

# 中信建投量化进取 6 个月持有期混合型证券投资基金

## 2024 年中期报告

2024 年 06 月 30 日

基金管理人:中信建投基金管理有限公司

基金托管人:中信银行股份有限公司

送出日期:2024 年 08 月 30 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年8月29日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2024年1月1日起至6月30日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§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	11
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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 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	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	48
7.1 期末基金资产组合情况	48
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	49
7.3 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
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	65
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	67
7.6 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	67
7.7 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	67
7.8 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	67
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	67
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	67
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	67
7.12 投资组合报告附注	68
§8 基金份额持有人信息	69
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	69
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	69

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	69
§9 开放式基金份额变动 .....	70
§10 重大事件揭示 .....	70
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	70
10.2 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 .....	70
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	70
10.4 基金投资策略的改变 .....	70
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	70
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	71
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	71
10.8 其他重大事件 .....	72
§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....	74
11.1 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 .....	74
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	74
§12 备查文件目录 .....	74
12.1 备查文件目录 .....	74
12.2 存放地点 .....	74
12.3 查阅方式 .....	75

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	中信建投量化进取6个月持有期混合型证券投资基金	
基金简称	中信建投量化进取	
基金主代码	011410	
基金运作方式	契约型开放式、对每份基金份额设置6个月的最短持有期	
基金合同生效日	2021年03月09日	
基金管理人	中信建投基金管理有限公司	
基金托管人	中信银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	594,401,176.43份	
基金合同存续期	不定期	
下属各类别基金的基金简称	中信建投量化进取A	中信建投量化进取C
下属各类别基金的交易代码	011410	011411
报告期末下属各类别基金的份额总额	465,792,774.73份	128,608,401.70份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过数量化的方法精选个股，在严格控制风险、保持良好流动性的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金通过对各类宏观经济指标及资产市场行为数据进行量化分析，判断当前市场行为热点、运动趋势以及投资者风险偏好，并构建多种估值、发展预期等因子指标。基于各因子与股票、债券等大类资产价格的内在相关性及其影响机制，分别进行定量判断、筛选及归类。在上述归类结果的基础上，灵活运用各类数量模型，分别构建股票、债券、货币等大类资产配置价值的趋势判断的量化因子，形成对股票、债券、货币等大类资产的配置观点。
业绩比较基准	中证500指数收益率×80%+中证综合债指数收益

	率×20%
风险收益特征	本基金属于混合型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。

## 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中信建投基金管理有限公司	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	朱伟	滕菲菲
	联系电话	010-59100208	4006800000
	电子邮箱	zhuweibj@csc.com.cn	tengfeifei@citicbank.com
客户服务电话		4009-108-108	95558
传真		010-59100298	010-85230024
注册地址		北京市怀柔区桥梓镇八龙桥雅苑3号楼1室	北京市朝阳区光华路10号院1号楼6-30层、32-42层
办公地址		北京市东城区朝阳门内大街2号凯恒中心B座17层	北京市朝阳区光华路10号院1号楼6-30层、32-42层
邮政编码		100010	100020
法定代表人		黄凌	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	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.cfund108.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中信建投基金管理有限公司	北京市东城区朝阳门内大街2号凯恒中心B座17层

## §3 主要财务指标和基金净值表现

### 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	报告期 (2024年01月01日-2024年06月30日)	
	中信建投量化进取 A	中信建投量化进取 C
本期已实现收益	-26,259,312.54	-7,813,462.06
本期利润	-35,698,804.71	-10,251,318.61
加权平均基金份额本期利润	-0.0742	-0.0757
本期加权平均净值利润率	-9.17%	-9.47%
本期基金份额净值增长率	-8.37%	-8.55%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2024年06月30日)	
期末可供分配利润	-94,676,336.09	-27,490,687.01
期末可供分配基金份额利润	-0.2033	-0.2138
期末基金资产净值	371,116,438.64	101,117,714.69
期末基金份额净值	0.7967	0.7862
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2024年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	-20.33%	-21.38%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用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。

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

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

### 3.2 基金净值表现

#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中信建投量化进取A

阶段	份额净值	份额净值	业绩比较	业绩比较	①-③	②-④
----	------	------	------	------	-----	-----

	增长率①	增长率标准差②	基准收益率③	基准收益率标准差④		
过去一个月	-3.63%	0.89%	-5.37%	0.77%	1.74%	0.12%
过去三个月	-1.90%	0.95%	-4.84%	0.91%	2.94%	0.04%
过去六个月	-8.37%	1.37%	-6.30%	1.28%	-2.07%	0.09%
过去一年	-14.00%	1.05%	-13.07%	1.02%	-0.93%	0.03%
过去三年	-25.34%	1.14%	-19.61%	0.96%	-5.73%	0.18%
自基金合同生效起至今	-20.33%	1.09%	-13.67%	0.93%	-6.66%	0.16%

中信建投量化进取C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-3.65%	0.89%	-5.37%	0.77%	1.72%	0.12%
过去三个月	-1.99%	0.95%	-4.84%	0.91%	2.85%	0.04%
过去六个月	-8.55%	1.37%	-6.30%	1.28%	-2.25%	0.09%
过去一年	-14.35%	1.05%	-13.07%	1.02%	-1.28%	0.03%
过去三年	-26.23%	1.14%	-19.61%	0.96%	-6.62%	0.18%
自基金合同生效起至今	-21.38%	1.09%	-13.67%	0.93%	-7.71%	0.16%

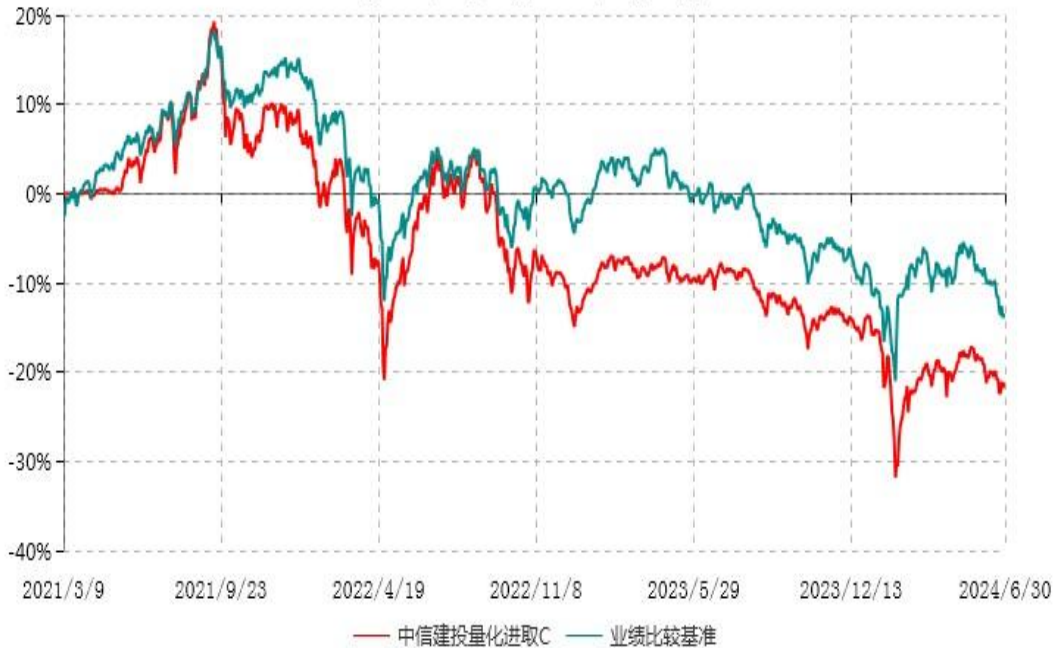
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



中信建投量化进取A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2021年03月09日-2024年06月30日)



中信建投量化进取C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2021年03月09日-2024年06月30日)



## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中信建投基金管理有限公司（以下简称“中信建投基金”）于2013年9月9日在北京成立，注册资本4.5亿元，中信建投证券股份有限公司全资控股。中信建投基金主要经营公开募集证券投资基金募集、销售、管理，特定客户资产管理以及中国证监会许可的其他业务。

截至报告期末，中信建投基金在管公募证券投资基金共57个。

中信建投基金以公募基金为业务本源，以专户业务为服务抓手，加强投研体系建设，注重核心投资人才的积累、培养，不断提升主动投资管理能力和风控能力。同时，中信建投基金加强客户体系建设，积极拓展渠道，加大与国有大行、股份制银行、证券公司以及保险机构的合作力度。中信建投基金各项业务有序开展，为进一步发展奠定了良好的基础。

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

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
王鹏	本基金的基金经理、指数与量化投资部行政负责人	2021-03-09	-	9年	中国籍，1984年8月生，哥伦比亚大学统计学硕士。曾任中财期货分析师、LCM Commodities研究员、CIBC World Market期权交易员、中金基金管理有限公司量化投资副总经理、中金睿投投资管理有限公司量化投资副总经理、中信建投证券股份有限公司量化投资总监。2019年2月加入中信建投基金管理有限公司，曾任权益投资部-指数与量化投资部负责人、总监，现任本公司指数与量化投资部行政负责人、基金经理，担任中信建投中证500指数增强型证券投资基金、中

					信建投量化进取6个月持有期混合型证券投资基金、中信建投量化精选6个月持有期混合型证券投资基金、中信建投中证1000指数增强型证券投资基金、中信建投沪深300指数增强型证券投资基金、中信建投红利智选混合型证券投资基金、中信建投量化选股股票型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

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

2、证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、基金合同和其他有关法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

Q1市场经历了两落两起：1月以来市场超预期下跌，雪球敲入、机构平仓等“负反馈调节”，市场极度恐慌。市场在经历了百股跌停后，受多重利好政策同时刺激短暂修复。随后，小盘股流动性挤兑继续加重，指数下探新低，2月5日出现千股跌停。在市场恐慌情绪充分释放后，伴随着一系列利好政策的推出与经济数据的边际改善，市场快速修复。

Q2市场由震荡到超预期上行再至快速下跌，风格切换，波动剧烈。4月初，市场依旧处于震荡整固阶段，主题投资盛行。5月市场受北向资金与地产政策推动，超预期上行。5月20日后，该阶段地产政策落地后，房价尚未出现显著改善，市场情绪有所回落，北向资金流入放缓，成交额维持低位，市场持续下跌。二季度后期，红利板块估值有所回升，行情演绎至中后期，市场更为强调稳定性，板块内部出现分化，电力板块显著占优。

全市场量化产品在一季度受微盘杀跌影响，发生踩踏，普遍超额回撤显著，本产品受踩踏影响，超额出现一定波动，团队及时做出调整，对策略进行了升级，降低了策略的同质化，同时加强了风险控制，收紧了投资组合在行业与市值等风险上相较于基准的偏离，二季度超额稳步回归。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中信建投量化进取A基金份额净值为0.7967元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-8.37%，同期业绩比较基准收益率为-6.30%；截至报告期末中信建投量化进取C基金份额净值为0.7862元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-8.55%，同期业绩比较基准收益率为-6.30%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从短期看，国内基本面疲弱，海外动荡期尚未确认完全结束，近期政策已经开始释放更多积极信号，但市场很可能还会观望实际落地力度与效果，在当前企业盈利预期下修，海外“动荡期”尚未结束，国内机构面临资产荒的背景下，以电力、电信运营商、国有大行、高速公路为代表的稳定红利类由于其防御性优势，后续表现仍然值得期待。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

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

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

## §5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对中信建投量化进取6个月持有期混合型证券投资基金2024年上半年的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

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

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

本托管人认为，中信建投基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的2024年中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

## §6 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：中信建投量化进取6个月持有期混合型证券投资基金

报告截止日：2024年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	46,501,313.14	62,505,397.40
结算备付金		48,247,875.38	48,053,357.70
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	378,388,809.00	444,469,731.69
其中：股票投资		378,388,809.00	444,029,925.71
基金投资		-	-
债券投资		-	439,805.98
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		8,932.17	16,008.49
递延所得税资产		-	-

其他资产		-	-
资产总计		473,146,929.69	555,044,495.28
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年06月30日</b>	<b>上年度末 2023年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		195,012.98	467,468.96
应付管理人报酬		472,895.36	565,518.48
应付托管费		78,815.91	94,253.07
应付销售服务费		33,737.88	42,121.34
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	7.63
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.5	132,314.23	180,000.00
负债合计		912,776.36	1,349,369.48
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.6	594,401,176.43	638,418,762.61
未分配利润	6.4.7.7	-122,167,023.10	-84,723,636.81
净资产合计		472,234,153.33	553,695,125.80
负债和净资产总计		473,146,929.69	555,044,495.28

注：报告截止日2024年06月30日，基金份额总额594,401,176.43份，其中A类基金份额净值0.7967元，基金份额465,792,774.73份；C类基金份额净值0.7862元，基金份额128,608,401.70份。

## 6.2 利润表

会计主体：中信建投量化进取6个月持有期混合型证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年01月01日至 2024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023 年06月30日
<b>一、营业总收入</b>		-42,189,089.17	42,723,883.79
1.利息收入		292,901.86	566,413.92
其中：存款利息收入	6.4.7.8	292,901.86	565,675.56
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		-	738.36
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-” 填列）		-30,604,642.31	26,698,309.31
其中：股票投资收益	6.4.7.9	-37,169,150.24	18,629,184.68
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.10	68,117.45	518,735.37
资产支持证券投资 收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.11	-	102,230.95
股利收益	6.4.7.12	6,496,390.48	7,448,158.31
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	6.4.7.13	-11,877,348.72	15,459,160.56
4.汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.14	-	-
<b>减：二、营业总支出</b>		3,761,034.15	6,123,855.72



1.管理人报酬	6.4.10.2.1	2,961,216.96	4,912,972.51
2.托管费	6.4.10.2.2	493,536.17	818,828.74
3.销售服务费	6.4.10.2.3	214,740.71	300,231.11
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	6.4.7.15	-	-
7.税金及附加		0.19	320.77
8.其他费用	6.4.7.16	91,540.12	91,502.59
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-45,950,123.32	36,600,028.07
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-45,950,123.32	36,600,028.07
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-45,950,123.32	36,600,028.07

### 6.3 净资产变动表

会计主体：中信建投量化进取6个月持有期混合型证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	638,418,762.61	-84,723,636.81	553,695,125.80
二、本期期初净资产	638,418,762.61	-84,723,636.81	553,695,125.80
三、本期增减变动额（减少以“-”号	-44,017,586.18	-37,443,386.29	-81,460,972.47

填列)			
(一)、综合收益总额	-	-45,950,123.32	-45,950,123.32
(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)	-44,017,586.18	8,506,737.03	-35,510,849.15
其中: 1.基金申购款	4,592,501.78	-885,406.56	3,707,095.22
2.基金赎回款	-48,610,087.96	9,392,143.59	-39,217,944.37
(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、本期期末净资产	594,401,176.43	-122,167,023.10	472,234,153.33
项目	上年度可比期间		
	2023年01月01日至2023年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	754,850,730.13	-94,100,444.24	660,750,285.89
二、本期期初净资产	754,850,730.13	-94,100,444.24	660,750,285.89
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-67,621,883.78	42,210,014.22	-25,411,869.56
(一)、综合收益总额	-	36,600,028.07	36,600,028.07
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资	-67,621,883.78	5,609,986.15	-62,011,897.63

产减少以“-”号填列)			
其中：1.基金申购款	4,228,413.08	-352,740.03	3,875,673.05
2.基金赎回款	-71,850,296.86	5,962,726.18	-65,887,570.68
(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、本期期末净资产	687,228,846.35	-51,890,430.02	635,338,416.33

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

黄凌

张欣宇

谭保民

-----

-----

-----

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

中信建投量化进取6个月持有期混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可(2021)127号《关于准予中信建投量化进取6个月持有期混合型证券投资基金注册的批复》核准,由中信建投基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中信建投量化进取6个月持有期混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金的运作方式为契约型开放式、最短持有期为6个月的单笔锁定持续运作,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币1,300,908,856.52元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2021)第0262号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《中信建投量化进取6个月持有期混合型证券投资基金基金合同》于2021年3月9日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,301,115,484.97份基金份额,其中认购资金利息折合206,628.45份基金份额。本基金的基金管理人为中信建投基金管理有限公司,基金托管人为中信银行股份有限公司。

根据《中信建投量化进取6个月持有期混合型证券投资基金招募说明书》,本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资

者认购、申购时收取认购、申购费用而不收取销售服务费，在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额，称为A类基金份额；从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取认购、申购费用，在赎回时根据持有期限收取赎回费用的基金份额，称为C类基金份额。本基金A类基金份额和C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中信建投量化进取6个月持有期混合型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（含中小板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、证券公司短期公司债券、次级债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、货币市场工具、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为：股票（含存托凭证）资产占基金资产的60%-95%；每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券；其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中证500指数收益率×80%+中证综合债指数收益率×20%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《中信建投量化进取6个月持有期混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2024年1月1日至2024年6月30日期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2024年6月30日的财务状况以及2024年1月1日至2024年6月30日期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2024年1月1日至2024年6月30日。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

###### (1) 金融资产

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

###### 1) 债务工具

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

###### ① 以摊余成本计量：

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

###### ② 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

###### 2) 权益工具

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

## (2)金融负债

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

## (3)衍生金融工具

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

### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产,以预期信用损失为基础确认损失准备。

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

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

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资 and 衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1)具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2)交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。对于已开放转换业务的基金，上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 6.4.4.8 损益平准金

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

#### 6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

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

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

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一基金份额类别内的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份



额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 6.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

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

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告〔2017〕13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标

准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

## 6.4.6 税项

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

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

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

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

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

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告2023年第39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日
活期存款	4,205,762.53
等于：本金	4,204,805.74
加：应计利息	956.79
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	42,295,550.61
等于：本金	42,291,407.42
加：应计利息	4,143.19

减：坏账准备	-
合计	46,501,313.14

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	390,847,432.80	-	378,388,809.00	-12,458,623.80
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	390,847,432.80	-	378,388,809.00	-12,458,623.80

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

### 6.4.7.4 买入返售金融资产

#### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

#### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

### 6.4.7.5 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日

应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	89,507.60
其他应付	42,806.63
合计	132,314.23

### 6.4.7.6 实收基金

#### 6.4.7.6.1 中信建投量化进取A

金额单位：人民币元

项目 (中信建投量化进取A)	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	496,010,603.97	496,010,603.97
本期申购	3,754,263.15	3,754,263.15
本期赎回（以“-”号填列）	-33,972,092.39	-33,972,092.39
本期末	465,792,774.73	465,792,774.73

#### 6.4.7.6.2 中信建投量化进取C

金额单位：人民币元

项目 (中信建投量化进取C)	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	142,408,158.64	142,408,158.64
本期申购	838,238.63	838,238.63
本期赎回（以“-”号填列）	-14,637,995.57	-14,637,995.57
本期末	128,608,401.70	128,608,401.70

### 6.4.7.7 未分配利润

#### 6.4.7.7.1 中信建投量化进取A

单位：人民币元

项目 (中信建投量化进取A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-60,669,740.53	-4,076,981.89	-64,746,722.42
本期期初	-60,669,740.53	-4,076,981.89	-64,746,722.42
本期利润	-26,259,312.54	-9,439,492.17	-35,698,804.71
本期基金份额交易产生的变动数	5,474,519.84	294,671.20	5,769,191.04
其中：基金申购款	-759,949.86	42,084.71	-717,865.15
基金赎回款	6,234,469.70	252,586.49	6,487,056.19
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-81,454,533.23	-13,221,802.86	-94,676,336.09

#### 6.4.7.7.2 中信建投量化进取C

单位：人民币元

项目 (中信建投量化进取C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-18,794,154.41	-1,182,759.98	-19,976,914.39
本期期初	-18,794,154.41	-1,182,759.98	-19,976,914.39
本期利润	-7,813,462.06	-2,437,856.55	-10,251,318.61
本期基金份额交易产生的变动数	2,743,174.29	-5,628.30	2,737,545.99
其中：基金申购款	-164,175.46	-3,365.95	-167,541.41
基金赎回款	2,907,349.75	-2,262.35	2,905,087.40
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-23,864,442.18	-3,626,244.83	-27,490,687.01

#### 6.4.7.8 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期

	2024年01月01日至2024年06月30日
活期存款利息收入	11,019.08
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	87,365.10
结算备付金利息收入	194,517.68
其他	-
合计	292,901.86

#### 6.4.7.9 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
卖出股票成交总额	1,745,907,488.30
减：卖出股票成本总额	1,780,157,880.37
减：交易费用	2,918,758.17
买卖股票差价收入	-37,169,150.24

#### 6.4.7.10 债券投资收益

##### 6.4.7.10.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
债券投资收益——利息收入	60.08
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	68,057.37
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	68,117.45

##### 6.4.7.10.2 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01月01日至2024年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	483,599.46
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	415,200.00
减：应计利息总额	321.26
减：交易费用	20.83
买卖债券差价收入	68,057.37

#### 6.4.7.11 衍生工具收益

无。

#### 6.4.7.12 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
股票投资产生的股利收益	6,496,390.48
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	6,496,390.48

#### 6.4.7.13 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
1.交易性金融资产	-11,877,348.72
——股票投资	-11,782,802.08
——债券投资	-94,546.64
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-



——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-11,877,348.72

#### 6.4.7.14 其他收入

无。

#### 6.4.7.15 信用减值损失

无。

#### 6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
审计费用	29,835.26
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
汇划手续费	2,032.52
合计	91,540.12

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无重大资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

**6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况**  
无。

**6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方**

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

**6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易**

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

**6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易**

**6.4.10.1.1 股票交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30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
中信建投证券股份有限公司	3,472,207,054.04	100.00%	4,266,641,532.46	100.00%

**6.4.10.1.2 权证交易**

无。

**6.4.10.1.3 债券交易**

金额单位：人民币元

关联方名	本期	上年度可比期间
------	----	---------

称	2024年01月01日至2024年06月30日		2023年01月01日至2023年06月30日	
	成交金额	占当期 债券买 卖成交 总额的 比例	成交金额	占当期 债券买 卖成交 总额的 比例
中信建投 证券股份 有限公司	483,599.46	100.00%	2,863,461.27	100.00%

#### 6.4.10.1.4 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名 称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30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
中信建投 证券股份 有限公司	-	-	2,000,000.00	100.00%

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名 称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日			
	当期佣金	占当期 佣金总 量的比 例	期末应付佣金余额	占期末应 付佣金总 额的比例
中信建投 证券股份	1,823,130.58	100.00%	-	-

有限公司				
关联方名称	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中信建投证券股份有限公司	2,243,889.82	100.00%	-	-

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024 年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至 2023年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,961,216.96	4,912,972.51
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,457,923.13	2,417,694.45
应支付基金管理人的净管理费	1,503,293.83	2,495,278.06

注：支付基金管理人中信建投基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：  
日管理人报酬=前一日基金资产净值×1.20%/当年天数。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024 年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023 年06月30日

当期发生的基金应支付的托管费	493,536.17	818,828.74
----------------	------------	------------

注：支付基金托管人中信银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值0.20%的费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.20%/当年天数。

### 6.4.10.2.3 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01月01日至2024年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中信建投量化进取A	中信建投量化进取C	合计
中信银行股份有限公司	0.00	2,420.66	2,420.66
中信建投基金管理有限公司	0.00	546.75	546.75
中信建投期货有限公司	0.00	29.12	29.12
中信建投证券股份有限公司	0.00	199,689.33	199,689.33
合计	0.00	202,685.86	202,685.86
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中信建投量化进取A	中信建投量化进取C	合计
中信建投基金管理有限公司	0.00	623.20	623.20
中信建投	0.00	279,729.95	279,729.95

证券股份 有限公司			
中信建投 期货有限 公司	0.00	33.04	33.04
中信银行 股份有限 公司	0.00	3,728.02	3,728.02
合计	0.00	284,114.21	284,114.21

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值0.40%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给中信建投基金管理有限公司，再由中信建投基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费=前一日C类的基金资产净值×0.40%/当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

##### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

#### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30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	4,205,762.53	11,019.08	4,104,224.95	121,467.54
中信建投	42,295,550.61	87,365.10	99,873,198.75	127,464.35

证券股份 有限公司				
--------------	--	--	--	--

注：本基金托管账户的存款由基金托管人中信银行股份有限公司保管，按约定利率计息。  
本基金证券资金账户的存款由中信建投证券股份有限公司保管，按约定利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张/股）	总金额
中信建投 证券股份 有限公司	301260	格力博	网下配售	13,012	401,420.20
中信建投 证券股份 有限公司	301358	湖南裕能	网下配售	9,426	224,056.02
中信建投 证券股份 有限公司	001337	四川黄金	网下配售	795	5,636.55

注：本基金本报告期不涉及在承销期内买入关联方承销证券的情况。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

#### 6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

无。

#### 6.4.12 期末（2024年06月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

### **6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**

#### **6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

无。

#### **6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

无。

### **6.4.13 金融工具风险及管理**

#### **6.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人的风险管理机构由董事会下属的公司风险控制与合规委员会、督察长、公司风险管理委员会、风险管理部以及各个业务部门组成。公司实行全面、系统的风险管理，风险管理覆盖公司所有战略环节、业务环节和操作环节。同时制定了系统化的风险管理程序，对风险管理的整个流程进行评估和改进。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制与合规委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面，由风险管理部负责协调并与各部门合作完成运作风险管理。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性和定量相结合的分析方法去评估各种风险发生的可能性及其发生可能给基金资产造成的损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### **6.4.13.2 信用风险**

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人及结算券商的证券账户，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易主要以中国证券登记结算有限责任公司为交易对



手完成证券交收和款项清算，违约可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无余额。

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无余额。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无余额。

#### 6.4.13.2.4 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06月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	-	-
AAA以下	-	439,805.98
未评级	-	-
合计	-	439,805.98

注：以上按长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无余额。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无余额。

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

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

于2024年6月30日，除附注6.4.12.3中列示的卖出回购金融资产款余额将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 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。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。于2024年6月30日，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变

现价值。于2024年6月30日，本基金确认的净赎回申请未超过7个工作日可变现资产的可变现价值。

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

#### 6.4.13.4 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。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年0 6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	46,501,313.14	-	-	-	46,501,313.14
结算备付金	48,247,875.38	-	-	-	48,247,875.38

交易性金融资产	-	-	-	378,388,809.00	378,388,809.00
应收申购款	-	-	-	8,932.17	8,932.17
资产总计	94,749,188.52	-	-	378,397,741.17	473,146,929.69
负债					
应付赎回款	-	-	-	195,012.98	195,012.98
应付管理人报酬	-	-	-	472,895.36	472,895.36
应付托管费	-	-	-	78,815.91	78,815.91
应付销售服务费	-	-	-	33,737.88	33,737.88
其他负债	-	-	-	132,314.23	132,314.23
负债总计	-	-	-	912,776.36	912,776.36
利率敏感度缺口	94,749,188.52	-	-	377,484,964.81	472,234,153.33
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	62,505,397.40	-	-	-	62,505,397.40
结算备付金	48,053,357.70	-	-	-	48,053,357.70
交易性金融资	-	-	439,805.98	444,029,925.71	444,469,731.69

产					
应收申购款	-	-	-	16,008.49	16,008.49
资产总计	110,558,755.10	-	439,805.98	444,045,934.20	555,044,495.28
负债					
应付赎回款	-	-	-	467,468.96	467,468.96
应付管理人报酬	-	-	-	565,518.48	565,518.48
应付托管费	-	-	-	94,253.07	94,253.07
应付销售服务费	-	-	-	42,121.34	42,121.34
应交税费	-	-	-	7.63	7.63
其他负债	-	-	-	180,000.00	180,000.00
负债总计	-	-	-	1,349,369.48	1,349,369.48
利率敏感度缺口	110,558,755.10	-	439,805.98	442,696,564.72	553,695,125.80

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。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2024年6月30日，考虑本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金净资产的比例，市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响（2023年12月31日：同）。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，通过量化分析，对宏观经济情况及市场行为进行分析，做出资产配置的决定；通过运用多因子分析模型和机器学习模型构建投资组合，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

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

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30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	378,388,809.00	80.13	444,029,925.71	80.19
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	439,805.98	0.08
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

合计	378,388,809.00	80.13	444,469,731.69	80.27
----	----------------	-------	----------------	-------

#### 6.4.13.4.3.2 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06月30日	上年度末 2023年12月31日
	业绩比较基准上升5%	18,625,630.00	22,522,883.77
	业绩比较基准下降5%	-18,625,630.00	-22,522,883.77

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 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06月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	378,388,809.00	444,469,731.69
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	378,388,809.00	444,469,731.69

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期

间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票、债券和基金的公允价值应属第二层次还是第三层次。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2024年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2023年12月31日：同)。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## §7 投资组合报告

### 7.1 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	378,388,809.00	79.97
	其中：股票	378,388,809.00	79.97
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	94,749,188.52	20.03



8	其他各项资产	8,932.17	0.00
9	合计	473,146,929.69	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	33,814,587.00	7.16
C	制造业	201,103,881.00	42.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,588,283.00	1.82
E	建筑业	7,665,632.00	1.62
F	批发和零售业	6,574,248.00	1.39
G	交通运输、仓储和邮政业	15,932,845.00	3.37
H	住宿和餐饮业	564,200.00	0.12
I	信息传输、软件和信息技术服务业	23,401,785.00	4.96
J	金融业	44,438,344.00	9.41
K	房地产业	5,443,140.00	1.15
L	租赁和商务服务业	8,771,190.00	1.86
M	科学研究和技术服务业	1,295,539.00	0.27
N	水利、环境和公共设施管理业	4,550,622.00	0.96
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	572,220.00	0.12
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	14,510,915.00	3.07
S	综合	1,161,378.00	0.25
	合计	378,388,809.00	80.13

### 7.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无余额。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002128	电投能源	179,400	3,785,340.00	0.80
2	601328	交通银行	442,100	3,302,487.00	0.70
3	601088	中国神华	72,100	3,199,077.00	0.68
4	601229	上海银行	435,400	3,161,004.00	0.67
5	600282	南钢股份	618,400	3,079,632.00	0.65
6	600019	宝钢股份	452,500	3,009,125.00	0.64
7	601098	中南传媒	234,800	2,916,216.00	0.62
8	601019	山东出版	244,000	2,884,080.00	0.61
9	601077	渝农商行	573,000	2,876,460.00	0.61
10	000830	鲁西化工	240,000	2,781,600.00	0.59
11	600755	厦门国贸	387,600	2,779,092.00	0.59
12	601288	农业银行	628,700	2,741,132.00	0.58
13	600398	海澜之家	291,700	2,695,308.00	0.57
14	600971	恒源煤电	224,400	2,679,336.00	0.57
15	601225	陕西煤业	100,300	2,584,731.00	0.55
16	600642	申能股份	292,400	2,581,892.00	0.55
17	600350	山东高速	290,000	2,566,500.00	0.54
18	002601	龙佰集团	138,100	2,564,517.00	0.54
19	601169	北京银行	431,200	2,518,208.00	0.53
20	601166	兴业银行	142,600	2,512,612.00	0.53
21	600985	淮北矿业	150,000	2,511,000.00	0.53
22	600177	雅戈尔	351,100	2,499,832.00	0.53
23	000651	格力电器	63,000	2,470,860.00	0.52
24	600901	江苏金租	486,500	2,456,825.00	0.52
25	600188	兖矿能源	107,700	2,448,021.00	0.52
26	600012	皖通高速	174,500	2,437,765.00	0.52
27	600919	江苏银行	325,800	2,420,694.00	0.51

28	600028	中国石化	370,300	2,340,296.00	0.50
29	601006	大秦铁路	325,900	2,333,444.00	0.49
30	600064	南京高科	383,600	2,328,452.00	0.49
31	600585	海螺水泥	95,900	2,262,281.00	0.48
32	601666	平煤股份	198,800	2,226,560.00	0.47
33	000157	中联重科	289,800	2,225,664.00	0.47
34	601928	凤凰传媒	201,600	2,209,536.00	0.47
35	601000	唐山港	468,400	2,201,480.00	0.47
36	600546	山煤国际	150,500	2,200,310.00	0.47
37	600015	华夏银行	338,900	2,168,960.00	0.46
38	601818	光大银行	651,600	2,065,572.00	0.44
39	002048	宁波华翔	155,000	2,005,700.00	0.42
40	601988	中国银行	427,800	1,976,436.00	0.42
41	600000	浦发银行	239,000	1,966,970.00	0.42
42	600057	厦门象屿	280,300	1,906,040.00	0.40
43	601668	中国建筑	355,900	1,889,829.00	0.40
44	600373	中文传媒	123,200	1,828,288.00	0.39
45	601699	潞安环能	96,400	1,747,732.00	0.37
46	600377	宁沪高速	135,200	1,703,520.00	0.36
47	600704	物产中大	382,900	1,661,786.00	0.35
48	601857	中国石油	154,500	1,594,440.00	0.34
49	601997	贵阳银行	301,800	1,590,486.00	0.34
50	601009	南京银行	149,400	1,552,266.00	0.33
51	601398	工商银行	258,300	1,472,310.00	0.31
52	601601	中国太保	52,800	1,471,008.00	0.31
53	601636	旗滨集团	226,800	1,462,860.00	0.31
54	002416	爱施德	158,500	1,402,725.00	0.30
55	600048	保利发展	150,800	1,321,008.00	0.28
56	000983	山西焦煤	122,400	1,261,944.00	0.27
57	601939	建设银行	170,300	1,260,220.00	0.27
58	600295	鄂尔多斯	126,300	1,252,896.00	0.27

59	600325	华发股份	188,200	1,223,300.00	0.26
60	600782	新钢股份	364,100	1,208,812.00	0.26
61	600016	民生银行	317,400	1,202,946.00	0.25
62	600219	南山铝业	310,800	1,184,148.00	0.25
63	002782	可立克	106,500	1,180,020.00	0.25
64	002273	水晶光电	69,400	1,178,412.00	0.25
65	002139	拓邦股份	110,300	1,171,386.00	0.25
66	300679	电连技术	28,900	1,162,647.00	0.25
67	000532	华金资本	96,300	1,161,378.00	0.25
68	000725	京东方A	283,600	1,159,924.00	0.25
69	000551	创元科技	132,800	1,159,344.00	0.25
70	605365	立达信	73,000	1,158,510.00	0.25
71	002026	山东威达	139,500	1,157,850.00	0.25
72	300207	欣旺达	76,300	1,157,471.00	0.25
73	600660	福耀玻璃	24,100	1,154,390.00	0.24
74	600480	凌云股份	116,900	1,149,127.00	0.24
75	000703	恒逸石化	161,900	1,147,871.00	0.24
76	300707	威唐工业	92,500	1,145,150.00	0.24
77	002422	科伦药业	37,500	1,137,375.00	0.24
78	002642	荣联科技	220,100	1,135,716.00	0.24
79	000786	北新建材	38,200	1,133,012.00	0.24
80	300846	首都在线	120,900	1,131,624.00	0.24
81	603039	泛微网络	35,600	1,130,656.00	0.24
82	000546	金圆股份	281,500	1,128,815.00	0.24
83	002705	新宝股份	80,200	1,128,414.00	0.24
84	002858	力盛体育	107,900	1,122,160.00	0.24
85	688516	奥特维	26,700	1,116,327.00	0.24
86	002110	三钢闽光	373,400	1,101,530.00	0.23
87	688606	奥泰生物	23,000	1,083,990.00	0.23
88	600153	建发股份	118,700	1,059,991.00	0.22
89	600273	嘉化能源	137,600	982,464.00	0.21

90	600997	开滦股份	141,100	967,946.00	0.20
91	002088	鲁阳节能	74,200	897,078.00	0.19
92	002233	塔牌集团	122,700	896,937.00	0.19
93	603565	中谷物流	95,700	836,418.00	0.18
94	600873	梅花生物	80,300	804,606.00	0.17
95	600269	赣粤高速	150,600	778,602.00	0.16
96	600820	隧道股份	118,600	774,458.00	0.16
97	600801	华新水泥	55,600	764,500.00	0.16
98	600674	川投能源	40,600	761,250.00	0.16
99	600461	洪城环境	64,500	746,910.00	0.16
100	601216	君正集团	200,400	739,476.00	0.16
101	600757	长江传媒	89,400	720,564.00	0.15
102	601318	中国平安	16,900	698,984.00	0.15
103	601163	三角轮胎	45,000	684,900.00	0.15
104	002267	陕天然气	90,500	684,180.00	0.14
105	002701	奥瑞金	163,500	680,160.00	0.14
106	000932	华菱钢铁	152,600	676,018.00	0.14
107	000598	兴蓉环境	89,800	675,296.00	0.14
108	600170	上海建工	313,300	673,595.00	0.14
109	600050	中国联通	141,500	665,050.00	0.14
110	002788	鹭燕医药	84,100	662,708.00	0.14
111	601800	中国交建	72,900	651,726.00	0.14
112	002027	分众传媒	107,100	649,026.00	0.14
113	601633	长城汽车	25,500	645,150.00	0.14
114	600008	首创环保	237,800	637,304.00	0.13
115	000338	潍柴动力	39,100	634,984.00	0.13
116	000709	河钢股份	326,400	633,216.00	0.13
117	688036	传音控股	8,000	612,320.00	0.13
118	300968	格林精密	65,300	604,678.00	0.13
119	688510	航亚科技	32,500	598,325.00	0.13
120	002249	大洋电机	126,400	597,872.00	0.13

121	301067	显盈科技	30,300	597,213.00	0.13
122	000027	深圳能源	81,700	596,410.00	0.13
123	000960	锡业股份	38,500	596,365.00	0.13
124	600114	东睦股份	41,400	595,746.00	0.13
125	600575	淮河能源	153,000	595,170.00	0.13
126	601616	广电电气	204,300	594,513.00	0.13
127	300120	经纬辉开	114,500	594,255.00	0.13
128	603890	春秋电子	65,500	593,430.00	0.13
129	002248	华东数控	99,000	593,010.00	0.13
130	601369	陕鼓动力	73,900	592,678.00	0.13
131	002745	木林森	73,500	592,410.00	0.13
132	600875	东方电气	32,100	592,245.00	0.13
133	300743	天地数码	43,700	591,698.00	0.13
134	000975	银泰黄金	36,300	591,327.00	0.13
135	002876	三利谱	24,500	590,940.00	0.13
136	600237	铜峰电子	113,200	590,904.00	0.13
137	688678	福立旺	54,500	590,235.00	0.12
138	688525	佰维存储	9,200	590,180.00	0.12
139	601600	中国铝业	77,200	589,036.00	0.12
140	688169	石头科技	1,500	588,900.00	0.12
141	301011	华立科技	38,200	588,662.00	0.12
142	002008	大族激光	28,300	588,640.00	0.12
143	002975	博杰股份	19,700	588,636.00	0.12
144	002106	莱宝高科	54,000	588,600.00	0.12
145	300389	艾比森	47,900	588,212.00	0.12
146	603993	洛阳钼业	69,200	588,200.00	0.12
147	002369	卓翼科技	159,300	587,817.00	0.12
148	002993	奥海科技	15,800	587,760.00	0.12
149	300857	协创数据	10,300	587,100.00	0.12
150	002036	联创电子	86,900	586,575.00	0.12
151	002933	新兴装备	25,600	586,496.00	0.12

152	000636	风华高科	44,900	586,394.00	0.12
153	605218	伟时电子	36,300	586,245.00	0.12
154	002045	国光电器	43,000	586,090.00	0.12
155	600489	中金黄金	39,600	586,080.00	0.12
156	002879	长缆科技	44,600	585,598.00	0.12
157	002532	天山铝业	72,200	585,542.00	0.12
158	600183	生益科技	27,800	585,468.00	0.12
159	300410	正业科技	114,300	585,216.00	0.12
160	688028	沃尔德	35,600	584,908.00	0.12
161	300566	激智科技	41,800	584,782.00	0.12
162	601669	中国电建	104,600	584,714.00	0.12
163	002111	威海广泰	56,100	584,562.00	0.12
164	601101	昊华能源	63,600	584,484.00	0.12
165	300900	广联航空	31,200	584,376.00	0.12
166	002979	雷赛智能	32,100	584,220.00	0.12
167	300708	聚灿光电	64,900	584,100.00	0.12
168	002282	博深股份	91,400	584,046.00	0.12
169	300433	蓝思科技	32,000	584,000.00	0.12
170	688123	聚辰股份	9,600	583,968.00	0.12
171	002476	宝莫股份	159,100	583,897.00	0.12
172	000050	深天马A	80,200	583,856.00	0.12
173	002046	国机精工	57,400	583,758.00	0.12
174	300394	天孚通信	6,600	583,572.00	0.12
175	688237	超卓航科	29,100	583,455.00	0.12
176	688216	气派科技	32,700	583,368.00	0.12
177	603986	兆易创新	6,100	583,282.00	0.12
177	002204	大连重工	136,600	583,282.00	0.12
179	300652	雷迪克	29,400	583,002.00	0.12
180	688132	邦彦技术	33,600	582,960.00	0.12
181	002137	实益达	122,400	582,624.00	0.12
182	600970	中材国际	48,300	582,498.00	0.12

183	688338	赛科希德	26,900	582,385.00	0.12
184	603380	易德龙	29,000	582,320.00	0.12
184	002003	伟星股份	46,400	582,320.00	0.12
186	300976	达瑞电子	12,700	582,295.00	0.12
187	688018	乐鑫科技	5,900	582,212.00	0.12
188	002058	威尔泰	76,600	582,160.00	0.12
189	600320	振华重工	170,200	582,084.00	0.12
190	301280	珠城科技	15,000	582,000.00	0.12
191	002519	银河电子	118,500	581,835.00	0.12
192	002475	立讯精密	14,800	581,788.00	0.12
193	300677	英科医疗	21,700	581,777.00	0.12
194	300472	新元科技	131,300	581,659.00	0.12
195	688401	路维光电	22,200	581,640.00	0.12
196	688448	磁谷科技	30,800	581,504.00	0.12
197	002189	中光学	41,700	581,298.00	0.12
198	300870	欧陆通	13,400	581,292.00	0.12
199	002351	漫步者	44,200	581,230.00	0.12
200	001210	金房能源	43,800	581,226.00	0.12
201	300048	合康新能	125,500	581,065.00	0.12
202	001234	泰慕士	34,200	581,058.00	0.12
203	601868	中国能建	273,900	580,668.00	0.12
204	300950	德固特	38,100	580,644.00	0.12
205	603088	宁波精达	77,100	580,563.00	0.12
206	300502	新易盛	5,500	580,525.00	0.12
207	600547	山东黄金	21,200	580,456.00	0.12
208	603727	博迈科	44,100	580,356.00	0.12
209	301157	华塑科技	17,800	580,280.00	0.12
209	002724	海洋王	130,400	580,280.00	0.12
211	300810	中科海讯	37,900	580,249.00	0.12
212	688011	新光光电	38,300	580,245.00	0.12
213	003015	日久光电	63,900	580,212.00	0.12



213	002079	苏州固锴	68,100	580,212.00	0.12
215	002380	科远智慧	31,700	580,110.00	0.12
216	002237	恒邦股份	50,400	580,104.00	0.12
217	688150	莱特光电	29,900	580,060.00	0.12
218	688233	神工股份	30,100	580,027.00	0.12
219	002884	凌霄泵业	30,200	579,840.00	0.12
220	002536	飞龙股份	60,900	579,768.00	0.12
221	301032	新柴股份	86,400	579,744.00	0.12
222	301028	东亚机械	66,100	579,697.00	0.12
223	300710	万隆光电	38,200	579,494.00	0.12
224	002241	歌尔股份	29,700	579,447.00	0.12
225	301007	德迈仕	49,600	579,328.00	0.12
226	000100	TCL科技	134,100	579,312.00	0.12
227	300837	浙矿股份	27,900	579,204.00	0.12
228	601677	明泰铝业	50,100	579,156.00	0.12
229	603897	长城科技	33,000	579,150.00	0.12
230	300308	中际旭创	4,200	579,096.00	0.12
231	002387	维信诺	95,200	578,816.00	0.12
232	002540	亚太科技	109,400	578,726.00	0.12
233	605068	明新旭腾	43,900	578,602.00	0.12
234	300176	派生科技	131,200	578,592.00	0.12
235	002722	物产金轮	51,200	578,560.00	0.12
236	603299	苏盐井神	60,900	578,550.00	0.12
236	600871	石化油服	332,500	578,550.00	0.12
236	002203	海亮股份	72,500	578,550.00	0.12
239	603568	伟明环保	28,100	578,298.00	0.12
240	000856	冀东装备	95,100	578,208.00	0.12
241	002236	大华股份	37,400	578,204.00	0.12
242	002352	顺丰控股	16,200	578,178.00	0.12
243	603859	能科科技	27,500	578,050.00	0.12
244	603031	安孚科技	25,600	578,048.00	0.12

245	000727	冠捷科技	280,600	578,036.00	0.12
246	002415	海康威视	18,700	578,017.00	0.12
247	601900	南方传媒	46,500	577,995.00	0.12
248	000060	中金岭南	136,300	577,912.00	0.12
249	688317	之江生物	40,100	577,841.00	0.12
250	603629	利通电子	31,300	577,798.00	0.12
251	002392	北京利尔	183,400	577,710.00	0.12
252	603507	振江股份	17,600	577,632.00	0.12
253	300230	永利股份	171,900	577,584.00	0.12
254	003019	宸展光电	22,800	577,524.00	0.12
255	601916	浙商银行	209,200	577,392.00	0.12
256	688008	澜起科技	10,100	577,316.00	0.12
257	300140	节能环保	96,700	577,299.00	0.12
258	002298	中电兴发	130,600	577,252.00	0.12
259	600299	安迪苏	59,500	577,150.00	0.12
260	601038	一拖股份	36,500	577,065.00	0.12
261	300694	蠡湖股份	67,800	576,978.00	0.12
262	603015	弘讯科技	76,300	576,828.00	0.12
262	002209	达意隆	75,600	576,828.00	0.12
264	300866	安克创新	8,100	576,801.00	0.12
265	001206	依依股份	44,300	576,786.00	0.12
266	002463	沪电股份	15,800	576,700.00	0.12
267	600115	中国东航	143,800	576,638.00	0.12
268	688590	新致软件	44,700	576,630.00	0.12
269	002787	华源控股	85,300	576,628.00	0.12
270	600703	三安光电	49,200	576,624.00	0.12
271	000065	北方国际	55,600	576,572.00	0.12
272	603189	网达软件	52,700	576,538.00	0.12
273	603501	韦尔股份	5,800	576,346.00	0.12
274	603161	科华控股	38,500	576,345.00	0.12
275	688686	奥普特	9,000	576,270.00	0.12

276	688002	睿创微纳	20,600	576,182.00	0.12
277	600152	维科技术	120,000	576,000.00	0.12
277	002047	宝鹰股份	400,000	576,000.00	0.12
277	002001	新和成	30,000	576,000.00	0.12
280	603985	恒润股份	48,400	575,960.00	0.12
281	688367	工大高科	47,200	575,840.00	0.12
282	600727	鲁北化工	91,400	575,820.00	0.12
283	002371	北方华创	1,800	575,802.00	0.12
284	600475	华光环能	66,100	575,731.00	0.12
285	000951	中国重汽	40,200	575,664.00	0.12
286	001203	大中矿业	59,900	575,639.00	0.12
287	300258	精锻科技	70,800	575,604.00	0.12
288	300634	彩讯股份	34,200	575,586.00	0.12
289	301065	本立科技	36,200	575,580.00	0.12
290	688253	英诺特	15,100	575,461.00	0.12
291	002091	江苏国泰	84,500	575,445.00	0.12
292	600426	华鲁恒升	21,600	575,424.00	0.12
293	600688	上海石化	220,400	575,244.00	0.12
294	300441	鲍斯股份	97,000	575,210.00	0.12
295	605378	野马电池	37,300	575,166.00	0.12
296	688329	艾隆科技	38,700	575,082.00	0.12
297	603681	永冠新材	45,100	575,025.00	0.12
298	002517	恺英网络	60,200	574,910.00	0.12
299	688136	科兴制药	34,300	574,868.00	0.12
300	002020	京新药业	54,900	574,803.00	0.12
301	000001	平安银行	56,600	574,490.00	0.12
302	301056	森赫股份	74,900	574,483.00	0.12
303	300194	福安药业	153,600	574,464.00	0.12
304	002686	亿利达	137,100	574,449.00	0.12
305	002215	诺普信	77,100	574,395.00	0.12
306	688355	明志科技	42,800	574,376.00	0.12

307	002205	国统股份	91,600	574,332.00	0.12
308	002064	华峰化学	80,100	574,317.00	0.12
309	300226	上海钢联	33,900	574,266.00	0.12
310	002152	广电运通	54,900	574,254.00	0.12
311	603017	中衡设计	64,800	574,128.00	0.12
312	603790	雅运股份	59,800	574,080.00	0.12
313	688056	莱伯泰科	25,900	573,944.00	0.12
313	002465	海格通信	55,400	573,944.00	0.12
315	000920	沃顿科技	78,300	573,939.00	0.12
316	300247	融捷健康	236,100	573,723.00	0.12
317	688229	博睿数据	22,300	573,556.00	0.12
317	603421	鼎信通讯	128,600	573,556.00	0.12
319	600699	均胜电子	38,700	573,534.00	0.12
320	605069	正和生态	93,400	573,476.00	0.12
320	300381	溢多利	93,400	573,476.00	0.12
322	603683	晶华新材	72,200	573,268.00	0.12
323	603348	文灿股份	20,700	573,183.00	0.12
324	000810	创维数字	66,800	573,144.00	0.12
325	002558	巨人网络	60,700	573,008.00	0.12
326	600860	京城股份	71,000	572,970.00	0.12
327	603177	德创环保	81,500	572,945.00	0.12
328	000538	云南白药	11,200	572,880.00	0.12
329	002362	汉王科技	34,400	572,760.00	0.12
330	001209	洪兴股份	41,500	572,700.00	0.12
331	300409	道氏技术	66,900	572,664.00	0.12
332	002403	爱仕达	86,500	572,630.00	0.12
333	300076	GQY视讯	178,900	572,480.00	0.12
334	002645	华宏科技	90,000	572,400.00	0.12
335	600535	天士力	45,500	572,390.00	0.12
336	002649	博彦科技	71,900	572,324.00	0.12
337	300535	达威股份	48,500	572,300.00	0.12

337	300253	卫宁健康	97,000	572,300.00	0.12
339	002607	中公教育	374,000	572,220.00	0.12
340	001256	炜冈科技	41,700	572,124.00	0.12
341	300687	赛意信息	41,100	572,112.00	0.12
342	688528	秦川物联	71,600	572,084.00	0.12
343	603385	惠达卫浴	104,200	572,058.00	0.12
344	002256	兆新股份	429,900	571,767.00	0.12
345	002426	胜利精密	361,800	571,644.00	0.12
346	688201	信安世纪	48,400	571,604.00	0.12
347	002399	海普瑞	65,900	571,353.00	0.12
348	688371	菲沃泰	56,900	571,276.00	0.12
349	301299	卓创资讯	13,600	571,200.00	0.12
350	688178	万德斯	55,400	571,174.00	0.12
351	002916	深南电路	5,400	571,158.00	0.12
352	002988	豪美新材	37,200	571,020.00	0.12
353	002984	森麒麟	23,700	570,933.00	0.12
354	000949	新乡化纤	167,900	570,860.00	0.12
355	600348	华阳股份	57,300	570,708.00	0.12
356	688273	麦澜德	28,820	570,636.00	0.12
357	688296	和达科技	58,700	570,564.00	0.12
358	600603	广汇物流	113,200	570,528.00	0.12
359	000913	钱江摩托	36,200	570,512.00	0.12
360	688350	富淼科技	50,000	570,500.00	0.12
361	301043	绿岛风	23,900	570,493.00	0.12
362	000042	中洲控股	144,400	570,380.00	0.12
363	300842	帝科股份	14,700	570,360.00	0.12
363	002633	申科股份	97,000	570,360.00	0.12
365	603355	莱克电气	26,400	570,240.00	0.12
366	600186	莲花控股	166,200	570,066.00	0.12
367	301003	江苏博云	26,500	570,015.00	0.12
368	000701	厦门信达	152,400	569,976.00	0.12

369	002790	瑞尔特	63,100	569,793.00	0.12
370	600243	青海华鼎	211,800	569,742.00	0.12
371	002035	华帝股份	91,400	569,422.00	0.12
372	300673	佩蒂股份	43,400	569,408.00	0.12
373	000513	丽珠集团	15,300	569,313.00	0.12
374	603655	朗博科技	38,400	569,088.00	0.12
375	300999	金龙鱼	20,800	568,880.00	0.12
376	601865	福莱特	28,300	568,830.00	0.12
377	601888	中国中免	9,100	568,659.00	0.12
378	301066	万事利	70,200	568,620.00	0.12
379	688228	开普云	14,900	568,584.00	0.12
380	300113	顺网科技	55,500	568,320.00	0.12
381	601689	拓普集团	10,600	568,266.00	0.12
382	000030	富奥股份	115,700	568,087.00	0.12
383	000710	贝瑞基因	79,100	567,938.00	0.12
384	300442	润泽科技	23,700	567,615.00	0.12
385	300782	卓胜微	7,300	567,502.00	0.12
386	002752	昇兴股份	112,100	567,226.00	0.12
387	300841	康华生物	11,200	567,168.00	0.12
388	002739	万达电影	46,900	567,021.00	0.12
389	301236	软通动力	16,100	566,881.00	0.12
390	002620	瑞和股份	231,300	566,685.00	0.12
391	603999	读者传媒	119,800	566,654.00	0.12
392	002557	洽洽食品	20,100	566,619.00	0.12
393	605180	华生科技	47,800	566,430.00	0.12
394	002326	永太科技	72,400	566,168.00	0.12
395	600909	华安证券	134,400	565,824.00	0.12
396	688480	赛恩斯	20,300	565,558.00	0.12
397	300453	三鑫医疗	88,500	565,515.00	0.12
398	300451	创业慧康	163,400	565,364.00	0.12
399	300380	安硕信息	36,800	565,248.00	0.12

400	002212	天融信	116,000	564,920.00	0.12
401	300379	东方通	69,900	564,792.00	0.12
402	605088	冠盛股份	27,100	564,764.00	0.12
403	688369	致远互联	35,900	564,707.00	0.12
404	300973	立高食品	20,100	564,609.00	0.12
405	300783	三只松鼠	25,800	564,246.00	0.12
406	301073	君亭酒店	31,000	564,200.00	0.12
407	688023	安恒信息	14,100	564,141.00	0.12
408	688232	新点软件	28,600	563,992.00	0.12
409	688095	福昕软件	12,300	563,463.00	0.12
410	601108	财通证券	85,200	563,172.00	0.12
411	000892	欢瑞世纪	225,000	562,500.00	0.12
412	300915	海融科技	21,500	562,010.00	0.12
413	601555	东吴证券	95,200	561,680.00	0.12
414	300091	金通灵	480,000	561,600.00	0.12
415	300266	兴源环境	484,000	561,440.00	0.12
416	600556	天下秀	154,200	561,288.00	0.12
417	300482	万孚生物	23,000	561,200.00	0.12
418	002638	勤上股份	376,500	560,985.00	0.12
419	600739	辽宁成大	67,000	560,790.00	0.12
420	300369	绿盟科技	109,700	560,567.00	0.12
421	300969	恒帅股份	8,100	559,953.00	0.12
422	002570	贝因美	239,000	559,260.00	0.12
423	002043	兔宝宝	53,900	558,943.00	0.12
424	000592	平潭发展	429,900	558,870.00	0.12
425	603729	龙韵股份	42,100	558,246.00	0.12
426	002291	遥望科技	129,600	557,280.00	0.12
427	300251	光线传媒	66,100	555,901.00	0.12
428	300242	佳云科技	332,600	555,442.00	0.12
429	603201	常润股份	22,900	554,180.00	0.12
430	000826	启迪环境	400,000	552,000.00	0.12

431	002737	葵花药业	23,500	549,430.00	0.12
432	300005	探路者	109,400	548,094.00	0.12
433	002065	东华软件	121,100	547,372.00	0.12
434	688111	金山办公	2,400	546,000.00	0.12
435	002661	克明食品	73,000	545,310.00	0.12
436	600039	四川路桥	67,900	535,731.00	0.11
437	002635	安洁科技	31,600	487,904.00	0.10
438	600389	江山股份	31,300	441,643.00	0.09
439	002066	瑞泰科技	55,200	438,840.00	0.09
440	001965	招商公路	34,000	403,240.00	0.09
441	601838	成都银行	20,200	306,838.00	0.06
442	002807	江阴银行	72,400	272,948.00	0.06
443	002327	富安娜	26,300	264,315.00	0.06
444	002030	达安基因	47,400	237,000.00	0.05
445	002966	苏州银行	31,100	233,250.00	0.05
446	000821	京山轻机	19,800	224,334.00	0.05
447	600036	招商银行	6,500	222,235.00	0.05
448	601577	长沙银行	26,500	216,770.00	0.05
449	600887	伊利股份	8,200	211,888.00	0.04
450	603323	苏农银行	43,200	207,792.00	0.04
451	601658	邮储银行	39,800	201,786.00	0.04
452	600900	长江电力	6,400	185,088.00	0.04
453	600886	国投电力	10,000	182,400.00	0.04
454	002839	张家港行	42,700	171,654.00	0.04
455	600098	广州发展	25,700	164,480.00	0.03
456	600908	无锡银行	30,900	164,388.00	0.03
457	600035	楚天高速	36,700	157,443.00	0.03
458	601766	中国中车	20,600	154,706.00	0.03
459	603357	设计总院	16,700	153,473.00	0.03
460	688009	中国通号	25,000	150,000.00	0.03
461	600479	千金药业	13,300	135,261.00	0.03



462	601390	中国中铁	19,900	129,748.00	0.03
463	600790	轻纺城	37,400	120,428.00	0.03
464	601186	中国铁建	14,000	119,980.00	0.03
465	600368	五洲交通	32,700	116,739.00	0.02
466	601985	中国核电	10,500	111,930.00	0.02
467	000528	柳工	9,900	110,781.00	0.02
468	000685	中山公用	15,000	108,150.00	0.02
469	601211	国泰君安	7,700	104,335.00	0.02
470	002393	力生制药	5,800	91,698.00	0.02
471	002753	永东股份	15,600	90,636.00	0.02
472	600332	白云山	2,900	85,057.00	0.02
473	603367	辰欣药业	6,000	83,640.00	0.02
474	600987	航民股份	11,400	80,484.00	0.02
475	000726	鲁泰A	12,100	80,102.00	0.02
476	002736	国信证券	9,000	78,210.00	0.02
477	600104	上汽集团	5,600	77,616.00	0.02
478	601018	宁波港	22,700	77,180.00	0.02

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 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	002601	龙佰集团	7,544,160.00	1.36
2	600019	宝钢股份	6,787,307.02	1.23
3	600546	山煤国际	6,675,650.00	1.21
4	600971	恒源煤电	6,169,287.00	1.11
5	600985	淮北矿业	6,039,787.00	1.09
6	002830	名雕股份	5,943,485.00	1.07
7	000651	格力电器	5,843,569.00	1.06

8	601225	陕西煤业	5,837,800.00	1.05
9	601328	交通银行	5,791,720.00	1.05
10	601886	江河集团	5,766,433.00	1.04
11	002128	电投能源	5,754,295.00	1.04
12	601699	潞安环能	5,734,970.00	1.04
13	601009	南京银行	5,727,011.00	1.03
14	601666	平煤股份	5,699,925.28	1.03
15	600919	江苏银行	5,591,692.00	1.01
16	601088	中国神华	5,591,614.00	1.01
17	688798	艾为电子	5,577,748.11	1.01
18	601166	兴业银行	5,512,233.00	1.00
19	000830	鲁西化工	5,482,240.00	0.99
20	600188	兖矿能源	5,364,217.00	0.97

#### 7.4.2 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	600153	建发股份	8,006,740.00	1.45
2	601000	唐山港	7,073,486.00	1.28
3	601857	中国石油	6,445,590.00	1.16
4	601019	山东出版	6,232,953.00	1.13
5	688798	艾为电子	6,158,097.16	1.11
6	300947	德必集团	6,146,983.05	1.11
7	688168	安博通	6,052,373.59	1.09
8	300870	欧陆通	5,912,321.20	1.07
9	603221	爱丽家居	5,899,225.00	1.07
10	601886	江河集团	5,583,707.00	1.01
11	605007	五洲特纸	5,560,399.00	1.00
12	600398	海澜之家	5,422,208.00	0.98

13	002830	名雕股份	5,363,670.00	0.97
14	688072	拓荆科技	5,184,738.72	0.94
15	688153	唯捷创芯	5,103,356.50	0.92
16	001309	德明利	5,103,255.00	0.92
17	002615	哈尔斯	5,057,848.00	0.91
18	002601	龙佰集团	4,910,875.00	0.89
19	300922	天秦装备	4,841,490.00	0.87
20	300854	中兰环保	4,778,886.00	0.86

### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,726,299,565.74
卖出股票收入（成交）总额	1,745,907,488.30

### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无余额。

### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

无余额。

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

无余额。

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

无余额。

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

无余额。

### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

无。

## 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体中，交通银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局的处罚，上海银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到国家金融监督管理总局上海监管局、国家外汇管理局上海市分局的处罚，重庆农村商业银行股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到重庆市江北区市场监管局的处罚，鲁西化工集团股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到聊城市高新区应急管理局的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规、基金合同及公司制度的规定。除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 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。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	8,932.17
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,932.17

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无余额。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

无余额。

### 7.12.6 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。

## §8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
中信建投量化进取A	8,967	51,945.22	6,677,528.00	1.4336%	459,115,246.73	98.5664%
中信建投量化进取C	2,752	46,732.70	927,647.67	0.7213%	127,680,754.03	99.2787%
合计	11,571	51,369.91	7,605,175.67	1.2795%	586,796,000.76	98.7205%

注：持有人户数合计数少于各分项之和，系部分基金持有人持有多个份额类别基金所致。

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	中信建投量化进取A	426,727.39	0.0916%
	中信建投量化进取C	2,000.52	0.0016%
	合计	428,727.91	0.0721%

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式 基金	中信建投量化进取A	0
	中信建投量化进取C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基 金	中信建投量化进取A	0
	中信建投量化进取C	0
	合计	0

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

	中信建投量化进取A	中信建投量化进取C
基金合同生效日(2021年03月09 日)基金份额总额	927,254,063.16	373,861,421.81
本报告期期初基金份额总额	496,010,603.97	142,408,158.64
本报告期基金总申购份额	3,754,263.15	838,238.63
减：本报告期基金总赎回份额	33,972,092.39	14,637,995.57
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	465,792,774.73	128,608,401.70

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务，本报告期内未发生变更。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

措施1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	管理人
受到稽查或处罚等措施的时间	2024年05月16日
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证监会北京监管局
受到的具体措施类型	责令改正
受到稽查或处罚等措施的原因	违反《证券期货经营机构私募资产管理业务管理办法》等
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	公司积极进行整改，截至本报告期末已向中国证监会北京监管局提交完成整改报告。
其他	-

注：报告期内基金管理人的高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 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	
中信建投证券	2	3,472,207,054.04	100.00%	1,823,130.58	100.00%	-

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

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

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

（3）评估实行评分制，具体如下：

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

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

### 10.7.2 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		债券回购交易		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	占当期债券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
中信建投证券	483,599.46	100.00%	-	-	-	-	-	-

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中信建投基金管理有限公司旗下部分基金2023年第4季度报告提示性公告	规定报刊	2024-01-22



2	中信建投量化进取6个月持有期混合型证券投资基金2023年第4季度报告	规定网站	2024-01-22
3	中信建投基金管理有限公司关于终止和合期货有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	规定网站、规定报刊	2024-02-28
4	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加第一创业证券股份有限公司为代销机构并开通定期定额投资业务及开展费率优惠的公告	规定网站、规定报刊	2024-03-05
5	中信建投量化进取6个月持有期混合型证券投资基金招募说明书（更新）	规定网站	2024-03-11
6	中信建投量化进取6个月持有期混合型证券投资基金基金产品资料概要更新	规定网站	2024-03-11
7	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加深圳前海微众银行股份有限公司为代销机构并开通定期定额投资业务及开展费率优惠的公告	规定网站、规定报刊	2024-03-12
8	中信建投基金管理有限公司旗下部分基金2023年年度报告提示性公告	规定报刊	2024-03-29
9	中信建投量化进取6个月持有期混合型证券投资基金2023年年度报告	规定网站	2024-03-29
10	中信建投基金管理有限公司旗下全部基金2024年第1季度报告提示性公告	规定报刊	2024-04-22

11	中信建投量化进取6个月持有期混合型证券投资基金2024年第1季度报告	规定网站	2024-04-22
12	中信建投基金管理有限公司关于暂停海银基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	规定网站、规定报刊	2024-06-07
13	中信建投量化进取6个月持有期混合型证券投资基金(A类份额)基金产品资料概要更新	规定网站	2024-06-28
14	中信建投量化进取6个月持有期混合型证券投资基金(C类份额)基金产品资料概要更新	规定网站	2024-06-28

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本报告期内，未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，无影响投资者决策的其他重要信息。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

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

### 12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

### 12.3 查阅方式

投资者可以在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

中信建投基金管理有限公司

二〇二四年八月三十日