596	688065	凯赛生物	1,314.00	50,983.20	0.01
597	601611	中国核建	5,600.00	50,624.00	0.01
598	601156	东航物流	3,000.00	50,610.00	0.01
599	300676	华大基因	1,200.00	50,364.00	0.01
600	300118	东方日升	4,200.00	50,316.00	0.01
601	688772	珠海冠宇	3,111.00	50,024.88	0.01
602	002368	太极股份	2,100.00	49,728.00	0.01
603	600739	辽宁成大	4,800.00	49,680.00	0.01
604	600416	湘电股份	4,400.00	49,676.00	0.01
605	000818	航锦科技	2,600.00	49,660.00	0.01
606	601098	中南传媒	3,300.00	49,533.00	0.01
607	600566	济川药业	1,700.00	49,436.00	0.01
608	002056	横店东磁	3,800.00	49,248.00	0.01
609	300573	兴齐眼药	700.00	48,846.00	0.01
610	002831	裕同科技	1,800.00	48,780.00	0.01
611	600598	北大荒	3,300.00	48,675.00	0.01
612	000887	中鼎股份	3,700.00	48,544.00	0.01
613	002240	盛新锂能	3,500.00	48,230.00	0.01

614	601991	大唐发电	16,900.00	48,165.00	0.01
615	002572	索菲亚	2,800.00	48,104.00	0.01
616	688005	容百科技	1,524.00	48,082.20	0.01
617	603658	安图生物	1,100.00	48,004.00	0.01
618	600435	北方导航	4,900.00	47,824.00	0.01
619	601866	中远海发	18,300.00	47,763.00	0.01
620	600582	天地科技	7,700.00	47,586.00	0.01
621	600906	财达证券	6,700.00	47,570.00	0.01
622	300595	欧普康视	2,500.00	47,375.00	0.01
623	600271	航天信息	5,200.00	47,372.00	0.01
624	000958	电投产融	7,600.00	47,348.00	0.01
625	603228	景旺电子	1,700.00	47,328.00	0.01
626	003031	中瓷电子	900.00	47,151.00	0.01
627	002508	老板电器	2,200.00	47,146.00	0.01
628	600755	厦门国贸	7,100.00	47,144.00	0.01
629	600258	首旅酒店	3,200.00	46,944.00	0.01
630	000709	河钢股份	21,200.00	46,852.00	0.01
631	000778	新兴铸管	12,200.00	46,848.00	0.01
632	300009	安科生物	5,400.00	46,656.00	0.01
633	601958	金钼股份	4,600.00	46,276.00	0.01
634	000155	川能动力	4,300.00	45,924.00	0.01
635	002268	电科网安	2,800.00	45,500.00	0.01
636	688363	华熙生物	886.00	45,221.44	0.01
637	600685	中船防务	1,900.00	45,030.00	0.01
638	688538	和辉光电-U	19,363.00	44,922.16	0.01
639	688114	华大智造	958.00	44,824.82	0.01
640	603298	杭叉集团	2,500.00	44,725.00	0.01
641	600995	南网储能	4,400.00	44,528.00	0.01
642	600129	太极集团	1,800.00	44,496.00	0.01
643	600848	上海临港	4,400.00	44,440.00	0.01
644	000403	派林生物	2,100.00	44,373.00	0.01
645	000883	湖北能源	8,900.00	44,322.00	0.01
646	000739	普洛药业	2,700.00	43,902.00	0.01
647	601118	海南橡胶	8,100.00	43,821.00	0.01
648	603444	吉比特	200.00	43,768.00	0.01
649	600517	国网英大	7,900.00	43,529.00	0.01
650	002299	圣农发展	3,000.00	43,440.00	0.01
651	600378	昊华科技	1,500.00	43,365.00	0.01
652	600095	湘财股份	6,000.00	43,200.00	0.01
652	603728	鸣志电器	800.00	43,200.00	0.01
653	000027	深圳能源	6,600.00	42,768.00	0.01
654	601636	旗滨集团	7,600.00	42,636.00	0.01
655	603737	三棵树	1,000.00	42,600.00	0.01

656	603379	三美股份	1,100.00	42,218.00	0.01
657	600499	科达制造	5,400.00	42,120.00	0.01
658	300888	稳健医疗	1,000.00	42,080.00	0.01
659	600528	中铁工业	5,200.00	41,912.00	0.01
660	002080	中材科技	3,200.00	41,856.00	0.01
661	601399	国机重装	13,500.00	41,580.00	0.01
662	600373	中文传媒	3,300.00	41,415.00	0.01
663	600606	绿地控股	19,700.00	41,370.00	0.01
664	601808	中海油服	2,700.00	41,175.00	0.01
665	603858	步长制药	2,600.00	41,080.00	0.01
666	603712	七一二	2,100.00	40,887.00	0.01
667	000825	太钢不锈	11,700.00	40,716.00	0.01
668	002557	洽洽食品	1,400.00	40,670.00	0.01
669	600977	中国电影	3,500.00	40,635.00	0.01
670	688567	孚能科技	3,484.00	40,414.40	0.01
671	601928	凤凰传媒	3,500.00	40,390.00	0.01
672	600329	达仁堂	1,300.00	40,040.00	0.01
673	688234	天岳先进	777.00	39,782.40	0.01
674	600764	中国海防	1,400.00	39,648.00	0.01
675	600062	华润双鹤	2,000.00	39,600.00	0.01
676	600884	杉杉股份	5,300.00	39,485.00	0.01
677	600968	海油发展	9,200.00	39,284.00	0.01
678	601598	中国外运	7,300.00	39,055.00	0.01
679	688082	盛美上海	390.00	39,000.00	0.01
680	600056	中国医药	3,500.00	38,850.00	0.01
681	600801	华新水泥	3,200.00	38,720.00	0.01
682	600959	江苏有线	11,500.00	38,525.00	0.01
683	603650	彤程新材	1,100.00	38,467.00	0.01
684	600808	马钢股份	12,400.00	38,316.00	0.01
685	688349	三一重能	1,239.00	38,260.32	0.01
686	688387	信科移动-U	6,370.00	37,965.20	0.01
687	301301	川宁生物	3,200.00	37,952.00	0.01
688	600871	石化油服	18,600.00	37,944.00	0.01
689	002372	伟星新材	3,000.00	37,890.00	0.01
690	000785	居然智家	10,600.00	37,842.00	0.01
691	002266	浙富控股	12,100.00	37,752.00	0.01
692	000800	一汽解放	4,600.00	37,720.00	0.01
693	000559	万向钱潮	6,100.00	37,515.00	0.01
694	688297	中无人机	929.00	37,420.12	0.01
695	603688	石英股份	1,300.00	37,349.00	0.01
696	601106	中国一重	12,800.00	37,248.00	0.01
697	000032	深桑达 A	2,100.00	37,044.00	0.01
698	002487	大金重工	1,800.00	36,882.00	0.01

699	002019	亿帆医药	3,400.00	36,448.00	0.00
700	600663	陆家嘴	3,700.00	36,408.00	0.00
701	603882	金域医学	1,300.00	35,789.00	0.00
702	688516	奥特维	819.00	35,470.89	0.00
703	688778	厦钨新能	763.00	34,823.32	0.00
704	603456	九洲药业	2,500.00	34,200.00	0.00
705	300957	贝泰妮	800.00	34,152.00	0.00
706	600377	宁沪高速	2,200.00	33,682.00	0.00
707	688561	奇安信-U	1,255.00	33,671.65	0.00
708	601965	中国汽研	1,900.00	33,478.00	0.00
709	600925	苏能股份	6,300.00	33,390.00	0.00
710	600500	中化国际	8,300.00	33,366.00	0.00
711	688536	思瑞浦	360.00	33,300.00	0.00
712	603556	海兴电力	900.00	33,291.00	0.00
713	688425	铁建重工	7,558.00	33,255.20	0.00
714	601019	山东出版	2,900.00	32,915.00	0.00
715	600612	老凤祥	600.00	32,562.00	0.00
716	001227	兰州银行	13,200.00	32,472.00	0.00
717	002531	天顺风能	4,100.00	32,431.00	0.00
718	600578	京能电力	9,200.00	32,384.00	0.00
719	002408	齐翔腾达	6,300.00	31,689.00	0.00
720	603233	大参林	2,100.00	31,626.00	0.00
721	001286	陕西能源	3,400.00	31,552.00	0.00
722	600126	杭钢股份	6,600.00	31,548.00	0.00
723	603225	新凤鸣	2,800.00	31,164.00	0.00
724	688301	奕瑞科技	326.00	31,155.82	0.00
725	688390	固德威	757.00	30,961.30	0.00
726	603185	弘元绿能	1,900.00	30,875.00	0.00
727	600350	山东高速	3,000.00	30,840.00	0.00
728	600098	广州发展	4,800.00	30,816.00	0.00
729	603707	健友股份	2,300.00	30,521.00	0.00
730	600688	上海石化	10,100.00	30,502.00	0.00
731	000937	冀中能源	4,800.00	30,336.00	0.00
732	601568	北元集团	7,200.00	30,240.00	0.00
733	603883	老百姓	1,800.00	29,466.00	0.00
734	000898	鞍钢股份	12,200.00	29,280.00	0.00
734	600295	鄂尔多斯	3,000.00	29,280.00	0.00
735	002867	周大生	2,000.00	29,060.00	0.00
736	000967	盈峰环境	5,800.00	28,826.00	0.00
737	600720	中交设计	3,200.00	28,352.00	0.00
738	601139	深圳燃气	4,000.00	28,240.00	0.00
739	002153	石基信息	3,900.00	27,846.00	0.00
740	688248	南网科技	865.00	27,757.85	0.00

741	601992	金隅集团	15,500.00	27,590.00	0.00
742	600339	中油工程	7,700.00	27,566.00	0.00
743	688281	华秦科技	294.00	27,371.40	0.00
744	688331	荣昌生物	895.00	26,948.45	0.00
745	002608	江苏国信	3,500.00	26,845.00	0.00
746	000537	中绿电	2,900.00	26,448.00	0.00
747	003022	联泓新科	1,900.00	26,163.00	0.00
748	000401	冀东水泥	5,000.00	26,150.00	0.00
749	300140	节能环保	4,300.00	25,757.00	0.00
750	002563	森马服饰	3,600.00	25,272.00	0.00
751	002690	美亚光电	1,700.00	25,194.00	0.00
752	688172	燕东微	1,246.00	24,982.30	0.00
753	688032	禾迈股份	221.00	24,893.44	0.00
754	603786	科博达	400.00	24,720.00	0.00
755	688520	神州细胞-U	676.00	24,491.48	0.00
756	600032	浙江新能	3,300.00	24,420.00	0.00
757	000959	首钢股份	7,900.00	24,095.00	0.00
758	688475	萤石网络	793.00	23,940.67	0.00
759	600299	安迪苏	1,900.00	23,845.00	0.00
760	601228	广州港	6,900.00	23,391.00	0.00
761	301267	华夏眼科	1,200.00	22,848.00	0.00
762	600361	创新新材	5,800.00	22,388.00	0.00
763	600928	西安银行	6,200.00	22,382.00	0.00
764	003035	南网能源	5,300.00	22,154.00	0.00
765	600007	中国国贸	900.00	22,014.00	0.00
766	301165	锐捷网络	300.00	21,660.00	0.00
767	002945	华林证券	1,400.00	21,462.00	0.00
768	603056	德邦股份	1,400.00	20,062.00	0.00
769	001203	大中矿业	2,300.00	19,918.00	0.00
770	600927	永安期货	1,500.00	19,785.00	0.00
771	000539	粤电力 A	4,100.00	18,573.00	0.00
772	688819	天能股份	670.00	18,237.40	0.00
773	688375	国博电子	364.00	17,967.04	0.00
774	603826	坤彩科技	900.00	17,325.00	0.00
775	688276	百克生物	628.00	15,769.08	0.00
776	301498	乖宝宠物	200.00	15,664.00	0.00
777	601858	中国科传	700.00	14,266.00	0.00
778	688153	唯捷创芯	384.00	12,848.64	0.00
779	601158	重庆水务	2,600.00	12,740.00	0.00
780	001289	龙源电力	700.00	10,997.00	0.00
781	600956	新天绿能	1,400.00	10,556.00	0.00
782	688295	中复神鹰	502.00	10,004.86	0.00
783	603341	龙旗科技	200.00	9,350.00	0.00

784	603868	飞科电器	200.00	8,304.00	0.00
785	03690	美团-W	10.00	1,428.86	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	600938	中国海油	21,167,897.00	1.25
1	00883	中国海洋石油	15,943,242.25	0.94
2	000333	美的集团	19,841,674.00	1.18
3	000975	山金国际	17,143,232.00	1.02
4	000858	五粮液	16,546,841.00	0.98
5	600900	长江电力	15,664,910.00	0.93
6	601138	工业富联	14,326,746.00	0.85
7	600519	贵州茅台	13,740,389.00	0.81
8	300750	宁德时代	13,148,059.40	0.78
9	603979	金诚信	12,056,586.00	0.71
10	000651	格力电器	10,945,593.15	0.65
11	300033	同花顺	10,528,804.00	0.62
12	002415	海康威视	10,392,449.00	0.62
13	601088	中国神华	7,670,295.00	0.45
13	01088	中国神华	2,599,697.47	0.15
14	601899	紫金矿业	9,345,573.00	0.55
15	600150	中国船舶	9,111,348.30	0.54
16	002714	牧原股份	8,808,680.32	0.52
17	600989	宝丰能源	8,746,443.00	0.52
18	600690	海尔智家	8,485,058.00	0.50
19	601689	拓普集团	7,958,354.20	0.47
20	600031	三一重工	7,709,507.00	0.46

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	600938	中国海油	22,420,217.00	1.33
1	00883	中国海洋石油	14,135,951.29	0.84
2	600900	长江电力	23,363,982.00	1.38
3	601899	紫金矿业	23,157,954.00	1.37
4	600519	贵州茅台	23,110,934.00	1.37
5	300033	同花顺	20,636,729.00	1.22

6	000333	美的集团	19,329,951.00	1.15
7	601138	工业富联	19,257,974.00	1.14
8	000975	山金国际	18,774,348.91	1.11
9	300750	宁德时代	16,783,859.60	0.99
10	000858	五粮液	15,557,400.00	0.92
11	300274	阳光电源	13,722,084.60	0.81
12	603979	金诚信	12,158,273.00	0.72
13	600276	恒瑞医药	11,974,672.25	0.71
14	002415	海康威视	11,794,543.00	0.70
15	600809	山西汾酒	11,125,157.00	0.66
16	688111	金山办公	10,994,819.37	0.65
17	600026	中远海能	9,219,874.00	0.55
17	01138	中远海能	1,305,730.33	0.08
18	600941	中国移动	10,466,150.00	0.62
19	300308	中际旭创	10,383,895.89	0.62
20	600529	山东药玻	10,170,499.00	0.60

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	778,098,430.36
卖出股票的收入（成交）总额	879,174,811.32

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	181,421,221.94	24.78
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	41,114,997.26	5.61
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	51,335,337.57	7.01
8	同业存单	-	-
9	公司债	343,474,744.67	46.91
10	地方债	-	-
11	定向工具	-	-
12	其他	-	-
13	合计	617,346,301.44	84.31

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	185628	22 焦煤 Y3	500,000.00	51,600,068.50	7.05
2	148144	22 华润 Y4	400,000.00	40,894,136.99	5.58
3	240072	河钢 YK03	400,000.00	40,858,794.52	5.58
4	019740	24 国债 09	400,000.00	40,505,358.90	5.53
5	019702	23 国债 09	300,000.00	37,884,509.59	5.17

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 基金投资的前十名证券的发行主体中，河钢集团有限公司出现在报告编制日前一年内受到监管部门公开谴责、处罚的情况。该类情形对发行主体或上市公司的经营和财务没有重大影响，该证券的投资决策程序符合相关法律法规以及基金合同的要求。

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	149,124.34
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,624.60
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	150,748.94

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	110085	通 22 转债	9,561,613.33	1.31
2	110073	国投转债	6,931,838.63	0.95
3	127045	牧原转债	6,363,309.23	0.87
4	127086	恒邦转债	6,273,975.95	0.86
5	113056	重银转债	5,898,054.11	0.81
6	110062	烽火转债	5,789,013.73	0.79
7	128142	新乳转债	4,141,828.45	0.57
8	111010	立昂转债	3,306,538.08	0.45
9	127016	鲁泰转债	1,616,333.47	0.22
10	113671	武进转债	1,452,832.59	0.20

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
中信证券债 券优化 A	11,747	40,353.09	53,530,674.44	11.29%	420,497,113.21	88.71%
中信证券债 券优化 C	4,099	50,006.40	-	-	204,976,217.32	100.00%
合计	15,846	42,850.18	53,530,674.44	7.88%	625,473,330.53	92.12%

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	中信证券债券优化 A	923,020.22	0.19%
	中信证券债券优化 C	185,415.44	0.09%
	合计	1,108,435.66	0.16%

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	中信证券债券优化 A	50~100
	中信证券债券优化 C	-
	合计	50~100
本基金基金经理持 有本开放式基金	中信证券债券优化 A	-
	中信证券债券优化 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）
刘琦	公募基金	>100
	私募资产管理计划	0
	合计	>100

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中信证券债券优化 A	中信证券债券优化 C
基金合同生效日（2021 年 5 月 31 日）基金份额总额	71,696,946.23	-

本报告期期初基金份额总额	1,156,967,878.83	439,803,604.33
本报告期基金总申购份额	765,015.02	438,390.86
减：本报告期基金总赎回份额	683,705,106.20	235,265,777.87
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	474,027,787.65	204,976,217.32

注：基金合同生效日：2021 年 05 月 31 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 32,400 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	1,657,354,024.30	100.00%	1,462,747.68	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	2,090,222,566.39	100.00%	29,271,070,000.00	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债券优化一年持有期债券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	2024-05-24
3	900007_中信证券债券优化一年持有期债券型集合资产管理计划（中信证券债券优化 C）基金产品资料概要（2024-05-28）	中国证监会指定报刊及网站	2024-05-28
4	900007_中信证券债券优化一年持有期债券型集合资产管理计划（中信证券债券优化 A）基金产品资料概要（2024-05-28）	中国证监会指定报刊及网站	2024-05-28
5	中信证券债券优化一年持有期债券型集合资产管理计划招募说明书（2024-5-28 更新）	中国证监会指定报刊及网站	2024-05-28

6	中信证券资产管理有限公司关于中信证券债券优化一年持有期债券型集合资产管理计划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	2024-05-28
7	中信证券债券优化一年持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同（2024-5-28 更新）	中国证监会指定报刊及网站	2024-05-28
8	中信证券资产管理有限公司中信证券债券优化一年持有期债券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	2024-06-14
9	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
10	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
11	900007_中信证券债券优化一年持有期债券型集合资产管理计划（中信证券债券优化 A）基金产品资料概要（2024-11-13）	中国证监会指定报刊及网站	2024-11-13
12	900007_中信证券债券优化一年持有期债券型集合资产管理计划（中信证券债券优化 C）基金产品资料概要（2024-11-13）	中国证监会指定报刊及网站	2024-11-13
13	中信证券债券优化一年持有期债券型集合资产管理计划招募说明书（2024-11-13 更新）	中国证监会指定报刊及网站	2024-11-13
14	中信证券债券优化一年持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同（2024-11-13 更新）	中国证监会指定报刊及网站	2024-11-13
15	中信证券资产管理有限公司关于中信证券债券优化一年持有期债券型集合资产管理计划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	2024-11-13
16	中信证券资产管理有限公司中信证券债券优化一年持有期债券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	2024-11-25
17	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
18	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
19	中信证券资产管理有限公司中信证券债券优化一年持有期债券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	2024-12-06

§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《中信证券债券优化一年持有期债券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、中信证券债券优化一年持有期债券型集合资产管理计划资产管理合同；
- 3、中信证券债券优化一年持有期债券型集合资产管理计划托管协议；
- 4、中信证券债券优化一年持有期债券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