

# 中信建投量化进取 6 个月持有期混合型证券投资基金

## 2025 年中期报告

2025 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

报告送出日期:2025 年 08 月 29 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2025年08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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2025年01月01日起至2025年06月30日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>1</b>
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>4</b>
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
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>5</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>7</b>
4.1 基金管理人及基金经理情况	7
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	9
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	9
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	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	10
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	10
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	10
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>10</b>
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	10
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	11
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	11
<b>§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)</b>	<b>11</b>
6.1 资产负债表	11
6.2 利润表	12
6.3 净资产变动表	13
6.4 报表附注	14
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>36</b>
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
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	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	54
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	55
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	55
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	55
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	55
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	55
7.12 投资组合报告附注	55

<b>§ 8 基金份额持有人信息</b> .....	<b>56</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	57
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 .....	57
<b>§ 9 开放式基金份额变动</b> .....	<b>57</b>
<b>§ 10 重大事件揭示</b> .....	<b>57</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	57
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 .....	58
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	58
10.4 基金投资策略的改变 .....	58
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	58
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 .....	58
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	58
10.8 其他重大事件 .....	59
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息</b> .....	<b>60</b>
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 .....	60
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	60
<b>§ 12 备查文件目录</b> .....	<b>60</b>
12.1 备查文件目录 .....	60
12.2 存放地点 .....	61
12.3 查阅方式 .....	61

## § 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	
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	470,847,825.39 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中信建投量化进取 A	中信建投量化进取 C
下属分级基金的交易代码	011410	011411
报告期末下属分级基金的份额总额	377,088,776.69 份	93,759,048.70 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 $\times$ 80% + 中证综合债指数收益率 $\times$ 20%
风险收益特征	本基金属于混合型基金，其预期风险和预期收益高于货币市场基金、债券型基金，低于股票型基金。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	中信建投基金管理有限公司	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	朱伟
	联系电话	010-59100208
	电子邮箱	zhuweibj@csc.com.cn
		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 188 号鸿安国际大厦 6 、 8 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 188 号鸿安国际大厦 6 、 8 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（2025 年 01 月 01 日-2025 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	10,015,994.63	2,373,682.59
本期利润	22,507,586.67	5,489,510.31
加权平均基金份额本期利润	0.0562	0.0508
本期加权平均净值利润率	6.30%	5.79%
本期基金份额净值增长率	6.55%	6.32%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2025 年 06 月 30 日）	
期末可供分配利润	-28,357,618.66	-8,512,807.63
期末可供分配基金份额利润	-0.0752	-0.0908
期末基金资产净值	354,069,148.82	86,528,584.60
期末基金份额净值	0.9390	0.9229
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2025 年 06 月 30 日）	
基金份额累计净值增长率	-6.10%	-7.71%

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 净值表现

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	5.13%	0.72%	3.55%	0.63%	1.58%	0.09%
过去三个月	3.94%	1.45%	1.26%	1.19%	2.68%	0.26%
过去六个月	6.55%	1.19%	3.06%	1.08%	3.49%	0.11%
过去一年	17.86%	1.25%	17.28%	1.37%	0.58%	-0.12%
过去三年	-8.74%	1.07%	-2.86%	1.08%	-5.88%	-0.01%
自基金合同生 效起至今	-6.10%	1.13%	1.25%	1.05%	-7.35%	0.08%

##### 中信建投量化进取 C 净值表现

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	5.09%	0.72%	3.55%	0.63%	1.54%	0.09%
过去三个月	3.84%	1.45%	1.26%	1.19%	2.58%	0.26%
过去六个月	6.32%	1.19%	3.06%	1.08%	3.26%	0.11%
过去一年	17.39%	1.25%	17.28%	1.37%	0.11%	-0.12%
过去三年	-9.84%	1.07%	-2.86%	1.08%	-6.98%	-0.01%
自基金合同生 效起至今	-7.71%	1.13%	1.25%	1.05%	-8.96%	0.08%

#### 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-2025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-2025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管理、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 61 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。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	-	10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、中信建投中证 A500 指数增强型证券投资基金。

					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管理运作管理办法》《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管理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

2025 年上半年，全球市场在宏观经济挑战与地缘政治风险的交织影响下，呈现出高度的波动性和复杂性。全球经济增长动能放缓，而国内经济在政策支持下展现出韧性。在这样的背景下，市场风格转换迅速，从成长到价值再到行业轮动，对投资决策提出了更高要求。“关税风波”等外部事件也加剧了特定行业的波动，促使市场更加关注内需驱动型和自主可控领域的投资机会。

本产品利用量化的办法进行选股和风险管理，严格控制行业与风格的偏离，同时，本基金秉承尽职尽责的态度，认真应对投资者日常申购、赎回等工作。

### 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 0.9390 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 6.55%，同期业绩比较基准收益率为 3.06%；截至报告期末中信建投量化进取 C 基金份额净值为 0.9229 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 6.32%，同期业绩比较基准收益率为 3.06%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，我们认为市场环境仍将充满挑战，但中国经济的内生韧性和新质生产力的加速发展将为投资提供新的增长引擎。我们将继续关注人工智能、生物技术等高成长领域，同时也会密切留意消费复苏和具备稳定分红潜力的公司。我们将持续深化对市场的研究，以期更好地把握市场脉搏，应对未来的不确定性。

#### 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，未发现有损害基金份额持有人利益的行为。

## § 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：2025 年 06 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025 年 06 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	30,812,424.79	55,436,192.04
结算备付金		15,667,203.97	43,503,686.42
存出保证金		—	—
交易性金融资产	6.4.7.2	396,679,729.20	379,782,646.00
其中：股票投资		396,676,629.00	379,782,646.00
基金投资		—	—
债券投资		3,100.20	—
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		1, 942. 86	4, 017. 19
递延所得税资产		—	—
其他资产	6. 4. 7. 5	—	—
资产总计		443, 161, 300. 82	478, 726, 541. 65
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2025 年 06 月 30 日</b>	<b>上年度末 2024 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		1, 911, 013. 65	1, 102, 496. 66
应付管理人报酬		428, 316. 13	495, 401. 60
应付托管费		71, 386. 01	82, 566. 99
应付销售服务费		28, 284. 23	35, 161. 48
应付投资顾问费		—	—
应交税费		0. 80	—
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	6. 4. 7. 6	124, 566. 58	38, 000. 00
负债合计		2, 563, 567. 40	1, 753, 626. 73
<b>净资产:</b>			
实收基金	6. 4. 7. 7	470, 847, 825. 39	542, 972, 304. 74
未分配利润	6. 4. 7. 8	-30, 250, 091. 97	-65, 999, 389. 82
净资产合计		440, 597, 733. 42	476, 972, 914. 92
负债和净资产总计		443, 161, 300. 82	478, 726, 541. 65

注：报告截止日 2025 年 06 月 30 日，基金份额总额 470, 847, 825. 39 份，其中中信建投量化进取 A 类基金份额净值 0.9390 元，基金份额 377, 088, 776.69 份；中信建投量化进取 C 类基金份额净值 0.9229 元，基金份额 93, 759, 048.70 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：2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		31, 405, 557. 44	-42, 189, 089. 17
1. 利息收入		226, 910. 28	292, 901. 86
其中：存款利息收入	6. 4. 7. 9	226, 910. 28	292, 901. 86
债券利息收入		—	—

资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益(损失以“-”填列)		15,571,227.40	-30,604,642.31
其中: 股票投资收益	6. 4. 7. 10	11,379,818.52	-37,169,150.24
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6. 4. 7. 11	27,879.59	68,117.45
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. 12	-	-
股利收益	6. 4. 7. 13	4,163,529.29	6,496,390.48
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6. 4. 7. 14	15,607,419.76	-11,877,348.72
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. 15	-	-
<b>减: 二、营业总支出</b>		3,408,460.46	3,761,034.15
1. 管理人报酬	6. 4. 10. 2. 1	2,691,033.66	2,961,216.96
2. 托管费	6. 4. 10. 2. 2	448,505.60	493,536.17
3. 销售服务费	6. 4. 10. 2. 3	188,260.45	214,740.71
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. 16	-	-
7. 税金及附加		0.07	0.19
8. 其他费用	6. 4. 7. 17	80,660.68	91,540.12
<b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b>		27,997,096.98	-45,950,123.32
减: 所得税费用		-	-
<b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>		27,997,096.98	-45,950,123.32
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		27,997,096.98	-45,950,123.32

### 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: 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日

单位: 人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 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	542,972,304.74	-65,999,389.82	476,972,914.92
二、本期期初净资产	542,972,304.74	-65,999,389.82	476,972,914.92
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-72,124,479.35	35,749,297.85	-36,375,181.50
(一)、综合收益总额	-	27,997,096.98	27,997,096.98
(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)	-72,124,479.35	7,752,200.87	-64,372,278.48
其中：1.基金申购款	839,136.78	-98,649.97	740,486.81
2.基金赎回款	-72,963,616.13	7,850,850.84	-65,112,765.29
(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	470,847,825.39	-30,250,091.97	440,597,733.42
项目	上年度可比期间 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“-”号填列)	-44,017,586.18	-37,443,386.29	-81,460,972.47
(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

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

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《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》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则第 2 号<年度报告的内容与格式>》、《证券投资基金信息披露编报规则第 3 号<会计报表附注的编制及披露>》、《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>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 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 2025 年 06 月 30 日的财务状况以及 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 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

本基金会计年度采用公历年，即自 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 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日。

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币和编制本财务报表所采用的货币均为人民币。除有特别说明外，均以人民币元为单位表示。

##### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具是指形成本基金的金融资产（或负债），并形成其他单位的金融负债（或资产）或权益工具的合同。

###### （1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时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、以摊余成本计量的金融资产；

###### （2）金融负债分类

除由于金融资产转移不符合终止确认条件或继续涉入被转移金融资产所形成的金融负债以外，本基金的金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债、以摊余成本计量的金融负债。

##### 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

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为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，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

划分为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关交易费用计入其初始确认金额；

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，采用公允价值进行后续计量，其公允价值变动形成的利得或损失计入当期损益；

对于以摊余成本计量的金融资产，采用实际利率法确认利息收入，其终止确认、修改或减值产生的利得或损失，均计入当期损益；

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值处理并确认损失准备。对于不含重大融资成分的应收款项，本基金运用简化计量方法，按照相当于整个存续期内的预期信用损失金额计量损失准备。除上述采用简化计量方法以外的金融资产，本基金在每个估值日评估其信用风险自初始确认后是否已经显著增加，如果信用风险自初始确认后未显著增加，处于第一阶段，本基金按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果信用风险自初始确认后已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照账面余额和实际利率计算利息收入；如果初始确认后发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量损失准备，并按照摊余成本和实际利率计算利息收入；

本基金在每个估值日评估相关金融工具的信用风险自初始确认后是否已显著增加。本基金以单项金融工具或者具有相似信用风险特征的金融工具组合为基础，通过比较金融工具在估值日发生违约的风险与在初始确认日发生违约的风险，以确定金融工具预计存续期内发生违约风险的变化情况；

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得的有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

当对金融资产预期未来现金流量具有不利影响的一项或多项事件发生时，该金融资产成为已发生信用减值的金融资产；

当本基金不再合理预期能够全部或部分收回金融资产合同现金流量时，本基金直接减记该金融资产的账面余额；

当收取该金融资产现金流量的合同权利终止，或该收取金融资产现金流量的权利已转移，且符合金融资产转移的终止确认条件的，金融资产将终止确认；

本基金已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的，终止确认该金融资产；保留了金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬的，不终止确认该金融资产；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的，分别下列情况处理：放弃了对该金融资产控制的，终止确认该金融资产并确认产生的资产和负债；未放弃对该金融资产控制的，按照其继续涉入所转移金融资产的程度确认有关金融资产，并相应确认有关负债。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债（含交易性金融负债和衍生金融负债），按照公允价值进行后续计量，所有公允价值变动均计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融负债，采用实际利率法，按照摊余成本进行后续计量。如果金融负债的责任已履行、撤销或届满，则对金融负债进行终止确认。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次输入值，确定所属的公允价值层次：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。

每个资产负债表日，本基金对在财务报表中确认的持续以公允价值计量的资产和负债进行重新评估，以确定是否在公允价值计量层次之间发生转换。

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和金融负债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，按照估值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作为公允价值；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，应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，应对报价进行调整，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) 不存在活跃市场的金融工具，应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，应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，才使用不可观察输入值；

(3) 如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的方法估值；

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时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时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。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确认。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损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益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收益/（损失）占基金净值比例计算的金

额。未实现损益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利得/（损失）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确认。未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，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

(1) 存款利息收入按存款的本金与适用的利率逐日计提的金额入账。若提前支取定期存款，按协议规定的利率及持有期重新计算存款利息收入，并根据提前支取所实际收到的利息收入与账面已确认的利息收入的差额确认利息损失，列入利息收入减项，存款利息收入以净额列示；

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

债券投资和资产支持证券投资持有期间，按证券票面价值与票面利率或预期收益率计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额确认为投资收益，在证券实际持有期内逐日计提；

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(3) 股利收益于除息日确认，并按发行人宣告的分红派息比例计算的金额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账；

(4) 处置衍生工具的投资收益于成交日确认，并按处置衍生工具成交金额与其成本的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

(5) 买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

(6) 公允价值变动收益系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、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扣除在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额形成的应计入当期损益的利得或损失；

(7) 其他收入在经济利益很可能流入从而导致本基金资产增加或者负债减少、且经济利益的流入额能够可靠计量时予以确认。

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费等费用按照权责发生制原则，在本基金接受相关服务的期间计入当期损益。

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

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。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

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) 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) 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。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

#### 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

本基金本报告期无会计估计变更。

##### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

#### 6.4.6 税项

##### (1) 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3‰ 调整为 1‰，自 2008 年 9 月 19 日起，调整由出让方按证券（股票）交易印花税税率缴纳印花税，受让方不再征收，税率不变；

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。

##### (2) 增值税

根据财政部、国家税务总局财税〔2016〕36 号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

根据财政部、国家税务总局财税〔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》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税〔2016〕70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》的规定，金融机构开展的买断式买入返售金融商品业务、同业存款、同业存单以及持有金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

根据财政部、国家税务总局财税〔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》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；

根据财政部、国家税务总局财税〔2017〕56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自2018年1月1日起，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（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额；

根据财政部、国家税务总局财税〔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》的规定，自2018年1月1日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以利息及利息性质的收入为销售额；

增值税附加税包括城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加，以实际缴纳的增值税税额为计税依据，分别按规定的比例缴纳。

### （3）企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税〔2004〕78号《关于证券投资基金管理政策的通知》的规定，自2004年1月1日起，对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征企业所得税；

根据财政部、国家税务总局财税〔2008〕1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资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，股权的股息、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。

### （4）个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税〔2008〕132号《财政部、国家税务总局关于储蓄存款利息所得有关个人所得税政策的通知》的规定，自2008年10月9日起，对储蓄存款利息所得暂免征收个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税〔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》的规定，自2013年1月1日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，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，暂减按25%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；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税〔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》的规定，自2015年9月8日起，证券投资基金从公开发行和转让

市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

#### 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 2025 年 06 月 30 日
活期存款	2,134,336.59
等于：本金	2,133,819.06
加：应计利息	517.53
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	28,678,088.20
等于：本金	28,676,022.87
加：应计利息	2,065.33
减：坏账准备	—
合计	30,812,424.79

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 06 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	386,329,684.59	—	396,676,629.00	10,346,944.41
贵金属投资-金交所 黄金合约	—	—	—	—
债券	交易所市场	3,100.00	0.20	3,100.20
	银行间市场	—	—	—
	合计	3,100.00	0.20	3,100.20
资产支持证券	—	—	—	—
基金	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	386,332,784.59	0.20	396,679,729.20	10,346,944.41

##### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

###### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

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 其他资产**

无。

**6.4.7.6 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2025 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	116,351.28
其他应付	8,215.30
合计	124,566.58

**6.4.7.7 实收基金****中信建投量化进取 A**

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	425,522,603.75	425,522,603.75
本期申购	656,249.18	656,249.18
本期赎回（以“-”号填列）	-49,090,076.24	-49,090,076.24
本期末	377,088,776.69	377,088,776.69

**中信建投量化进取 C**

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	117,449,700.99	117,449,700.99
本期申购	182,887.60	182,887.60

本期赎回（以“-”号填列）	-23,873,539.89	-23,873,539.89
本期末	93,759,048.70	93,759,048.70

#### 6.4.7.8 未分配利润

##### 中信建投量化进取 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	-42,743,610.32	-7,749,841.67	-50,493,451.99
本期期初	-42,743,610.32	-7,749,841.67	-50,493,451.99
本期利润	10,015,994.63	12,491,592.04	22,507,586.67
本期基金份额交易产生的变动数	4,369,997.03	596,240.42	4,966,237.45
其中：基金申购款	-59,963.26	-13,728.61	-73,691.87
基金赎回款	4,429,960.29	609,969.03	5,039,929.32
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-28,357,618.66	5,337,990.79	-23,019,627.87

##### 中信建投量化进取 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	-13,375,568.75	-2,130,369.08	-15,505,937.83
本期期初	-13,375,568.75	-2,130,369.08	-15,505,937.83
本期利润	2,373,682.59	3,115,827.72	5,489,510.31
本期基金份额交易产生的变动数	2,489,078.53	296,884.89	2,785,963.42
其中：基金申购款	-18,621.67	-6,336.43	-24,958.10
基金赎回款	2,507,700.20	303,221.32	2,810,921.52
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-8,512,807.63	1,282,343.53	-7,230,464.10

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
活期存款利息收入	10,294.89
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	53,097.84
结算备付金利息收入	163,517.55
其他	-
合计	226,910.28

#### 6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
卖出股票成交总额	1,771,025,477.83

减: 卖出股票成本总额	1,756,980,556.23
减: 交易费用	2,665,103.08
买卖股票差价收入	11,379,818.52

#### 6.4.7.11 债券投资收益

##### 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位: 人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
债券投资收益——利息收入	24.45
债券投资收益——买卖债券(债转股及债券到期兑付)差价收入	27,855.14
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	27,879.59

##### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位: 人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
卖出债券(债转股及债券到期兑付)成交总额	140,485.72
减: 卖出债券(债转股及债券到期兑付)成本总额	112,600.00
减: 应计利息总额	24.98
减: 交易费用	5.60
买卖债券差价收入	27,855.14

#### 6.4.7.12 衍生工具收益

无。

#### 6.4.7.13 股利收益

单位: 人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
股票投资产生的股利收益	4,163,529.29
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	4,163,529.29

#### 6.4.7.14 公允价值变动收益

单位: 人民币元

项目名称	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
1. 交易性金融资产	15,607,419.76

——股票投资	15,607,419.76
——债券投资	—
——资产支持证券投资	—
——基金投资	—
——贵金属投资	—
——其他	—
2. 衍生工具	—
——权证投资	—
3. 其他	—
减: 应税金融商品公允价值变动 产生的预估增值税	—
合计	15,607,419.76

#### 6.4.7.15 其他收入

无。

#### 6.4.7.16 信用减值损失

无。

#### 6.4.7.17 其他费用

单位: 人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日
审计费用	18,843.91
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	—
汇划手续费	2,309.40
合计	80,660.68

#### 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

财政部、税务总局于 2025 年 7 月 31 日发布《财政部 税务总局关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》(财政部 税务总局公告 2025 年第 4 号)，规定自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后(含当日)新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券(包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分)的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。

## 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

注：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 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 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 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 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	3,526,778,959.10	100.00%	3,472,207,054.04	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

关联方名称	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日		上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 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
中信建投证券股份有限公司	140,485.72	100.00%	483,599.46	100.00%

#### 6.4.10.1.4 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 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	1,554,162.38	100.00%	0.00	0.00%
关联方名称	上年度可比期间 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
中信建投证券股份有限公司	1,823,130.58	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代收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。

根据证监会公告[2024]3号《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自2024年7月1日起，针对被动股票型基金，不再通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用。针对其他类型基金，不再通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

#### 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 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	2,691,033.66	2,961,216.96
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,327,937.69	1,457,923.13
应支付基金管理人的净管理费	1,363,095.97	1,503,293.83

注：支付基金管理人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 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	448,505.60	493,536.17

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%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.20%/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 2025 年 01 月 01 日至 2025 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	2,485.54	2,485.54
中信建投基金管理有限公司	0.00	600.09	600.09
中信建投期货有限公司	0.00	31.90	31.90
中信建投证券股份有限公司	0.00	174,260.51	174,260.51
合计	0.00	177,378.04	177,378.04
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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

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 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 06 月 30 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 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	2,134,336.59	10,294.89	4,205,762.53	11,019.08
中信建投证券股份有限公司	28,678,088.20	53,097.84	42,295,550.61	87,365.10

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，按同业利率或约定利率计息。  
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，按同业利率或约定利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

#### 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

无。

#### 6.4.12 期末（2025 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或其他拥有相关资质的银行，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；在银行间同业市场等场外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。

##### 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 2025 年 06 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
AAA	—	—
AAA 以下	3,100.20	—
未评级	—	—

合计	3,100.20	-
----	----------	---

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于开放期内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。

于本期末，除附注 6.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）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约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（净资产）无固定到期日且不计息，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时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金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（如有）。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。

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。

###### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年 06 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	30,812,424.79	—	—	—	30,812,424.79
结算备付金	15,667,203.97	—	—	—	15,667,203.97
交易性金融资产	—	—	3,100.20	396,676,629.00	396,679,729.20
应收申购款	—	—	—	1,942.86	1,942.86
资产总计	46,479,628.76	—	3,100.20	396,678,571.86	443,161,300.82
负债					
应付赎回款	—	—	—	1,911,013.65	1,911,013.65
应付管理人报酬	—	—	—	428,316.13	428,316.13
应付托管费	—	—	—	71,386.01	71,386.01
应付销售服务费	—	—	—	28,284.23	28,284.23
应交税费	—	—	—	0.80	0.80
其他负债	—	—	—	124,566.58	124,566.58
负债总计	—	—	—	2,563,567.40	2,563,567.40
利率敏感度缺口	46,479,628.76	—	3,100.20	394,115,004.46	440,597,733.42
上年度末 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	55,436,192.04	—	—	—	55,436,192.04

结算备付金	43,503,686.42	-	-	-	43,503,686.42
交易性金融资产	-	-	-	379,782,646.00	379,782,646.00
应收申购款	-	-	-	4,017.19	4,017.19
资产总计	98,939,878.46	-	-	379,786,663.19	478,726,541.65
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,102,496.66	1,102,496.66
应付管理人报酬	-	-	-	495,401.60	495,401.60
应付托管费	-	-	-	82,566.99	82,566.99
应付销售服务费	-	-	-	35,161.48	35,161.48
其他负债	-	-	-	38,000.00	38,000.00
负债总计	-	-	-	1,753,626.73	1,753,626.73
利率敏感度缺口	98,939,878.46	-	-	378,033,036.46	476,972,914.92

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

于本期末及上年度末，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并不重大，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响。

#### 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 2025 年 06 月 30 日	上年度末 2024 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	396,676,629.00	90.03	379,782,646.00	79.62
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产—债券投资	3,100.20	0.00	—	—
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	396,679,729.20	90.03	379,782,646.00	79.62

#### 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 2025 年 06 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	19,313,018.02	18,731,493.99
	业绩比较基准下降 5%	-19,313,018.02	-18,731,493.99

#### 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 2025 年 06 月 30 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	396,676,629.00	379,782,646.00
第二层次	3,100.20	—
第三层次	—	—
合计	396,679,729.20	379,782,646.00

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券、基金等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、境内股票涨跌停等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关

投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的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，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。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。

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

#### 6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

#### 6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### 6.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

##### 6.4.15.2 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。

##### 6.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2025 年 8 月 28 日经本基金的基金管理人批准。

## § 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	396,676,629.00	89.51
	其中：股票	396,676,629.00	89.51
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	3,100.20	0.00
	其中：债券	3,100.20	0.00
	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	46,479,628.76	10.49
8	其他各项资产	1,942.86	0.00
9	合计	443,161,300.82	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	1,348,246.00	0.31
B	采矿业	8,715,972.00	1.98
C	制造业	251,314,998.00	57.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,797,011.00	1.77
E	建筑业	3,213,529.00	0.73
F	批发和零售业	16,791,263.00	3.81
G	交通运输、仓储和邮政业	5,792,016.00	1.31
H	住宿和餐饮业	2,004,558.00	0.45
I	信息传输、软件和信息技术服务业	34,095,277.00	7.74
J	金融业	41,385,100.00	9.39
K	房地产业	4,753,343.00	1.08
L	租赁和商务服务业	6,060,625.00	1.38
M	科学研究和技术服务业	2,587,794.00	0.59
N	水利、环境和公共设施管理业	3,354,057.00	0.76
O	居民服务、修理和其他服务业	262,632.00	0.06
P	教育	360,507.00	0.08
Q	卫生和社会工作	2,958,998.00	0.67
R	文化、体育和娱乐业	2,888,664.00	0.66
S	综合	992,039.00	0.23
	合计	396,676,629.00	90.03

### 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	占基金资产净值比例(%)
1	300207	欣旺达	161,500	3,239,690.00	0.74
2	000783	长江证券	461,900	3,200,967.00	0.73
3	000050	深天马A	327,400	2,789,448.00	0.63
4	600998	九州通	541,200	2,781,768.00	0.63
5	600109	国金证券	295,500	2,591,535.00	0.59
6	002414	高德红外	230,900	2,366,725.00	0.54
7	600143	金发科技	229,500	2,366,145.00	0.54
8	600699	均胜电子	126,900	2,213,136.00	0.50

9	600707	彩虹股份	337,700	2,181,542.00	0.50
10	002841	视源股份	62,900	2,176,340.00	0.49
11	002273	水晶光电	103,200	2,060,904.00	0.47
12	002056	横店东磁	141,900	2,007,885.00	0.46
13	002080	中材科技	96,600	1,883,700.00	0.43
14	300017	网宿科技	174,400	1,869,568.00	0.42
15	002661	克明食品	186,000	1,861,860.00	0.42
16	002624	完美世界	119,800	1,817,366.00	0.41
17	002266	浙富控股	584,100	1,799,028.00	0.41
18	603087	甘李药业	32,300	1,769,394.00	0.40
19	300140	节能环保	284,800	1,757,216.00	0.40
20	601555	东吴证券	200,600	1,755,250.00	0.40
21	000021	深科技	93,400	1,750,316.00	0.40
22	002500	山西证券	295,100	1,723,384.00	0.39
23	000709	河钢股份	786,500	1,698,840.00	0.39
24	300241	瑞丰光电	294,800	1,680,360.00	0.38
25	000757	浩物股份	367,300	1,663,869.00	0.38
26	600535	天士力	105,600	1,652,640.00	0.38
27	002410	广联达	119,700	1,605,177.00	0.36
28	603341	龙旗科技	39,500	1,604,885.00	0.36
29	000636	风华高科	116,200	1,596,588.00	0.36
30	600062	华润双鹤	85,100	1,587,966.00	0.36
31	603816	XD 顾家家	61,600	1,572,032.00	0.36
32	002926	华西证券	174,400	1,559,136.00	0.35
33	688772	珠海冠宇	106,400	1,520,456.00	0.35
34	600959	江苏有线	437,100	1,503,624.00	0.34
35	600166	福田汽车	550,200	1,491,042.00	0.34
36	000960	锡业股份	96,100	1,470,330.00	0.33
37	000893	亚钾国际	48,000	1,446,720.00	0.33
38	688099	晶晨股份	20,300	1,441,503.00	0.33
39	601717	郑煤机	86,000	1,429,320.00	0.32
40	002244	滨江集团	144,900	1,412,775.00	0.32
41	688217	睿昂基因	55,800	1,411,740.00	0.32
42	601168	西部矿业	84,700	1,408,561.00	0.32
43	000060	中金岭南	306,700	1,404,686.00	0.32
44	600583	海油工程	256,500	1,400,490.00	0.32
45	600637	东方明珠	184,200	1,375,974.00	0.31
46	300496	中科创达	23,900	1,367,558.00	0.31
47	600704	物产中大	253,100	1,333,837.00	0.30
48	300677	英科医疗	56,300	1,333,184.00	0.30
49	002532	天山铝业	159,900	1,328,769.00	0.30
50	600487	亨通光电	86,800	1,328,040.00	0.30
51	002138	顺络电子	47,000	1,321,640.00	0.30

52	300058	蓝色光标	199,900	1,311,344.00	0.30
53	300054	鼎龙股份	44,400	1,273,392.00	0.29
54	688778	厦钨新能	22,700	1,269,384.00	0.29
55	601155	新城控股	91,700	1,254,456.00	0.28
56	688469	芯联集成	261,700	1,248,309.00	0.28
57	601216	君正集团	223,200	1,232,064.00	0.28
58	000988	华工科技	26,000	1,222,260.00	0.28
59	600739	辽宁成大	110,500	1,215,500.00	0.28
60	300373	扬杰科技	23,400	1,214,460.00	0.28
61	600909	华安证券	207,900	1,212,057.00	0.28
62	000823	超声电子	99,600	1,180,260.00	0.27
63	600335	国机汽车	179,100	1,155,195.00	0.26
64	600873	梅花生物	107,600	1,150,244.00	0.26
65	000651	格力电器	25,500	1,145,460.00	0.26
66	600919	江苏银行	95,100	1,135,494.00	0.26
67	000728	国元证券	143,900	1,135,371.00	0.26
68	600887	伊利股份	40,300	1,123,564.00	0.26
69	601009	南京银行	95,700	1,112,034.00	0.25
70	601233	桐昆股份	104,000	1,102,400.00	0.25
71	600271	航天信息	118,800	1,097,712.00	0.25
72	600694	大商股份	59,100	1,096,305.00	0.25
73	002958	青农商行	302,400	1,091,664.00	0.25
74	300369	绿盟科技	139,800	1,086,246.00	0.25
75	688249	晶合集成	53,000	1,074,310.00	0.24
76	300041	回天新材	113,900	1,072,938.00	0.24
77	688819	天能股份	38,600	1,071,536.00	0.24
78	600258	首旅酒店	75,800	1,071,054.00	0.24
79	601568	北元集团	257,300	1,067,795.00	0.24
80	002939	长城证券	127,200	1,065,936.00	0.24
81	002745	木林森	135,100	1,064,588.00	0.24
82	600033	福建高速	299,600	1,060,584.00	0.24
83	000528	柳工	110,300	1,059,983.00	0.24
84	600497	驰宏锌锗	199,800	1,056,942.00	0.24
85	000750	国海证券	256,400	1,056,368.00	0.24
86	603259	药明康德	15,100	1,050,205.00	0.24
87	002373	千方科技	112,600	1,047,180.00	0.24
88	600050	中国联通	195,800	1,045,572.00	0.24
89	600105	永鼎股份	128,900	1,042,801.00	0.24
90	000739	普洛药业	73,800	1,033,200.00	0.23
91	601860	紫金银行	343,400	1,030,200.00	0.23
92	600157	永泰能源	765,600	1,025,904.00	0.23
93	603466	风语筑	101,500	1,024,135.00	0.23
94	600871	石化油服	523,500	1,020,825.00	0.23

95	601688	华泰证券	57,300	1,020,513.00	0.23
96	002010	传化智联	182,300	1,017,234.00	0.23
97	002407	多氟多	83,400	1,016,646.00	0.23
98	300685	艾德生物	47,000	1,011,910.00	0.23
99	002803	吉宏股份	70,900	1,011,034.00	0.23
100	000928	中钢国际	160,900	1,010,452.00	0.23
101	002230	科大讯飞	21,000	1,005,480.00	0.23
102	002315	焦点科技	22,000	1,005,180.00	0.23
103	001696	宗申动力	44,700	1,003,515.00	0.23
104	002296	辉煌科技	89,900	1,002,385.00	0.23
105	600097	开创国际	95,600	998,064.00	0.23
106	002048	宁波华翔	54,200	997,822.00	0.23
107	688018	乐鑫科技	6,800	993,480.00	0.23
108	603565	中谷物流	103,900	992,245.00	0.23
109	300231	银信科技	80,600	992,186.00	0.23
110	000977	浪潮信息	19,500	992,160.00	0.23
111	600673	东阳光	85,300	992,039.00	0.23
112	000932	华菱钢铁	225,400	991,760.00	0.23
113	605305	中际联合	35,700	991,746.00	0.23
114	002303	美盈森	278,200	990,392.00	0.22
115	300919	中伟股份	30,100	989,688.00	0.22
116	300662	科锐国际	33,300	989,343.00	0.22
117	600866	星湖科技	142,900	987,439.00	0.22
118	603636	南威软件	78,100	987,184.00	0.22
119	300274	阳光电源	14,500	982,665.00	0.22
120	600961	株冶集团	87,800	981,604.00	0.22
121	000623	吉林敖东	57,900	981,405.00	0.22
122	000157	中联重科	135,700	981,111.00	0.22
123	600160	巨化股份	34,200	980,856.00	0.22
124	603236	移远通信	11,400	978,120.00	0.22
125	000551	创元科技	76,100	977,885.00	0.22
126	000901	航天科技	78,400	974,512.00	0.22
127	000657	中钨高新	82,000	972,520.00	0.22
128	300203	聚光科技	43,900	971,507.00	0.22
129	600480	凌云股份	79,700	969,949.00	0.22
130	002396	星网锐捷	43,100	967,595.00	0.22
131	300401	花园生物	63,600	967,356.00	0.22
132	000951	中国重汽	55,000	966,900.00	0.22
133	300014	亿纬锂能	21,100	966,591.00	0.22
134	688685	迈信林	17,300	966,205.00	0.22
135	600203	福日电子	103,200	965,952.00	0.22
136	002206	海利得	188,900	965,279.00	0.22
137	300727	润禾材料	36,700	964,843.00	0.22

138	002027	分众传媒	132,100	964,330.00	0.22
139	002226	江南化工	166,100	963,380.00	0.22
140	300666	江丰电子	13,000	963,300.00	0.22
141	600176	中国巨石	84,500	963,300.00	0.22
142	300443	金雷股份	42,600	962,760.00	0.22
143	605277	新亚电子	53,600	962,656.00	0.22
144	002823	凯中精密	68,600	962,458.00	0.22
145	603993	洛阳钼业	114,300	962,406.00	0.22
146	688256	寒武纪	1,600	962,400.00	0.22
147	300124	汇川技术	14,900	962,093.00	0.22
148	300708	聚灿光电	80,100	961,200.00	0.22
149	002102	能特科技	304,000	960,640.00	0.22
150	002648	卫星化学	55,400	960,082.00	0.22
151	688008	澜起科技	11,700	959,400.00	0.22
152	600106	重庆路桥	156,500	959,345.00	0.22
153	002020	京新药业	73,500	959,175.00	0.22
154	600986	浙文互联	117,400	959,158.00	0.22
155	002597	金禾实业	40,700	958,485.00	0.22
156	600327	大东方	197,600	958,360.00	0.22
157	600114	东睦股份	47,100	958,014.00	0.22
158	000829	天音控股	93,700	956,677.00	0.22
159	603858	步长制药	58,900	956,536.00	0.22
160	000570	苏常柴A	165,200	956,508.00	0.22
161	600782	新钢股份	270,200	956,508.00	0.22
162	600835	上海机电	45,000	956,250.00	0.22
163	002249	大洋电机	145,200	955,416.00	0.22
164	600552	凯盛科技	84,500	954,850.00	0.22
165	300015	爱尔眼科	76,500	954,720.00	0.22
166	002083	孚日股份	197,600	954,408.00	0.22
167	600933	爱柯迪	59,600	954,196.00	0.22
168	600010	包钢股份	532,800	953,712.00	0.22
169	600567	山鹰国际	501,800	953,420.00	0.22
170	600268	国电南自	121,900	953,258.00	0.22
171	000725	京东方A	238,900	953,211.00	0.22
172	601868	中国能建	427,200	952,656.00	0.22
173	002698	博实股份	61,300	952,602.00	0.22
174	002011	盾安环境	82,100	952,360.00	0.22
175	688111	金山办公	3,400	952,170.00	0.22
176	600089	特变电工	79,800	952,014.00	0.22
177	000063	中兴通讯	29,300	951,957.00	0.22
178	002616	长青集团	160,200	951,588.00	0.22
179	000630	铜陵有色	284,800	951,232.00	0.22
180	000100	TCL 科技	219,600	950,868.00	0.22

181	000501	武商集团	109,800	950,868.00	0.22
182	601108	财通证券	120,200	950,782.00	0.22
183	600630	龙头股份	115,900	950,380.00	0.22
184	600031	三一重工	52,900	949,555.00	0.22
185	600585	海螺水泥	44,200	948,974.00	0.22
186	600719	大连热电	146,400	948,672.00	0.22
187	002001	新和成	44,600	948,642.00	0.22
188	000963	华东医药	23,500	948,460.00	0.22
189	000538	云南白药	17,000	948,430.00	0.22
190	600169	太原重工	391,900	948,398.00	0.22
191	601137	博威合金	53,300	948,207.00	0.22
192	000682	东方电子	92,500	947,200.00	0.21
193	002701	奥瑞金	159,100	946,645.00	0.21
194	000957	中通客车	86,600	946,538.00	0.21
195	605589	圣泉集团	34,100	946,275.00	0.21
196	600597	光明乳业	112,500	946,125.00	0.21
197	002668	TCL 智家	96,800	945,736.00	0.21
198	600729	重庆百货	31,700	945,611.00	0.21
199	002463	沪电股份	22,200	945,276.00	0.21
200	603501	豪威集团	7,400	944,610.00	0.21
201	002225	濮耐股份	190,800	944,460.00	0.21
202	002241	歌尔股份	40,500	944,460.00	0.21
203	002588	史丹利	107,200	944,432.00	0.21
204	600963	岳阳林纸	213,100	944,033.00	0.21
205	603799	华友钴业	25,500	944,010.00	0.21
206	002497	雅化集团	82,800	943,920.00	0.21
207	600120	浙江东方	156,000	943,800.00	0.21
208	600183	生益科技	31,300	943,695.00	0.21
209	600518	康美药业	499,100	943,299.00	0.21
210	601878	浙商证券	86,400	942,624.00	0.21
211	000425	徐工机械	121,300	942,501.00	0.21
212	600362	江西铜业	40,200	941,886.00	0.21
213	600219	南山铝业	245,700	941,031.00	0.21
214	002484	江海股份	45,900	940,491.00	0.21
215	000166	申万宏源	187,100	939,242.00	0.21
216	601311	XD 骆驼股	104,000	939,120.00	0.21
217	603729	龙韵股份	54,800	938,176.00	0.21
218	000001	平安银行	77,700	937,839.00	0.21
219	601231	环旭电子	64,100	937,783.00	0.21
220	601677	明泰铝业	75,500	937,710.00	0.21
221	000807	云铝股份	58,600	936,428.00	0.21
222	601600	中国铝业	133,000	936,320.00	0.21
223	000776	广发证券	55,700	936,317.00	0.21

224	002026	山东威达	76,900	934,335.00	0.21
225	601899	紫金矿业	47,900	934,050.00	0.21
226	600754	锦江酒店	41,600	933,504.00	0.21
227	600273	嘉化能源	110,300	933,138.00	0.21
228	002299	圣农发展	65,300	933,137.00	0.21
229	002142	宁波银行	34,100	932,976.00	0.21
230	688387	信科移动	164,300	928,295.00	0.21
231	300033	同花顺	3,400	928,234.00	0.21
232	600595	中孚实业	211,200	925,056.00	0.21
233	601615	XD 明阳智	80,200	921,498.00	0.21
234	300246	宝莱特	115,100	919,649.00	0.21
235	300136	信维通信	40,600	909,440.00	0.21
236	600299	安迪苏	92,400	891,660.00	0.20
237	600004	白云机场	95,800	871,780.00	0.20
238	600325	华发股份	178,600	869,782.00	0.20
239	000563	陕国投 A	235,900	842,163.00	0.19
240	605358	立昂微	35,800	834,140.00	0.19
241	000959	首钢股份	244,600	831,640.00	0.19
242	601456	国联民生	79,000	817,650.00	0.19
243	688502	茂莱光学	2,800	805,448.00	0.18
244	601665	齐鲁银行	126,500	799,480.00	0.18
245	600155	华创云信	111,700	777,432.00	0.18
246	000537	中绿电	91,600	765,776.00	0.17
247	002760	凤形股份	39,200	758,520.00	0.17
248	000898	鞍钢股份	325,900	756,088.00	0.17
249	000738	航发控制	35,800	742,850.00	0.17
250	600801	华新水泥	62,500	740,000.00	0.17
251	000825	太钢不锈	204,700	734,873.00	0.17
252	002153	石基信息	83,200	720,512.00	0.16
253	603233	大参林	42,700	696,010.00	0.16
254	300285	国瓷材料	40,100	695,735.00	0.16
255	002432	九安医疗	18,800	684,884.00	0.16
256	300724	捷佳伟创	12,600	684,180.00	0.16
257	603968	醋化股份	59,900	681,063.00	0.15
258	300573	兴齐眼药	13,000	673,270.00	0.15
259	600578	京能电力	147,800	663,622.00	0.15
260	688021	奥福科技	43,300	662,057.00	0.15
261	300001	特锐德	27,200	651,984.00	0.15
262	300232	洲明科技	89,500	647,980.00	0.15
263	601918	新集能源	99,500	642,770.00	0.15
264	600499	科达制造	65,300	639,940.00	0.15
265	300112	万讯自控	69,200	626,260.00	0.14
266	300390	天华新能	32,700	623,589.00	0.14

267	688329	艾隆科技	32,400	623,376.00	0.14
268	600369	西南证券	142,000	617,700.00	0.14
269	688659	元琛科技	69,800	609,354.00	0.14
270	600356	恒丰纸业	75,400	606,970.00	0.14
271	603650	彤程新材	18,800	604,420.00	0.14
272	600380	健康元	54,500	601,135.00	0.14
273	600884	杉杉股份	62,800	594,088.00	0.13
274	002709	天赐材料	32,600	590,712.00	0.13
275	300637	扬帆新材	48,900	589,245.00	0.13
276	600021	上海电力	66,900	588,051.00	0.13
277	688122	西部超导	11,200	581,056.00	0.13
278	002673	西部证券	73,500	579,180.00	0.13
279	688345	博力威	20,900	575,795.00	0.13
280	688681	科汇股份	41,000	574,000.00	0.13
281	300888	稳健医疗	13,900	571,290.00	0.13
282	688561	奇安信	16,800	570,864.00	0.13
283	600906	财达证券	83,700	570,834.00	0.13
284	603338	浙江鼎力	11,900	564,060.00	0.13
285	688172	燕东微	28,600	562,276.00	0.13
286	002439	启明星辰	35,100	561,249.00	0.13
287	600848	上海临港	61,500	557,805.00	0.13
288	603927	中科软	28,800	556,992.00	0.13
289	601990	南京证券	68,700	555,096.00	0.13
290	688213	思特威	5,400	551,988.00	0.13
291	600763	通策医疗	13,300	549,024.00	0.12
292	600361	创新新材	137,100	547,029.00	0.12
293	002008	大族激光	22,300	543,451.00	0.12
294	601577	长沙银行	54,600	542,724.00	0.12
295	600498	烽火通信	25,600	538,368.00	0.12
296	002340	格林美	84,300	535,305.00	0.12
297	688475	萤石网络	16,900	532,688.00	0.12
298	688512	慧智微	48,700	531,317.00	0.12
299	002202	金风科技	51,700	529,925.00	0.12
300	603379	三美股份	11,000	529,320.00	0.12
301	002472	双环传动	15,800	529,142.00	0.12
302	600312	平高电气	34,300	527,877.00	0.12
303	000039	中集集团	66,400	521,904.00	0.12
304	603893	瑞芯微	3,400	516,324.00	0.12
305	002558	巨人网络	21,900	515,745.00	0.12
306	300037	新宙邦	14,600	513,920.00	0.12
307	603000	人民网	25,400	513,334.00	0.12
308	300279	和晶科技	73,900	512,127.00	0.12
309	000997	新大陆	15,700	508,366.00	0.12

310	002185	华天科技	49,400	498,940.00	0.11
311	300604	长川科技	11,100	498,501.00	0.11
312	600977	中国电影	46,300	496,336.00	0.11
313	600131	国网信通	27,500	486,750.00	0.11
314	600098	广州发展	76,500	478,125.00	0.11
315	600816	建元信托	162,000	477,900.00	0.11
316	688307	中润光学	16,800	477,792.00	0.11
317	688777	中控技术	10,600	476,046.00	0.11
318	603160	汇顶科技	6,700	475,901.00	0.11
319	601636	旗滨集团	93,100	466,431.00	0.11
320	601696	中银证券	42,600	455,394.00	0.10
321	600060	海信视像	19,500	448,890.00	0.10
322	600764	中国海防	13,200	448,800.00	0.10
323	002683	广东宏大	13,200	448,008.00	0.10
324	600879	航天电子	42,700	447,069.00	0.10
325	002409	雅克科技	8,100	442,989.00	0.10
326	688328	深科达	19,500	441,675.00	0.10
327	000830	鲁西化工	42,700	439,810.00	0.10
328	600778	友好集团	68,900	439,582.00	0.10
329	000967	盈峰环境	63,100	438,545.00	0.10
330	600282	南钢股份	103,900	436,380.00	0.10
331	600038	中直股份	11,200	434,672.00	0.10
332	300126	锐奇股份	58,400	423,984.00	0.10
333	603808	歌力思	51,000	423,300.00	0.10
334	600008	首创环保	139,500	421,290.00	0.10
335	601965	中国汽研	23,400	415,350.00	0.09
336	003022	联泓新科	26,200	414,746.00	0.09
337	300595	欧普康视	26,900	410,763.00	0.09
338	600208	衢州发展	138,000	408,480.00	0.09
339	000683	博源化工	84,600	405,234.00	0.09
340	002281	光迅科技	8,200	404,424.00	0.09
341	300658	延江股份	62,200	402,434.00	0.09
342	600398	海澜之家	57,500	400,200.00	0.09
343	601858	中国科传	19,900	387,055.00	0.09
344	300601	康泰生物	25,400	385,826.00	0.09
345	002850	科达利	3,400	384,778.00	0.09
346	002262	恩华药业	18,400	382,352.00	0.09
347	688015	交控科技	18,300	381,372.00	0.09
348	300500	启迪设计	30,900	375,435.00	0.09
349	600563	法拉电子	3,400	370,906.00	0.08
350	688286	敏芯股份	5,200	367,588.00	0.08
351	688004	博汇科技	18,300	364,170.00	0.08
352	688030	山石网科	22,500	359,775.00	0.08

353	688032	禾迈股份	3,600	359,496.00	0.08
354	603589	口子窖	10,300	358,440.00	0.08
355	600685	中船防务	13,100	356,189.00	0.08
356	600390	五矿资本	61,000	355,630.00	0.08
357	002155	湖南黄金	19,900	355,215.00	0.08
358	600862	中航高科	13,500	352,080.00	0.08
359	002228	合兴包装	99,300	350,529.00	0.08
360	301165	锐捷网络	5,700	350,322.00	0.08
361	600606	绿地控股	213,300	347,679.00	0.08
362	603345	安井食品	4,200	337,764.00	0.08
363	603486	科沃斯	5,800	337,734.00	0.08
364	600056	中国医药	32,300	333,982.00	0.08
365	601098	中南传媒	25,200	330,624.00	0.08
366	600141	兴发集团	15,900	326,427.00	0.07
367	600352	浙江龙盛	31,900	324,104.00	0.07
368	002948	青岛银行	63,500	316,230.00	0.07
369	600517	国网英大	62,000	316,200.00	0.07
370	688616	西力科技	24,100	306,552.00	0.07
371	300335	迪森股份	55,800	304,668.00	0.07
372	601991	大唐发电	94,100	298,297.00	0.07
373	600582	天地科技	49,700	297,703.00	0.07
374	600351	亚宝药业	48,900	296,823.00	0.07
375	002966	苏州银行	33,400	293,252.00	0.07
376	688095	福昕软件	4,300	292,013.00	0.07
377	688295	中复神鹰	14,000	291,200.00	0.07
378	600488	津药药业	69,200	288,564.00	0.07
379	603225	新凤鸣	27,000	287,550.00	0.07
380	688233	神工股份	9,000	285,930.00	0.06
381	688718	唯赛勃	22,800	282,264.00	0.06
382	600096	云天化	12,800	281,216.00	0.06
383	300612	宣亚国际	18,600	280,860.00	0.06
384	600177	雅戈尔	38,300	279,590.00	0.06
385	002064	华峰化学	42,200	278,942.00	0.06
386	002563	森马服饰	52,800	277,728.00	0.06
387	600339	中油工程	84,700	276,969.00	0.06
388	603290	斯达半导	3,400	276,318.00	0.06
389	300737	科顺股份	57,300	276,186.00	0.06
390	002625	光启技术	6,900	275,862.00	0.06
391	688296	和达科技	21,000	275,730.00	0.06
392	300763	锦浪科技	4,800	275,472.00	0.06
393	600529	山东药玻	12,400	274,536.00	0.06
394	601179	中国西电	44,600	273,844.00	0.06
395	300567	精测电子	4,500	272,745.00	0.06

396	000027	深圳能源	42,500	271,150.00	0.06
397	688667	菱电电控	5,000	266,050.00	0.06
398	688689	银河微电	11,500	265,305.00	0.06
399	600765	中航重机	15,700	265,016.00	0.06
400	002821	凯莱英	3,000	264,750.00	0.06
401	601399	国机重装	88,200	264,600.00	0.06
402	600418	江淮汽车	6,600	264,594.00	0.06
403	002659	凯文教育	52,300	263,592.00	0.06
404	688273	麦澜德	8,700	262,827.00	0.06
405	300736	百邦科技	24,800	262,632.00	0.06
406	601997	贵阳银行	42,000	262,080.00	0.06
407	603939	益丰药房	10,700	261,829.00	0.06
408	301081	严牌股份	27,100	261,515.00	0.06
409	002831	裕同科技	11,100	259,962.00	0.06
410	600928	西安银行	65,100	255,192.00	0.06
411	000723	美锦能源	58,800	254,016.00	0.06
412	002025	航天电器	4,900	251,909.00	0.06
413	002649	博彦科技	17,200	249,916.00	0.06
414	601118	海南橡胶	52,500	247,800.00	0.06
415	601019	山东出版	26,100	247,167.00	0.06
416	000729	燕京啤酒	19,100	246,963.00	0.06
417	601139	深圳燃气	38,700	246,132.00	0.06
418	002429	兆驰股份	56,100	245,718.00	0.06
419	002999	天禾股份	35,200	245,696.00	0.06
420	600642	申能股份	28,500	245,100.00	0.06
421	601966	玲珑轮胎	16,600	243,522.00	0.06
422	603311	金海高科	22,000	243,320.00	0.06
423	688529	豪森智能	13,400	240,396.00	0.05
424	002430	杭氧股份	12,300	238,866.00	0.05
425	688207	格灵深瞳	15,800	238,580.00	0.05
426	300659	中孚信息	16,200	235,548.00	0.05
427	601158	重庆水务	50,400	233,856.00	0.05
428	300748	金力永磁	9,800	233,632.00	0.05
429	002788	鹭燕医药	27,200	233,104.00	0.05
430	600995	南网储能	23,800	232,764.00	0.05
431	002152	广电运通	17,300	232,512.00	0.05
432	601128	常熟银行	31,300	230,681.00	0.05
433	000423	东阿阿胶	4,400	230,120.00	0.05
434	300751	迈为股份	3,300	229,548.00	0.05
435	688419	耐科装备	6,100	227,408.00	0.05
436	603786	科博达	4,100	227,181.00	0.05
437	688052	纳芯微	1,300	226,837.00	0.05
438	002423	中粮资本	18,500	226,255.00	0.05

439	603386	骏亚科技	17,800	225,170.00	0.05
440	600820	隧道股份	36,800	224,480.00	0.05
441	300978	东箭科技	20,100	224,316.00	0.05
442	688188	柏楚电子	1,700	223,822.00	0.05
443	301332	德尔玛	21,800	223,232.00	0.05
444	600970	中材国际	26,000	223,080.00	0.05
445	600526	菲达环保	46,000	220,800.00	0.05
446	300272	开能健康	33,400	219,438.00	0.05
447	300582	英飞特	17,100	219,222.00	0.05
448	688051	佳华科技	8,800	219,032.00	0.05
449	601611	中国核建	23,700	217,803.00	0.05
450	688520	神州细胞	3,600	215,460.00	0.05
451	300476	胜宏科技	1,600	215,008.00	0.05
452	000921	海信家电	8,300	213,310.00	0.05
453	301353	普莱得	8,400	212,688.00	0.05
454	002120	韵达股份	31,700	212,390.00	0.05
455	600435	北方导航	13,400	208,906.00	0.05
456	688119	中钢洛耐	49,800	208,164.00	0.05
457	688657	浩辰软件	4,900	208,103.00	0.05
458	600153	建发股份	19,900	206,363.00	0.05
459	600988	赤峰黄金	8,200	204,016.00	0.05
460	600569	安阳钢铁	104,000	203,840.00	0.05
461	300787	海能实业	14,500	200,825.00	0.05
462	000429	粤高速A	15,000	199,950.00	0.05
463	300699	光威复材	6,300	199,521.00	0.05
464	301267	华夏眼科	10,400	199,368.00	0.05
465	600925	苏能股份	38,000	198,740.00	0.05
466	002508	老板电器	10,300	195,803.00	0.04
467	600617	国新能源	71,200	193,664.00	0.04
468	002756	永兴材料	6,000	190,500.00	0.04
469	601156	东航物流	14,500	189,805.00	0.04
470	600392	盛和资源	14,400	189,648.00	0.04
471	600594	益佰制药	49,000	188,650.00	0.04
472	601229	上海银行	17,600	186,736.00	0.04
473	600350	山东高速	17,500	186,550.00	0.04
474	300162	雷曼光电	24,400	185,440.00	0.04
475	688669	聚石化学	9,800	184,926.00	0.04
476	603118	共进股份	16,300	183,701.00	0.04
477	601077	渝农商行	25,700	183,498.00	0.04
478	688088	虹软科技	3,800	183,350.00	0.04
479	600288	大恒科技	17,800	182,984.00	0.04
480	000598	兴蓉环境	25,200	181,692.00	0.04
481	002738	中矿资源	5,600	180,096.00	0.04

482	301103	何氏眼科	8,100	179,820.00	0.04
483	601166	兴业银行	7,700	179,718.00	0.04
484	000404	长虹华意	24,800	176,080.00	0.04
485	601169	北京银行	25,500	174,165.00	0.04
486	603605	珀莱雅	2,100	173,859.00	0.04
487	300395	菲利华	3,400	173,740.00	0.04
488	002436	兴森科技	13,100	173,444.00	0.04
489	601658	邮储银行	31,700	173,399.00	0.04
490	300400	劲拓股份	10,200	171,768.00	0.04
491	002353	杰瑞股份	4,900	171,500.00	0.04
492	600901	江苏金租	28,000	169,680.00	0.04
493	688079	美迪凯	16,900	169,676.00	0.04
494	688518	联贏激光	8,300	169,237.00	0.04
495	002327	富安娜	22,800	169,176.00	0.04
496	002787	华源控股	20,700	169,119.00	0.04
497	688558	国盛智科	6,700	169,108.00	0.04
498	603987	康德萊	21,900	168,630.00	0.04
499	688002	睿创微纳	2,400	167,328.00	0.04
500	688033	天宜新材	26,100	167,301.00	0.04
501	002517	恺英网络	8,500	164,135.00	0.04
502	002394	联发股份	19,800	162,954.00	0.04
503	603787	新日股份	13,200	162,624.00	0.04
504	300558	贝达药业	2,800	162,260.00	0.04
505	688508	芯朋微	2,900	161,878.00	0.04
506	601963	重庆银行	14,900	161,814.00	0.04
507	600548	深高速	15,400	161,238.00	0.04
508	002739	万达电影	14,100	161,163.00	0.04
509	600036	招商银行	3,500	160,825.00	0.04
510	000878	云南铜业	12,600	160,272.00	0.04
511	002271	东方雨虹	14,900	159,877.00	0.04
512	002267	陕天然气	21,100	159,727.00	0.04
513	000831	中国稀土	4,400	158,928.00	0.04
514	601398	工商银行	20,900	158,631.00	0.04
515	601818	光大银行	37,700	156,455.00	0.04
516	603385	惠达卫浴	23,400	155,376.00	0.04
517	600016	民生银行	32,700	155,325.00	0.04
518	688309	恒誉环保	8,600	154,026.00	0.03
519	601939	建设银行	16,300	153,872.00	0.03
520	002156	通富微电	6,000	153,720.00	0.03
521	688565	力源科技	16,600	153,550.00	0.03
522	002807	江阴银行	32,100	152,475.00	0.03
523	300410	正业科技	20,200	152,308.00	0.03
524	601288	农业银行	25,900	152,292.00	0.03

525	002242	九阳股份	16,000	152,000.00	0.03
526	688153	唯捷创芯	4,900	151,949.00	0.03
527	300150	世纪瑞尔	30,200	151,604.00	0.03
528	002384	东山精密	4,000	151,080.00	0.03
529	600373	中文传媒	14,700	150,969.00	0.03
530	002004	华邦健康	36,200	150,954.00	0.03
531	601318	中国平安	2,700	149,796.00	0.03
532	600132	重庆啤酒	2,700	148,770.00	0.03
533	000415	渤海租赁	44,500	148,185.00	0.03
534	601328	交通银行	18,500	148,000.00	0.03
535	301232	飞沃科技	4,800	147,504.00	0.03
536	601006	大秦铁路	22,300	147,180.00	0.03
537	600015	华夏银行	18,600	147,126.00	0.03
538	601988	中国银行	26,000	146,120.00	0.03
539	002391	长青股份	24,900	145,914.00	0.03
540	002454	松芝股份	18,900	145,908.00	0.03
541	600688	上海石化	50,900	145,065.00	0.03
542	688133	泰坦科技	6,300	145,026.00	0.03
543	002318	久立特材	6,200	145,018.00	0.03
544	600839	四川长虹	14,900	144,828.00	0.03
545	600461	XD 洪城环	15,000	144,600.00	0.03
546	603298	杭叉集团	6,900	144,555.00	0.03
547	600663	陆家嘴	16,300	144,418.00	0.03
548	601211	国泰海通	7,500	143,700.00	0.03
549	601857	中国石油	16,800	143,640.00	0.03
550	600295	鄂尔多斯	16,300	141,973.00	0.03
551	688234	天岳先进	2,400	140,520.00	0.03
552	601000	唐山港	34,600	140,476.00	0.03
553	600329	XD 达仁堂	4,200	140,112.00	0.03
554	603323	苏农银行	24,900	139,689.00	0.03
555	300196	长海股份	11,400	139,080.00	0.03
556	601088	中国神华	3,400	137,836.00	0.03
557	688260	昀冢科技	8,300	136,784.00	0.03
558	002603	以岭药业	9,700	136,770.00	0.03
559	688057	金达莱	11,200	136,640.00	0.03
560	002032	苏 泊 尔	2,600	136,214.00	0.03
561	605001	威奥股份	18,800	135,172.00	0.03
562	600968	海油发展	33,000	134,640.00	0.03
563	300614	百川畅银	10,000	133,100.00	0.03
564	601992	金隅集团	87,300	132,696.00	0.03
565	300339	润和软件	2,600	132,158.00	0.03
566	600528	中铁工业	17,900	132,102.00	0.03
567	002839	张家港行	29,200	131,400.00	0.03

568	600170	上海建工	54,900	131,211.00	0.03
569	600020	中原高速	27,300	130,494.00	0.03
570	300002	神州泰岳	11,000	129,800.00	0.03
571	603606	东方电缆	2,500	129,275.00	0.03
572	600377	宁沪高速	8,400	128,856.00	0.03
573	688183	生益电子	2,500	128,000.00	0.03
574	000513	丽珠集团	3,500	126,140.00	0.03
575	601608	中信重工	28,600	124,982.00	0.03
576	600348	华阳股份	18,700	124,542.00	0.03
577	600812	华北制药	20,100	124,218.00	0.03
578	600337	美克家居	56,100	123,981.00	0.03
579	002078	太阳纸业	9,200	123,832.00	0.03
580	600000	浦发银行	8,900	123,532.00	0.03
581	003031	中瓷电子	2,300	122,383.00	0.03
582	002845	同兴达	8,500	121,550.00	0.03
583	300803	指南针	1,500	120,990.00	0.03
584	688588	凌志软件	8,300	120,931.00	0.03
585	000553	安道麦 A	16,700	120,574.00	0.03
586	300929	华骐环保	11,400	120,384.00	0.03
587	301236	软通动力	2,200	120,208.00	0.03
588	600028	中国石化	21,300	120,132.00	0.03
589	688425	铁建重工	29,400	119,952.00	0.03
590	688113	联测科技	3,300	119,427.00	0.03
591	688118	普元信息	5,300	118,455.00	0.03
592	688701	卓锦股份	14,300	117,832.00	0.03
593	688355	明志科技	6,700	117,719.00	0.03
594	002044	美年健康	22,900	117,706.00	0.03
595	603186	华正新材	3,900	117,702.00	0.03
596	688297	中无人机	2,200	117,480.00	0.03
597	002385	大北农	28,800	116,352.00	0.03
598	603979	金诚信	2,500	116,100.00	0.03
599	601319	中国人保	13,300	115,843.00	0.03
600	001965	招商公路	9,600	115,200.00	0.03
601	600900	长江电力	3,800	114,532.00	0.03
602	688209	英集芯	6,200	114,514.00	0.03
603	002160	常铝股份	26,500	114,480.00	0.03
604	002637	赞宇科技	11,400	113,772.00	0.03
605	002734	利民股份	6,200	113,460.00	0.03
606	000034	神州数码	3,000	112,920.00	0.03
607	002595	豪迈科技	1,900	112,518.00	0.03
608	601002	晋亿实业	22,700	111,911.00	0.03
609	300206	理邦仪器	9,300	111,786.00	0.03
610	000785	居然智家	36,200	110,410.00	0.03

611	688595	芯海科技	2,900	108,431.00	0.02
612	603129	春风动力	500	108,250.00	0.02
613	003035	南网能源	23,500	107,865.00	0.02
614	688367	工大高科	6,100	107,665.00	0.02
615	300594	朗进科技	5,900	107,380.00	0.02
616	600908	XD 无锡银	17,000	107,270.00	0.02
617	688509	正元地信	25,000	107,250.00	0.02
618	003042	中农联合	6,400	106,944.00	0.02
619	601668	中国建筑	18,400	106,168.00	0.02
620	002465	海格通信	7,600	105,944.00	0.02
621	600064	南京高科	13,700	105,627.00	0.02
622	002209	达意隆	8,400	105,420.00	0.02
623	002261	拓维信息	3,400	105,230.00	0.02
624	600483	福能股份	10,900	105,076.00	0.02
625	600819	耀皮玻璃	17,900	104,178.00	0.02
626	603868	飞科电器	2,900	104,023.00	0.02
627	600035	楚天高速	24,400	103,456.00	0.02
628	601298	青岛港	11,900	103,411.00	0.02
629	300909	汇创达	3,900	102,999.00	0.02
630	002054	德美化工	14,900	102,512.00	0.02
631	600598	北大荒	7,100	102,382.00	0.02
632	688533	上声电子	3,800	102,334.00	0.02
633	300743	天地数码	5,100	102,102.00	0.02
634	000887	中鼎股份	5,800	102,022.00	0.02
635	301299	卓创资讯	1,600	101,744.00	0.02
636	300012	华测检测	8,700	101,703.00	0.02
637	300732	设研院	14,000	101,080.00	0.02
638	605266	健之佳	4,800	100,944.00	0.02
639	600580	卧龙电驱	5,100	100,827.00	0.02
640	000686	东北证券	13,100	99,953.00	0.02
641	300509	新美星	11,500	98,440.00	0.02
642	688536	思瑞浦	700	97,104.00	0.02
643	600661	昂立教育	9,100	96,915.00	0.02
644	302132	中航成飞	1,100	96,734.00	0.02
645	600802	福建水泥	20,800	96,720.00	0.02
646	603601	再升科技	23,800	96,628.00	0.02
647	000066	中国长城	6,500	96,200.00	0.02
648	300746	汉嘉设计	6,100	95,587.00	0.02
649	300912	凯龙高科	6,500	95,485.00	0.02
650	601113	华鼎股份	24,100	95,195.00	0.02
651	688022	瀚川智能	6,400	94,848.00	0.02
652	600755	厦门国贸	15,600	94,380.00	0.02
653	600316	洪都航空	2,500	94,250.00	0.02

654	603916	苏博特	10,400	94,224.00	0.02
655	688711	宏微科技	5,300	93,227.00	0.02
656	603367	辰欣药业	6,600	92,532.00	0.02
657	603811	诚意药业	10,000	92,300.00	0.02
658	300935	盈建科	3,700	91,390.00	0.02
659	300535	达威股份	5,500	91,245.00	0.02
660	300251	光线传媒	4,500	91,215.00	0.02
661	300866	安克创新	800	90,880.00	0.02
662	601016	节能风电	30,900	89,301.00	0.02
663	600269	赣粤高速	17,600	89,056.00	0.02
664	600859	王府井	6,400	88,896.00	0.02
665	600408	安泰集团	43,100	88,786.00	0.02
666	301115	联检科技	5,700	88,293.00	0.02
667	001389	广合科技	1,500	88,155.00	0.02
668	300964	本川智能	2,100	87,633.00	0.02
669	002128	电投能源	4,400	87,032.00	0.02
670	600022	山东钢铁	65,900	85,670.00	0.02
671	600674	川投能源	5,300	85,012.00	0.02
672	601163	三角轮胎	6,000	84,300.00	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	002266	浙富控股	7,290,671.00	1.53
2	000783	长江证券	6,313,219.00	1.32
3	002410	广联达	6,200,254.00	1.30
4	300207	欣旺达	5,948,624.00	1.25
5	002668	TCL 智家	5,773,324.00	1.21
6	002373	千方科技	5,560,112.00	1.17
7	002056	横店东磁	5,544,231.00	1.16
8	002906	华阳集团	5,348,492.00	1.12
9	600998	九州通	5,024,922.00	1.05
10	600699	均胜电子	4,995,822.00	1.05
11	000021	深科技	4,847,633.00	1.02
12	002624	完美世界	4,813,723.00	1.01
13	300677	英科医疗	4,811,100.00	1.01
14	600873	梅花生物	4,763,463.00	1.00
15	300014	亿纬锂能	4,762,602.46	1.00
16	000960	锡业股份	4,736,350.00	0.99
17	600258	首旅酒店	4,639,134.00	0.97

18	600420	国药现代	4,509,631.00	0.95
19	000682	东方电子	4,451,264.00	0.93
20	000039	中集集团	4,436,589.52	0.93

#### 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	000960	锡业股份	6,943,013.00	1.46
2	002266	浙富控股	6,729,005.00	1.41
3	000878	云南铜业	6,423,917.00	1.35
4	002906	华阳集团	6,423,418.00	1.35
5	002668	TCL 智家	5,938,553.00	1.25
6	002558	巨人网络	5,886,384.00	1.23
7	000893	亚钾国际	5,789,512.00	1.21
8	601717	郑煤机	5,780,767.00	1.21
9	600420	国药现代	5,632,247.45	1.18
10	600582	天地科技	5,549,073.00	1.16
11	000039	中集集团	5,547,896.44	1.16
12	002557	洽洽食品	5,504,249.54	1.15
13	300677	英科医疗	5,461,952.00	1.15
14	000060	中金岭南	5,456,730.00	1.14
15	000401	冀东水泥	5,424,851.00	1.14
16	600096	云天化	5,258,427.00	1.10
17	688772	珠海冠宇	5,087,832.57	1.07
18	002410	广联达	5,025,466.00	1.05
19	600361	创新新材	4,999,560.00	1.05
20	000537	中绿电	4,838,009.55	1.01

#### 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	1,758,267,119.47
卖出股票收入（成交）总额	1,771,025,477.83

#### 7.5 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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-

4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	3,100.20	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,100.20	0.00

## 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

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	123257	安克转债	31	3,100.20	0.00

## 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 本基金投资的前十名证券的发行主体本期受到监管部门立案调查或报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形说明

报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体中，国金证券股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到上海证券交易所的公开谴责。

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超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

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	1,942.86
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	1,942.86

### 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	7,301	51,648.92	6,257,318.27	1.6594%	370,831,458.42	98.3406%
中信建投	2,178	43,048.23	927,647.67	0.9894%	92,831,401.03	99.0106%

量化进取 C						
合计	9,362	50,293.51	7,184,965.94	1.5260%	463,662,859.45	98.4740%

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	229,612.86	0.0609%
	中信建投量化进取 C	0.00	0.0000%
	合计	229,612.86	0.0488%

## 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	425,522,603.75	117,449,700.99
本报告期基金总申购份额	656,249.18	182,887.60
减：本报告期基金总赎回份额	49,090,076.24	23,873,539.89
本报告期基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-	-
本报告期末基金份额总额	377,088,776.69	93,759,048.70

## § 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

安永华明会计师事务所（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

本报告期内，未发生基金管理人及其高级管理人员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，未发生基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员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	3,526,778,959.10	100.00%	1,554,162.38	100.00%	-

注：1、本基金的证券交易结算模式为券商结算模式，表中的证券交易成交金额及应支付的佣金等数据，为委托证券公司办理证券投资及佣金支付情况。

2、本报告期内，本基金办理证券投资委托的证券公司未发生变更。

3、根据中国证监会《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》及《中信建投基金管理有限公司公募基金证券交易费用管理办法》，基金管理人选择证券公司参与证券交易的标准和程序如下：

（1）选择证券公司参与证券交易的标准

基金管理人根据自身合规风控能力、信息系统建设水平、运营及交易服务能力、研究服务能力、产品管理规模等情况，审慎选择财务状况良好，经营稳健规范，系统运行安全，合规风控能力、运营及交易服务能力、研究服务能力较强的证券公司参与证券交易。

#### （2）选择证券公司参与证券交易的程序

基金管理人指定专人负责参与证券交易的证券公司的准入评估，并根据评估结果完成与证券公司的协议签订及交易佣金费率的确定等工作。基金管理人建立了“证券研究报告质量评分机制”“证券综合研究服务评分体系”等，每季度组织公募投研部门完成对已合作证券公司的研究服务打分评价，评价结果是确定/调整证券公司股票交易成交金额及佣金比例限制的参考。

#### 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	140,485.72	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	关于警惕冒用中信建投基金管理有限公司名义进行诈骗活动的重要通知	规定网站	2025-01-14
2	中信建投基金管理有限公司旗下全部基金 2024 年第 4 季度报告提示性公告	规定报刊	2025-01-22
3	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 4 季度报告	规定网站	2025-01-22
4	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	2025-03-07
5	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	2025-03-07
6	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	2025-03-07
7	中信建投基金管理有限公司旗	规定网站	2025-03-31

	下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度）		
8	中信建投基金管理有限公司旗下全部基金 2024 年年度报告提示性公告	规定报刊	2025-03-31
9	中信建投量化进取 6 个月持有期混合型证券投资基金 2024 年年度报告	规定网站	2025-03-31
10	中信建投基金管理有限公司关于运用固有资金投资旗下权益类公募基金的公告	规定网站、规定报刊	2025-04-11
11	中信建投基金管理有限公司旗下全部基金 2025 年第 1 季度报告提示性公告	规定报刊	2025-04-22
12	中信建投量化进取 6 个月持有期混合型证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	规定网站	2025-04-22

## § 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；
- 7、中国证监会要求的其他文件。

## 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

二〇二五年八月二十九日