
中信证券量化优选股票型集合资产管理计划

2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：中信证券资产管理有限公司

基金托管人：中信银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二四年三月二十九日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 3 月 28 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料已经审计。毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自 2023 年 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

1.2 目录

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

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	58
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	63
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	64
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	64
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	64
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细	64
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	64
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	64
8.12 投资组合报告附注	64
§9 基金份额持有人信息	65
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	65
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	66
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况	66
§10 开放式基金份额变动	66
§11 重大事件揭示	66
11.1 基金份额持有人大会决议	66
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	66
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	67
11.4 基金投资策略的改变	67
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	67
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	67
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	67
11.8 其他重大事件	68
§12 影响投资者决策的其他重要信息	69
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况	69
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	69
§13 备查文件目录	69
13.1 备查文件目录	69
13.2 存放地点	69
13.3 查阅方式	70

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中信证券量化优选股票型集合资产管理计划	
基金简称	中信证券量化优选	
基金主代码	900029	
交易代码	900029	
基金运作方式	契约开放式	
基金合同生效日	2020 年 5 月 22 日	
基金管理人	中信证券资产管理有限公司	
基金托管人	中信银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	304,405,082.71 份	
基金合同存续期	自 2020 年 5 月 22 日起至 2024 年 12 月 31 日	
下属分级基金的基金简称	中信证券量化优选 A	中信证券量化优选 C
下属分级基金的交易代码	900029	900030
报告期末下属分级基金的份额总额	149,422,734.69 份	154,982,348.02 份

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

2.2 基金产品说明

投资目标	本集合计划通过量化模型，合理配置资产权重，精选个股，坚持价值和成长为核心的长期稳健型投资，在充分控制投资风险的前提下，力求并创造持续稳定的相对收益。
投资策略	通过量化模型构建投资组合进行选股，主要投资策略有权益类资产投资策略、债权类资产投资策略和衍生品投资策略等。
业绩比较基准	沪深 300 指数收益率*95%+银行活期存款利率（税后）*5%
风险收益特征	本集合计划为股票型集合计划，其风险收益水平高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中信证券资产管理有限公司	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	梁源	姜敏
	联系电话	010-60838899	4006800000
	电子邮箱	liangyuan@citics.com	jiangmin@citicbank.com
客户服务电话		95548 转 5	95558
传真		(010) 60836627	010-85230024
注册地址		北京市丰台区金丽南路 3 号院 2 号楼 1 至 16 层 01 内六层 1-288 室	北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层
办公地址		北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证	北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼

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

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2023 年		2022 年		2021 年	
	中信证券量化优选 A	中信证券量化优选 C	中信证券量化优选 A	中信证券量化优选 C	中信证券量化优选 A	中信证券量化优选 C
本期已实现收益	-3,379,894.50	-5,263,340.05	-66,776,755.92	-66,819,752.50	9,175,807.00	21,827.49
本期利润	-4,190,837.26	-6,074,217.44	-74,705,443.52	-74,628,774.82	-4,435,242.20	-9,980,445.78
加权平均基金份额本期利润	-0.0257	-0.0386	-0.3904	-0.4135	-0.0170	-0.0380
本期加权平均净值利润率	-2.67%	-4.11%	-38.93%	-41.82%	-1.28%	-2.89%
本期基金份额净值增长率	-3.52%	-4.30%	-28.28%	-28.85%	4.06%	3.23%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
	中信证券量化优选 A	中信证券量化优选 C	中信证券量化优选 A	中信证券量化优选 C	中信证券量化优选 A	中信证券量化优选 C
期末可供分配利润	-13,734,785.25	-25,671,892.72	-10,547,601.19	-22,041,949.09	65,021,924.39	41,979,357.33
期末可供分	-0.0919	-0.1656	-0.0588	-0.1327	0.3123	0.2057

配基金份额利润						
期末基金资产净值	135,687,949.44	136,746,088.44	168,831,243.88	153,087,001.37	273,238,428.65	264,439,201.98
期末基金份额净值	0.9081	0.8823	0.9412	0.9219	1.3123	1.2957
3.1.3 累计期末指标	2023 年末		2022 年末		2021 年末	
	中信证券量化优选 A	中信证券量化优选 C	中信证券量化优选 A	中信证券量化优选 C	中信证券量化优选 A	中信证券量化优选 C
基金份额累计净值增长率	3.39%	0.46%	7.16%	4.96%	49.41%	47.52%

注：①所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

②本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

③期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1. 中信证券量化优选 A:

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-2.29%	0.79%	-6.65%	0.75%	4.36%	0.04%
过去六个月	-8.96%	0.81%	-10.17%	0.81%	1.21%	0.00%
过去一年	-3.52%	0.78%	-10.79%	0.81%	7.27%	-0.03%
过去三年	-27.99%	1.30%	-32.59%	1.06%	4.60%	0.24%
自基金合同生效起至今	3.39%	1.31%	-11.45%	1.09%	14.84%	0.22%

2. 中信证券量化优选 C:

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-2.50%	0.79%	-6.65%	0.75%	4.15%	0.04%
过去六个月	-9.33%	0.81%	-10.17%	0.81%	0.84%	0.00%
过去一年	-4.30%	0.78%	-10.79%	0.81%	6.49%	-0.03%
过去三年	-29.71%	1.30%	-32.59%	1.06%	2.88%	0.24%
自基金合同生效起至今	0.46%	1.31%	-11.45%	1.09%	11.91%	0.22%

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

中信证券量化优选股票型集合资产管理计划

自基金合同生效以来份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2020 年 5 月 22 日至 2023 年 12 月 31 日)

1、中信证券量化优选 A



2、中信证券量化优选 C

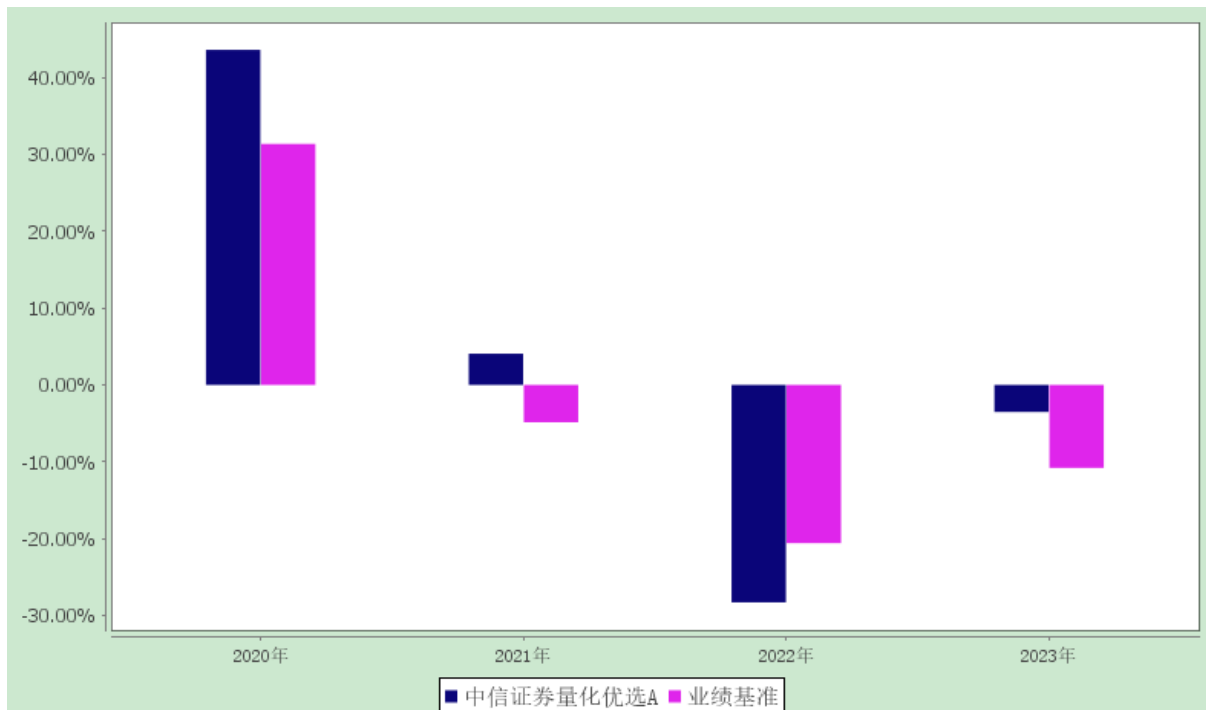


3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

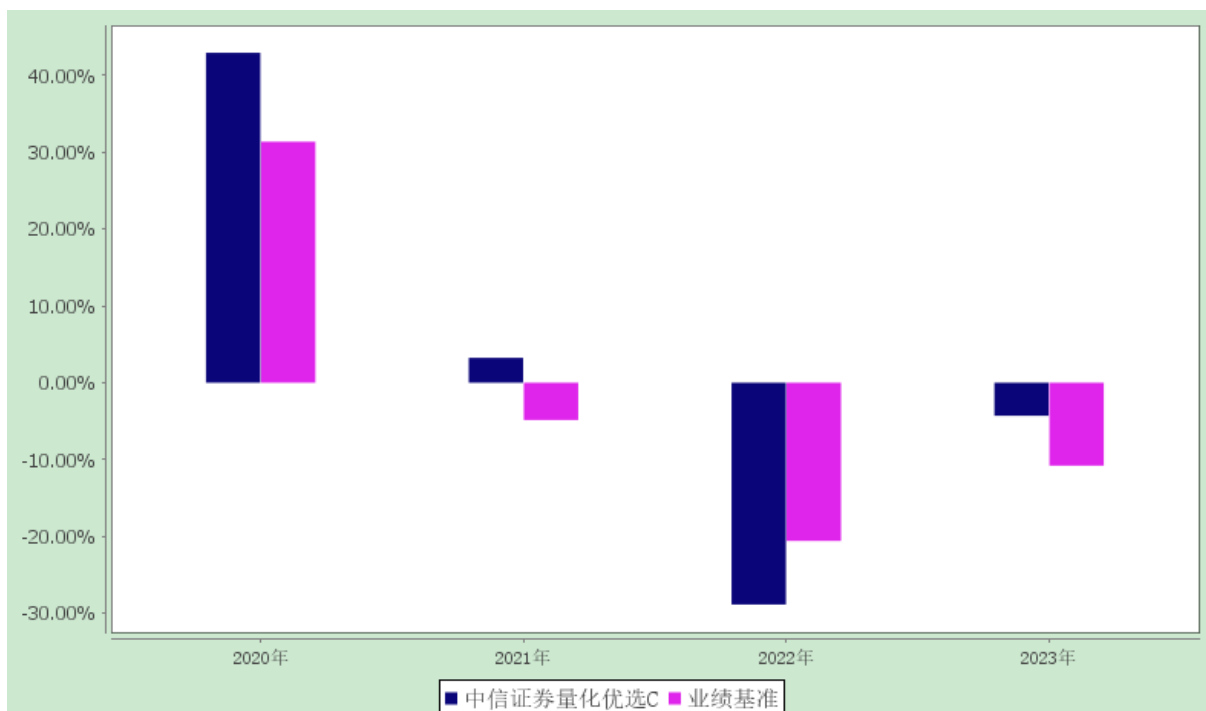
中信证券量化优选股票型集合资产管理计划

自基金合同生效以来净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图

1、中信证券量化优选 A



2、中信证券量化优选 C



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

3.3 过去三年基金的利润分配情况

过去三年无利润分配。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

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

中信证券资管根据《证券公司大集合资产管理业务适用关于规范金融机构资产管理业务的指导意见操作指引》的要求，截至 2023 年 12 月 31 日，旗下已有 19 只大集合产品完成公募化改造，分别为“中信证券六个月滚动持有债券型集合资产管理计划”、“中信证券红利价值一年持有混合型集合资产管理计划”、“中信证券臻选价值成长混合型集合资产管理计划”、“中信证券量化优选股票型集合资产管理计划”、“中信证券卓越成长两年持有期混合型集合资产管理计划”、“中信证券稳健回报混合型集合资产管理计划”、“中信证券臻选回报两年持有期混合型集合资产管理计划”、“中信证券成长动力混合型集合资产管理计划”、“中信证券增益十八个月持有期债券型集合资产管理计划”、“中信证券信远一年持有期混合型集合资产管理计划”、“中信证券债券优化一年持有期债券型集合资产管理计划”、“中信证券品质生活混合型集合资产管理计划”、“中信证券财富优选一年持有期混合型基金中基金（FOF）集合资产管理计划”、“中信证券信盈一年持有期债券型集合资产管理计划”、“中信证券增利一年定期开放债券型集合资产管理计划”、“中信证券债券增强六个月持有期债券型集合

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理的简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
魏宇	本基金的基金经理	2022-02-08	-	13	男，香港大学统计学博士。现任中信证券资产管理有限公司量化投资经理。2010 年加入北京尊嘉资产管理有限公司，从事量化策略的研究与开发，并参与量化私募产品的管理。2014 年加入中金基金管理有限公司，曾任投资经理管理量化专户产品，后任基金经理管理量化公募基金，获得“英华奖”两次。2021 年加入中信证券，主要负责资产管理业务量化类产品的投资管理工作。
李天颖	本基金的基金经理助理	2022-07-29	-	12	女，英国约克大学金融管理学硕士。现任中信证券资产管理有限公司固定收益投资经理。曾任中国银河证券交易员，中信信诚资产管理有限公司债券投资经理。2017 年加入中信证券，负责资产管理业务债券产品的投资工作，有多年从业经验。

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

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

③证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

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

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

4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

姓名	产品类型	产品数量（只）	资产净值(元)	任职时间
魏宇	公募基金	1	272,434,037.88	2017 年 03 月 28 日
	私募资产管理计划	-	-	-
	其他组合	-	-	-
	合计	1	272,434,037.88	

注：任职时间为投资经理在行业内首次管理本类产品的时间。

4.1.4 基金经理薪酬机制

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《中信证券资产管理有限公司公平交易制度》。公司通过科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

报告期内未发现本基金存在异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

市场层面，2023 年全年整体是下跌的表现，中证全指和万得全 A 分别下跌 7.04% 和 5.19%。2023 年各规模指数整体偏小市值风格，大盘的沪深 300 指数下跌 11.38%，中盘的中证 500 指数下跌 7.42%，中小盘的中证 1000 指数下跌 6.28%，小盘的中证 2000 指数逆势上涨 5.57%。

行业层面，2023 年通信、传媒、煤炭表现强势，分别上涨 24.78%、19.84% 和 13.39%，消费者服务、房地产、电力设备及新能源表现最差，分别下跌 41.18%、24.80% 和 24.65%。中信 5 大风格指数上看，2023 年稳定类表现最好，逆势上涨 2.14%，消费类表现最差，下跌 7.90%，其余均有 2%-7% 的跌幅。从上下游产业链角度看，2023 年 TMT 表现最佳，中游制造、下游消费表现最差，上游原材料、金融地产以及基建表现居中。

风格上看，市值层面，整体看 2023 年小市值风格明显，但极端大市值表现也不错。万得超大盘股指数逆势上涨 7.64%，表现较好，其他中盘股、小盘股、微盘股指数表现依次变好。估值方面，2023 年呈现明显的价值风格，无论是在大市值、中市值还是小市值中，价值收益均明显高于成长。

2023 年量化优选 A 全年绝对收益-3.52%，超额收益 7.27%。本年度超额收益位于市场同类产品前列，未来会继续秉持投资风格，力争创造更稳健的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2023 年 12 月 31 日，中信证券量化优选 A 基金份额净值为 0.9081 元，本报告期份额净值增长率为-3.52%；中信证券量化优选 C 基金份额净值为 0.8823 元，本报告期份额净值增长率为-4.30%；同期业绩比较基准增长率为-10.79%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前 A 股估值、成交、上市公司行为等一系列指标显示资产价格可能已经隐含了过于悲观的预期，而内外部环境正显现积极变化，国内稳增长政策仍在积极发力，美联储释放鸽派信号，环境边际变化对 A 股市场相对有利。同时，A 股整体估值处于历史较极端水平，估值风险充分释放，看好春季行情。

板块节奏：一季度关注大盘成长、核心资产；二、三季度关注成长板块；三、四季度关注高股息+成长哑铃型策略；周期板块基于地产与美元周期，按照供给端逻辑操作。

具体板块方面，除了有选择地对待一致预期行业（科技成长、医药、出海），2024 年上游周期和低估值央国企的投资机会也值得关注。一方面，这两类标的在当前宏观环境下盈利能力相对强，

经营状况相对稳定。另一方面，这两类标的目前公募配置的比例仍偏低。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

报告期内未进行收益分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金 2023 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，中信证券资产管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，中信证券资产管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的 2023 年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§6 审计报告

毕马威华振审字第 2403569 号

中信证券量化优选股票型集合资产管理计划全体份额持有人：

6.1 审计意见

我们审计了后附的中信证券量化优选股票型集合资产管理计划（以下简称“该基金”）财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表，2023 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。

我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了该基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及 2023 年度的经营成果

和净资产变动情况。

6.2 形成审计意见的基础

我们按照中国注册会计师审计准则（以下简称“审计准则”）的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于该基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。

6.3 其他信息

该基金管理人中信证券资产管理有限公司（以下简称“该基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括该基金 2023 年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。

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

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

基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。

6.4 管理层和治理层对财务报表的责任

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

在编制财务报表时，该基金管理人管理层负责评估该基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非该基金预计在清算时资产无法按照公允价值处置。

该基金管理人治理层负责监督该基金的财务报告过程。

6.5 注册会计师对财务报表审计的责任

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

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

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

(2)了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(3)评价该基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(4)对该基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对该基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致该基金不能持续经营。

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

我们与该基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙） 中国注册会计师
张楠 倪益
中国北京东长安街1号东方广场东2座办公楼8层

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：中信证券量化优选股票型集合资产管理计划

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
资产：			

货币资金	7.4.7.1	3,290,359.12	13,704,214.71
结算备付金		2,488,394.17	2,716,294.73
存出保证金		125,920.70	177,035.97
交易性金融资产	7.4.7.2	266,803,907.33	307,050,438.46
其中：股票投资		249,524,781.31	288,916,319.59
基金投资		-	-
债券投资		17,279,126.02	18,134,118.87
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
债权投资	7.4.7.5	-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资	7.4.7.6	-	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-	-
应收清算款		2,469,383.79	5,205,888.09
应收股利		-	-
应收申购款		557.71	52,704.67
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.8	-	-
资产总计		275,178,522.82	328,906,576.63
负债和净资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		1,287,939.22	5,077,410.96
应付赎回款		287,039.68	359,803.20
应付管理人报酬		232,436.26	277,186.36
应付托管费		34,865.44	41,577.95
应付销售服务费		186,216.94	309,252.42
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.9	715,987.40	923,100.49
负债合计		2,744,484.94	6,988,331.38
净资产：			

实收基金	7.4.7.10	304,405,082.71	345,442,390.71
其他综合收益		-	-
未分配利润	7.4.7.11	-31,971,044.83	-23,524,145.46
净资产合计		272,434,037.88	321,918,245.25
负债和净资产总计		275,178,522.82	328,906,576.63

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，基金份额净值 0.8950 元，基金份额总额 304,405,082.71 份，其中 A 类基金份额净值 0.9081 元，基金份额总额 149,422,734.69 份；C 类基金份额净值 0.8823 元，基金份额总额 154,982,348.02 份。

7.2 利润表

会计主体：中信证券量化优选股票型集合资产管理计划

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
一、营业总收入		-5,320,184.74	-143,381,738.69
1.利息收入		95,601.14	101,842.12
其中：存款利息收入	7.4.7.12	95,601.14	101,842.12
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）		-3,833,065.15	-127,822,704.33
其中：股票投资收益	7.4.7.13	-8,019,456.83	-133,385,272.94
基金投资收益	7.4.7.14	-	-
债券投资收益	7.4.7.15	360,777.74	329,404.73
资产支持证券投资收益	7.4.7.16	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.17	-	-
衍生工具收益	7.4.7.18	-	-
股利收益	7.4.7.19	3,825,613.94	5,233,163.88
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益（若有）		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.20	-1,621,820.15	-15,737,709.92
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	39,099.42	76,833.44
减：二、营业总支出		4,944,869.96	5,952,479.65
1. 管理人报酬		3,050,135.97	3,717,753.89
其中：暂估管理人报酬（若有）		-	-
2. 托管费		457,520.45	557,662.99

3. 销售服务费		1,183,528.28	1,433,784.03
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失		-	-
7. 税金及附加		71,880.08	-
8. 其他费用	7.4.7.22	181,805.18	243,278.74
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-10,265,054.70	-149,334,218.34
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-10,265,054.70	-149,334,218.34
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-10,265,054.70	-149,334,218.34

7.3 净资产变动表

会计主体：中信证券量化优选股票型集合资产管理计划

本报告期：2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	345,442,390.71	-23,524,145.46	321,918,245.25
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
二、本期期初净资产	345,442,390.71	-23,524,145.46	321,918,245.25
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-41,037,308.00	-8,446,899.37	-49,484,207.37
（一）、综合收益总额	-	-10,265,054.70	-10,265,054.70
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-41,037,308.00	1,818,155.33	-39,219,152.67
其中：1.基金申购款	45,762,583.83	-2,504,318.46	43,258,265.37
2.基金赎回款	-86,799,891.83	4,322,473.79	-82,477,418.04

			4
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-
四、本期期末净资产	304,405,082.71	-31,971,044.83	272,434,037.88
项目	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	412,314,206.40	125,363,424.23	537,677,630.63
加: 会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
二、本期期初净资产	412,314,206.40	125,363,424.23	537,677,630.63
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-66,871,815.69	-148,887,569.69	-215,759,385.38
(一)、综合收益总额	-	-149,334,218.34	-149,334,218.34
(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)	-66,871,815.69	446,648.65	-66,425,167.04
其中: 1.基金申购款	49,518,273.01	2,077,677.27	51,595,950.28
2.基金赎回款	-116,390,088.70	-1,631,028.62	-118,021,117.32
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-
四、本期期末净资产	345,442,390.71	-23,524,145.46	321,918,245.2

产			5
---	--	--	---

报表附注为财务报表的组成部分。

基金管理人负责人：杨冰，主管会计工作负责人：梁源，会计机构负责人：杨天玉

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

中信证券量化优选股票型集合资产管理计划（以下简称“本基金”）是由中信证券套利宝 1 号集合资产管理计划转型而来。中信证券量化优选股票型集合资产管理计划的管理人中信证券股份有限公司于 2020 年 5 月 13 日发布《中信证券套利宝 1 号集合资产管理计划变更的公告》。根据公告，中信证券套利宝 1 号集合资产管理计划名称变更为“中信证券量化优选股票型集合资产管理计划”，中信证券套利宝 1 号集合资产管理计划份额转换为中信证券量化优选股票型集合资产管理计划份额。合同变更后，本基金的托管人、登记机构不变。自 2020 年 5 月 22 日起《中信证券量化优选股票型集合资产管理计划资产管理合同》、《中信证券量化优选股票型集合资产管理计划托管协议》生效。本基金自资产管理合同变更生效日起存续期至 2024 年 12 月 31 日。本基金的原管理人为中信证券股份有限公司（以下简称“中信证券”），托管人为中信银行股份有限公司（以下简称“中信银行”）。

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中信证券量化优选股票型集合资产管理计划资产管理合同》的有关规定，本基金的投资范围主要为：具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行的股票（包括主板、中小板、创业板以及其他经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）允许投资的股票）、债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、分离交易可转债、央行票据、中期票据、短期融资券（含超短期融资券）、可交换债券）、资产支持证券、债券回购、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许公开募集证券投资基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许公开募集证券投资基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

本基金的投资组合比例为：本基金股票投资占基金资产的 80%-95%，除股票外的其他资产占基金资产的 5%-20%。每个交易日日终扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，本

基金持有的现金或到期日在一年以内的政府债券的投资比例合计不低于基金资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：95%×沪深 300 指数收益率+5%×银行活期存款利率（税后）。

本财务报表由本基金的管理人中信证券资管于 2024 年 3 月 29 日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部（以下简称“财政部”）颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度报告和中期报告>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况、2023 年度的经营成果和净资产变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

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

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(a) 金融资产的分类

本基金的金融工具包括股票投资、债券投资等。

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

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

本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，

分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；
- 该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。本基金现无分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

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

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

(b)金融负债的分类

本基金将金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及以摊余成本计量的金融负债。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

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

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

本基金现无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

(a)金融工具的初始确认

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

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当

期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

(b)金融工具的后续计量

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

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

- 以摊余成本计量的金融资产

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

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

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

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

(c)金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；
- 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

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

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

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

(d)金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

- 以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

预期信用损失的计量

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

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

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

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

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

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

预期信用损失准备的列报

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

核销

如果本基金不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回，则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本基金确定债务人没有资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是，被减记的金融资产仍可能受到本基金催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

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

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据企业会计准则的规定采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似金融工具的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

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

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基

金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

投资收益

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

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

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

公允价值变动收益

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配收益将有所不同。本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为相应类别基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；在符合有关基金分红条件的前提下，本基金每年收益分配次数最多为 12 次，每份基金份额每次基金收益分配比例不得低于基金收益分配基准日每份基金份额可供分配利润的 10%；基金收益分配后各类基金份额净值

不能低于面值；即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，根据中基协发 [2017] 6 号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

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

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

7.4.6 税项

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

(1)根据财政部和国家税务总局发布的《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》(财税[2016]36号)、《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》(财税[2016]140号)、《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税[2017]2号)及《关于资管产品增值税有关问题的通知》(财税[2017]56号)，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，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

(2)截至财务报表批准日，财政部和国家税务总局并未就计划的所得税事项出台具体规定。2023年度，本基金没有计提所得税费用。如果涉及计划业务的有关税收法规在未来得以明确，财务报表就此所作出的估计可能会根据相关税务法规而作出调整。

(3)本基金进行的证券交易所适用的印花税税率为0.10%，根据《关于减半征收证券交易印花税的公告》(财政部税务总局公告2023年第39号)，自2023年8月28日起，证券交易所适用的印花税实施减半征收。根据财政部和国家税务总局的有关规定，证券(股票)交易印花税征收方式为单边征收，即仅对出让方征收印花税，对受让方不再征税。

(4)根据《中华人民共和国个人所得税法》、《国家税务总局关于加强企业债券利息个人所得税代扣代缴工作的通知》(国税函[2003]612号)、《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》(财税[2012]85号)及《财政部国家税务总局证监会关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》(财税[2015]101号)、《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》(财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号)及其他相关税务法规的规定，个人投资者直接投资股票或债券的，上市公司及债券兑付机构派发或支付给个人投资者的股息红利及债券利息收入应由上市公司及债券兑付机构对相应个人所得税进行代扣代缴。截至目前，由于没有专门针对计划作为上述股息红利及债券利息个人所得税代扣代缴义务人的明确税务规定，经与托管行协商一致，本基金对所取得的股息红利收入不计提股息红利个人所得税；本基金在实际取得债券利息收入时按收到的利息金额确认收入，不计提债券利息个人所得税。如果上述税务事项的最终认定结果与估计存在差异，该差异将可能对作出上述最终认定所对应期间的应代扣代缴所得税和净资产金额产生影响。

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

(6)根据财税[2014]81号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、

财税 [2016] 127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、中投信 [2021] 20 号《关于香港联合交易所有限公司上调股票交易印花税率有关提示的通知》、财政部公告 2019 年第 93 号《关于继续执行沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、财政部税务总局公告 2023 年第 2 号《关于延续实施有关个人所得税优惠政策的公告》、财政部税务总局中国证监会公告 2023 年第 23 号《关于延续实施沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》的规定，对内地企业投资者通过沪港通投资香港联交所上市股票取得的转让差价所得，计入其收入总额，依法征收企业所得税。对内地企业投资者通过沪港通投资香港联交所上市股票取得的股息红利所得，计入其收入总额，依法计征企业所得税。其中，内地居民企业连续持有 H 股满 12 个月取得的股息红利所得，依法免征企业所得税。对内地个人投资者通过沪港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称中国结算）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。内地个人投资者通过沪港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的转让差价所得和通过基金互认买卖香港基金份额取得的转让差价所得，继续暂免征收个人所得税，执行至 2027 年 12 月 31 日。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
活期存款	3,290,359.12	13,704,214.71
等于：本金	3,290,037.64	13,702,816.25
加：应计利息	321.48	1,398.46
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
其中：存款期限 1 个月以内	-	-
存款期限 1-3 个月	-	-
存款期限 3 个月以上	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
合计	3,290,359.12	13,704,214.71

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2023 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		258,596,043.00	-	249,524,781.31	-9,071,261.69
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	17,079,633.00	192,326.02	17,279,126.02	7,167.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	17,079,633.00	192,326.02	17,279,126.02	7,167.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		275,675,676.00	192,326.02	266,803,907.33	-9,064,094.69
项目		上年度末 2022 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		296,372,138.86	-	288,916,319.59	-7,455,819.27
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	17,962,947.00	157,627.14	18,134,118.87	13,544.73
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	17,962,947.00	157,627.14	18,134,118.87	13,544.73
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		314,335,085.86	157,627.14	307,050,438.46	-7,442,274.54

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

无。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

无。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

7.4.7.8 其他资产

无。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	3.35	1.97
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	571,684.05	653,098.52
其中：交易所市场	571,684.05	653,098.52
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提信息披露费	120,000.00	240,000.00
预提审计费	24,300.00	30,000.00
合计	715,987.40	923,100.49

7.4.7.10 实收基金

中信证券量化优选 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	179,378,845.07	179,378,845.07
本期申购	6,146,425.85	6,146,425.85
本期赎回（以“-”号填列）	-36,102,536.23	-36,102,536.23
本期末	149,422,734.69	149,422,734.69

中信证券量化优选 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	166,063,545.64	166,063,545.64
本期申购	39,616,157.98	39,616,157.98
本期赎回（以“-”号填列）	-50,697,355.60	-50,697,355.60
本期末	154,982,348.02	154,982,348.02

注：①申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

7.4.7.11 未分配利润

中信证券量化优选 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	52,946,011.18	-63,493,612.37	-10,547,601.19
本期期初	52,946,011.18	-63,493,612.37	-10,547,601.19
本期利润	-3,379,894.50	-810,942.76	-4,190,837.26
本期基金份额交易产生的变动数	-9,385,430.93	10,389,084.13	1,003,653.20
其中：基金申购款	1,932,959.60	-2,147,461.17	-214,501.57
基金赎回款	-11,318,390.53	12,536,545.30	1,218,154.77
本期已分配利润	-	-	-
本期末	40,180,685.75	-53,915,471.00	-13,734,785.25

中信证券量化优选 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-22,041,949.09	9,065,404.82	-12,976,544.27
本期期初	-22,041,949.09	9,065,404.82	-12,976,544.27
本期利润	-5,263,340.05	-810,877.39	-6,074,217.44
本期基金份额交易产生的变动数	1,633,396.42	-818,894.29	814,502.13
其中：基金申购款	-4,611,521.86	2,321,704.97	-2,289,816.89
基金赎回款	6,244,918.28	-3,140,599.26	3,104,319.02
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-25,671,892.72	7,435,633.14	-18,236,259.58

7.4.7.12 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
	活期存款利息收入	48,486.10
定期存款利息收入	-	-

其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	44,784.32	42,896.42
其他	2,330.72	3,810.73
合计	95,601.14	101,842.12

7.4.7.13 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月 31日
卖出股票成交总额	4,013,293,412.85	3,994,401,356.68
减：卖出股票成本总额	4,014,727,767.90	4,119,460,687.37
减：交易费用	6,585,101.78	8,325,942.25
买卖股票差价收入	-8,019,456.83	-133,385,272.94

注：卖出股票成交总额中扣除了股票投资收益中增值税的影响。

7.4.7.14 基金投资收益

无。

7.4.7.15 债券投资收益

7.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月 31日
债券投资收益——利息收入	341,957.44	481,200.89
债券投资收益——买卖债券 (债转股及债券到期兑付)差 价收入	18,820.30	-151,796.16
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	360,777.74	329,404.73

7.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年1月1日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年1月1日至2022年12月 31日
卖出债券(债转股及债券到 期兑付)成交总额	25,556,571.58	61,099,380.41
减：卖出债券(债转股及债	25,073,597.00	60,016,282.54

券到期兑付) 成本总额		
减: 应计利息总额	454,175.28	1,219,057.41
减: 交易费用	9,979.00	15,836.62
买卖债券差价收入	18,820.30	-151,796.16

注: 卖出债券成交总额中扣除了债券投资收益中增值税的影响。

7.4.7.16 资产支持证券投资收益

7.4.7.16.1 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

7.4.7.17 贵金属投资收益

无。

7.4.7.18 衍生工具收益

7.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.18.2 衍生工具收益——其他投资收益

无。

7.4.7.19 股利收益

单位: 人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	3,825,613.94	5,233,163.88
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	3,825,613.94	5,233,163.88

7.4.7.20 公允价值变动收益

单位: 人民币元

项目名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
1.交易性金融资产	-1,621,820.15	-16,017,443.59
——股票投资	-1,615,442.42	-16,111,073.96
——债券投资	-6,377.73	93,630.37
——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	-	-279,733.67
合计	-1,621,820.15	-15,737,709.92

7.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
基金赎回费收入	39,099.42	76,833.44
合计	39,099.42	76,833.44

7.4.7.22 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年1月1日至2023年12月31日	2022年1月1日至2022年12月31日
审计费用	24,300.00	80,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
银行手续费	537.96	153.00
账户维护费	16,500.00	18,000.00
其他	20,467.22	25,125.74
合计	181,805.18	243,278.74

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

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

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中信证券资产管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中信证券股份有限公司	原管理人、管理人股东、基金销售机构
中信银行股份有限公司	基金托管人、基金管理人股东的实际控制人的子公司、基金销售机构
中信证券(山东)有限责任公司	基金管理人股东的子公司、基金销售机构
上海华夏财富投资管理有限公司	基金管理人股东的子公司、基金销售机构
中信期货有限公司	基金管理人股东的子公司、基金销售机构

中信证券华南股份有限公司	基金管理人股东的子公司、基金销售机构
--------------	--------------------

注：①下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中信证券股份有限公司	7,990,842,803.99	100.00%	7,934,817,406.92	100.00%

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
中信证券股份有限公司	49,293,960.85	100.00%	78,468,284.70	100.00%

7.4.10.1.4 债券回购交易

无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

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

	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中信证券股份有限公司	3,698,046.01	100.00%	653,098.52	100.00%

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

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,050,135.97	3,717,753.89
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,144,417.95	1,392,516.37
应支付基金管理人的净管理费	1,905,718.02	2,325,237.52

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

②本基金本期发生的基金应支付的固定管理费 3,050,135.97 元，本基金管理费按前一日基金资产净值 1.00% 的年费率计提，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 1.00% / 当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日	2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	457,520.45	557,662.99

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

日托管费 = 前一日基金资产净值 × 0.15% / 当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期
	2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日
	当期发生的基金应支付的销售服务费

	中信证券量化优选 A	中信证券量化优选 C	合计
中信银行股份有限公司	-	16,728.79	16,728.79
中信证券股份有限公司	-	974,661.13	974,661.13
上海华夏财富投资管理有限公司	-	256.50	256.50
中信证券华南股份有限公司	-	104,104.23	104,104.23
中信证券(山东)有限责任公司	-	26,165.51	26,165.51
中信期货有限公司	-	694.66	694.66
合计	-	1,122,610.82	1,122,610.82
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中信证券量化优选 A	中信证券量化优选 C	合计
中信证券股份有限公司	-	1,164,265.93	1,164,265.93
中信银行股份有限公司	-	17,993.58	17,993.58
中信证券(山东)有限责任公司	-	56,173.77	56,173.77
中信证券华南股份有限公司	-	123,101.62	123,101.62
中信期货有限公司	-	663.26	663.26
上海华夏财富投资管理有限公司	-	282.41	282.41
合计	-	1,362,480.57	1,362,480.57

注：本基金 A 类份额不收取销售服务费。C 类份额的销售服务费按前一日 C 类份额资产净值 0.80% 的年费率计提，按月支付。计算公式为：日销售服务费 = 前一日 C 类份额资产净值 × 0.80% / 当年天数

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

无。

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

无。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信银行股份有限公司	3,290,359.12	48,486.10	13,703,706.57	55,131.32

注：本基金的银行存款由托管行中信银行保管，按同业利率或约定利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

无。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

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

无。

7.4.11 利润分配情况

无。

7.4.12 期末（2023 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300096	ST 易联众	2023-12-29	重大事项	6.82	2024-01-02	5.46	88,100.00	637,239.39	600,842.00	
400174	中天 3	2023-08-30	重整事项	-	-	-	400.00	331.65	-	

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

7.4.13.2 信用风险

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

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

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
A-1	-	-
A-1 以下	-	-
未评级	17,279,126.02	18,123,410.96
合计	17,279,126.02	18,123,410.96

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

短期融资券和超短期融资券。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本报告期末及上期末均未持有按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本报告期末及上期末均未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
AAA	-	-
AAA 以下	-	10,707.91
未评级	-	-
合计	-	10,707.91

注：本报告期末无余额，债券评级取自第三方评级机构的债项评级。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本报告期末及上期末均未持有按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本报告期末及上期末均未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指无法通过变现资产等途径以合理成本及时获得充足资金，用于偿付到期债务、满足计划份额持有人赎回需求、履行其他支付义务和满足正常业务开展的其他资金需求的风险。本基金的流动性风险一方面来自于份额持有人于约定开放日要求赎回本基金计划，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公

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

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

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

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	3,290,359.12	-	-	-	3,290,359.12
交易性金融资产	17,279,126.02	-	-	249,524,781.31	266,803,907.33
存出保证金	125,920.70	-	-	-	125,920.70
结算备付金	2,488,394.17	-	-	-	2,488,394.17
应收清算款	-	-	-	2,469,383.79	2,469,383.79
应收申购款	-	-	-	557.71	557.71
资产总计	23,183,800.01	-	-	251,994,722.81	275,178,522.82

应付清算款	-	-	-	1,287,939.22	1,287,939.22
应付赎回款	-	-	-	287,039.68	287,039.68
应付管理人报酬	-	-	-	232,436.26	232,436.26
应付托管费	-	-	-	34,865.44	34,865.44
应付销售服务费	-	-	-	186,216.94	186,216.94
其他负债	-	-	-	715,987.40	715,987.40
负债总计	-	-	-	2,744,484.94	2,744,484.94
利率敏感度缺口	23,183,800.01	-	-	249,250,237.87	272,434,037.88
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	13,704,214.71	-	-	-	13,704,214.71
结算备付金	2,716,294.73	-	-	-	2,716,294.73
存出保证金	177,035.97	-	-	-	177,035.97
交易性金融资产	18,123,410.96	-	10,707.91	288,916,319.59	307,050,438.46
应收清算款	-	-	-	5,205,888.09	5,205,888.09
应收申购款	-	-	-	52,704.67	52,704.67
资产总计	34,720,956.37	-	10,707.91	294,174,912.35	328,906,576.63
负债					
应付清算款	-	-	-	5,077,410.96	5,077,410.96
应付赎回款	-	-	-	359,803.20	359,803.20
应付管理人报酬	-	-	-	277,186.36	277,186.36
应付托管费	-	-	-	41,577.95	41,577.95
应付销售服务费	-	-	-	309,252.42	309,252.42
其他负债	-	-	-	923,100.49	923,100.49
负债总计	-	-	-	6,988,331.38	6,988,331.38
利率敏感度缺口	34,720,956.37	-	10,707.91	287,186,580.97	321,918,245.25

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合同约定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	市场利率上升 25 个基点		-18,109.42
市场利率下降 25 个基点		18,150.60	24,594.79

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金

报告期末的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金通过投资组合的分散化降低市场价格风险。此外，本基金管理人对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法进行风险度量和分析，以对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日		上年度末 2022 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	249,524,781.31	91.59	288,916,319.59	89.75
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	18,134,118.87	5.63
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
合计	249,524,781.31	91.59	307,050,438.46	95.38

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
	业绩比较基准下降 5%		-11,734,265.72
业绩比较基准上升 5%		11,734,265.72	13,735,769.93

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

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

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

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 12 月 31 日	上年度末 2022 年 12 月 31 日
第一层次	248,923,939.31	288,927,027.50
第二层次	17,879,968.02	18,123,410.96
第三层次	-	-
合计	266,803,907.33	307,050,438.46

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于本基金投资的证券交易所上市的证券，若出现重大事项停牌、交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）、或属于非公开发行等情况时，本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关证券公允价值的层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	160.00	160.00
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-160.00	-160.00
其中：计入损益的利得或损失	-	-160.00	-160.00
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	-	-

期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-
项目	上年度可比期间 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失（若有）	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-

注：本基金于上年度可比期间内未持有列入第三层次的证券。

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

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
中天 3	-	成本法	重置成本	-	正相关关系
项目	上年度末公允	采用的估值技	不可观察输入值		

	价值	术	名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
-	-	-	-	-	-

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	249,524,781.31	90.68
	其中：股票	249,524,781.31	90.68
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	17,279,126.02	6.28
	其中：债券	17,279,126.02	6.28
	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	5,778,753.29	2.10
8	其他各项资产	2,595,862.20	0.94
9	合计	275,178,522.82	100.00

8.2 期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	1,363,156.00	0.50
B	采矿业	4,827,784.00	1.77

C	制造业	166,482,594.24	61.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,259,507.32	2.30
E	建筑业	3,343,325.00	1.23
F	批发和零售业	5,313,898.00	1.95
G	交通运输、仓储和邮政业	10,005,212.00	3.67
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	15,734,584.22	5.78
J	金融业	17,519,912.84	6.43
K	房地产业	3,471,341.00	1.27
L	租赁和商务服务业	5,113,307.00	1.88
M	科学研究和技术服务业	90,134.64	0.03
N	水利、环境和公共设施管理业	3,566,502.05	1.31
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,722,798.00	0.63
R	文化、体育和娱乐业	4,097,897.00	1.50
S	综合	612,828.00	0.22
	合计	249,524,781.31	91.59

8.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	10,015.00	17,285,890.00	6.34
2	300750	宁德时代	50,940.00	8,316,464.40	3.05
3	000858	五粮液	44,400.00	6,229,764.00	2.29
4	600900	长江电力	125,348.00	2,925,622.32	1.07
5	002271	东方雨虹	135,100.00	2,593,920.00	0.95
6	600887	伊利股份	92,200.00	2,466,350.00	0.91
7	000568	泸州老窖	11,900.00	2,135,098.00	0.78
8	300274	阳光电源	23,700.00	2,075,883.00	0.76
9	601318	中国平安	50,943.00	2,053,002.90	0.75
10	601668	中国建筑	412,800.00	1,985,568.00	0.73
11	601899	紫金矿业	157,600.00	1,963,696.00	0.72
12	601398	工商银行	399,400.00	1,909,132.00	0.70
13	000651	格力电器	57,000.00	1,833,690.00	0.67
14	601988	中国银行	448,100.00	1,787,919.00	0.66
15	300308	中际旭创	15,700.00	1,772,687.00	0.65
16	000100	TCL 科技	412,000.00	1,771,600.00	0.65
17	601888	中国中免	21,100.00	1,765,859.00	0.65

18	000338	潍柴动力	128,600.00	1,755,390.00	0.64
19	601211	国泰君安	117,100.00	1,742,448.00	0.64
20	002415	海康威视	49,900.00	1,732,528.00	0.64
21	300015	爱尔眼科	108,900.00	1,722,798.00	0.63
22	600036	招商银行	61,267.00	1,704,447.94	0.63
23	601138	工业富联	112,529.00	1,701,438.48	0.62
24	300122	智飞生物	27,700.00	1,692,747.00	0.62
25	600893	航发动力	44,800.00	1,674,624.00	0.61
26	300782	卓胜微	11,400.00	1,607,400.00	0.59
27	603993	洛阳钼业	303,800.00	1,579,760.00	0.58
28	002142	宁波银行	76,700.00	1,542,437.00	0.57
29	002027	分众传媒	243,000.00	1,535,760.00	0.56
30	600011	华能国际	192,500.00	1,482,250.00	0.54
31	002493	荣盛石化	141,400.00	1,463,490.00	0.54
32	601600	中国铝业	256,400.00	1,446,096.00	0.53
33	600346	恒力石化	108,700.00	1,431,579.00	0.53
34	600029	南方航空	245,600.00	1,414,656.00	0.52
35	601881	中国银河	115,800.00	1,395,390.00	0.51
36	000301	东方盛虹	144,800.00	1,390,080.00	0.51
37	600115	中国东航	355,900.00	1,380,892.00	0.51
38	601111	中国国航	183,900.00	1,349,826.00	0.50
39	601021	春秋航空	26,200.00	1,315,240.00	0.48
40	600150	中国船舶	43,900.00	1,292,416.00	0.47
41	603806	福斯特	51,700.00	1,254,759.00	0.46
42	002050	三花智控	42,200.00	1,240,680.00	0.46
43	601288	农业银行	320,900.00	1,168,076.00	0.43
44	300413	芒果超媒	46,300.00	1,166,760.00	0.43
45	600816	建元信托	397,900.00	1,141,973.00	0.42
46	601601	中国太保	47,600.00	1,131,928.00	0.42
47	300394	天孚通信	12,300.00	1,125,696.00	0.41
48	300765	新诺威	30,700.00	1,124,234.00	0.41
49	600246	万通发展	169,600.00	1,100,704.00	0.40
50	600221	海航控股	783,700.00	1,073,669.00	0.39
51	688235	百济神州-U	7,400.00	1,028,896.00	0.38
52	601816	京沪高铁	207,500.00	1,020,900.00	0.37
53	002230	科大讯飞	21,700.00	1,006,446.00	0.37
54	600436	片仔癀	4,000.00	967,960.00	0.36
55	600919	江苏银行	142,900.00	956,001.00	0.35
56	600845	宝信软件	16,200.00	790,560.00	0.29
57	600480	凌云股份	73,600.00	670,496.00	0.25
58	300536	农尚环境	29,500.00	666,700.00	0.24
59	000333	美的集团	12,200.00	666,486.00	0.24
60	605305	中际联合	20,600.00	665,586.00	0.24

61	300405	科隆股份	102,200.00	660,212.00	0.24
62	688539	高华科技	15,066.00	659,890.80	0.24
63	301533	威马农机	19,000.00	657,970.00	0.24
64	300972	万辰集团	17,500.00	656,950.00	0.24
65	688345	博力威	20,879.00	656,853.34	0.24
66	002495	佳隆股份	204,500.00	654,400.00	0.24
67	300933	中辰股份	69,100.00	652,995.00	0.24
68	002387	维信诺	58,000.00	650,180.00	0.24
69	603839	安正时尚	78,300.00	649,890.00	0.24
70	603303	得邦照明	50,500.00	648,925.00	0.24
71	300805	电声股份	57,800.00	647,360.00	0.24
72	688582	芯动联科	16,721.00	646,601.07	0.24
73	688379	华光新材	32,600.00	644,502.00	0.24
74	603668	天马科技	35,100.00	643,734.00	0.24
75	301079	邵阳液压	37,200.00	643,560.00	0.24
76	300478	杭州高新	50,900.00	643,376.00	0.24
77	301051	信濠光电	10,100.00	643,067.00	0.24
78	688165	埃夫特-U	56,106.00	642,974.76	0.24
79	301037	保立佳	32,200.00	641,746.00	0.24
80	688203	海正生材	49,235.00	641,039.70	0.24
81	002992	宝明科技	8,200.00	639,600.00	0.23
82	300221	银禧科技	106,500.00	639,000.00	0.23
83	300449	汉邦高科	95,000.00	638,400.00	0.23
84	002755	奥赛康	59,000.00	638,380.00	0.23
85	300617	安靠智电	21,000.00	637,560.00	0.23
86	300906	日月明	25,200.00	637,308.00	0.23
87	603683	晶华新材	56,500.00	636,190.00	0.23
88	002290	禾盛新材	48,900.00	636,189.00	0.23
89	300787	海能实业	37,800.00	635,796.00	0.23
90	002920	德赛西威	4,900.00	634,599.00	0.23
91	300069	金利华电	39,400.00	634,340.00	0.23
92	300918	南山智尚	61,400.00	634,262.00	0.23
93	605377	华旺科技	33,100.00	631,879.00	0.23
94	688678	福立旺	34,291.00	631,297.31	0.23
95	688168	安博通	17,424.00	630,051.84	0.23
96	688181	八亿时空	23,299.00	629,073.00	0.23
97	300022	吉峰科技	127,400.00	628,082.00	0.23
98	301070	开勒股份	14,000.00	628,040.00	0.23
99	688115	思林杰	18,112.00	627,943.04	0.23
100	688011	新光光电	26,543.00	627,741.95	0.23
101	301198	喜悦智行	51,700.00	627,638.00	0.23
102	600712	南宁百货	120,000.00	626,400.00	0.23
103	688003	天准科技	16,657.00	624,970.64	0.23

104	300631	久吾高科	21,400.00	624,238.00	0.23
105	000524	岭南控股	70,000.00	623,700.00	0.23
106	600363	联创光电	18,300.00	622,200.00	0.23
107	688655	迅捷兴	41,188.00	621,938.80	0.23
108	688109	品茗科技	22,049.00	621,120.33	0.23
109	300509	新美星	85,900.00	621,057.00	0.23
110	300154	瑞凌股份	83,700.00	619,380.00	0.23
111	301317	鑫磊股份	31,500.00	619,290.00	0.23
112	688299	长阳科技	44,388.00	619,212.60	0.23
113	600149	廊坊发展	109,900.00	618,737.00	0.23
114	002802	洪汇新材	48,300.00	618,723.00	0.23
115	605318	法狮龙	38,500.00	618,695.00	0.23
116	300193	佳士科技	79,600.00	618,492.00	0.23
117	688558	国盛智科	21,776.00	618,438.40	0.23
118	003000	劲仔食品	50,600.00	618,332.00	0.23
119	600795	国电电力	148,600.00	618,176.00	0.23
120	300399	天利科技	44,600.00	617,264.00	0.23
121	688257	新锐股份	24,649.00	617,210.96	0.23
122	300715	凯伦股份	52,900.00	616,814.00	0.23
123	300740	水羊股份	37,000.00	616,790.00	0.23
124	688585	上纬新材	72,807.00	616,675.29	0.23
125	301259	艾布鲁	37,300.00	616,569.00	0.23
126	300091	金通灵	230,500.00	615,435.00	0.23
127	688129	东来技术	37,182.00	615,362.10	0.23
128	600558	大西洋	151,100.00	614,977.00	0.23
129	688285	高铁电气	69,212.00	614,602.56	0.23
130	603727	博迈科	49,000.00	613,970.00	0.23
131	688045	必易微	14,335.00	613,968.05	0.23
132	688138	清溢光电	27,119.00	613,431.78	0.23
133	688061	灿瑞科技	15,328.00	613,120.00	0.23
134	688286	敏芯股份	8,549.00	612,963.30	0.22
135	000009	中国宝安	52,200.00	612,828.00	0.22
136	688196	卓越新能	18,238.00	612,249.66	0.22
137	300703	创源股份	54,400.00	611,456.00	0.22
138	300705	九典制药	18,400.00	611,432.00	0.22
139	300888	稳健医疗	16,400.00	610,900.00	0.22
140	688718	唯赛勃	40,748.00	608,775.12	0.22
141	300591	万里马	100,600.00	608,630.00	0.22
142	300838	浙江力诺	37,200.00	608,592.00	0.22
143	002357	富临运业	80,600.00	608,530.00	0.22
144	688308	欧科亿	21,801.00	608,247.90	0.22
145	300051	璩升科技	53,600.00	606,216.00	0.22
146	002328	新朋股份	101,400.00	605,358.00	0.22

147	002033	丽江股份	74,800.00	605,132.00	0.22
148	600694	大商股份	35,800.00	604,662.00	0.22
149	688191	智洋创新	32,666.00	604,321.00	0.22
150	603019	中科曙光	15,300.00	604,197.00	0.22
151	300230	永利股份	149,900.00	604,097.00	0.22
152	301009	可靠股份	56,500.00	602,290.00	0.22
153	688395	正弦电气	26,195.00	602,223.05	0.22
154	688273	麦澜德	18,070.00	601,911.70	0.22
155	603506	南都物业	55,300.00	601,111.00	0.22
156	300163	先锋新材	156,500.00	600,960.00	0.22
157	300096	ST 易联众	88,100.00	600,842.00	0.22
158	603813	原尚股份	37,200.00	600,780.00	0.22
159	300717	华信新材	35,700.00	599,403.00	0.22
160	605177	东亚药业	22,600.00	598,448.00	0.22
161	603203	快克智能	20,700.00	598,437.00	0.22
162	688280	精进电动-UW	77,946.00	597,845.82	0.22
163	603316	诚邦股份	88,600.00	597,164.00	0.22
164	688277	天智航-U	45,296.00	597,001.28	0.22
165	688030	山石网科	29,775.00	596,095.50	0.22
166	300152	新动力	204,100.00	595,972.00	0.22
167	600886	国投电力	45,200.00	595,736.00	0.22
168	600833	第一医药	49,500.00	594,990.00	0.22
169	600697	欧亚集团	46,700.00	594,491.00	0.22
170	002072	凯瑞德	96,800.00	594,352.00	0.22
171	603199	九华旅游	22,900.00	594,255.00	0.22
172	300251	光线传媒	72,700.00	592,505.00	0.22
173	002899	英派斯	35,800.00	592,490.00	0.22
174	300326	凯利泰	93,600.00	592,488.00	0.22
175	603020	爱普股份	70,800.00	591,888.00	0.22
176	300871	回盛生物	40,900.00	591,414.00	0.22
177	300246	宝莱特	57,400.00	591,220.00	0.22
178	002288	超华科技	135,600.00	591,216.00	0.22
179	688184	帕瓦股份	30,378.00	591,155.88	0.22
180	600082	海泰发展	171,200.00	590,640.00	0.22
181	300103	达刚控股	93,000.00	590,550.00	0.22
182	301290	东星医疗	21,400.00	590,426.00	0.22
183	688330	宏力达	20,781.00	590,388.21	0.22
184	002652	扬子新材	184,900.00	589,831.00	0.22
185	300391	长药控股	76,200.00	589,788.00	0.22
186	002437	誉衡药业	234,800.00	589,348.00	0.22
187	688175	高凌信息	21,096.00	589,211.28	0.22
188	000972	中基健康	165,900.00	588,945.00	0.22

189	688386	泛亚微透	14,433.00	588,866.40	0.22
190	688169	石头科技	2,079.00	588,253.05	0.22
191	300452	山河药辅	41,300.00	588,112.00	0.22
192	000586	汇源通信	46,700.00	587,486.00	0.22
193	000608	阳光股份	203,600.00	586,368.00	0.22
194	603916	苏博特	57,500.00	585,925.00	0.22
195	300254	仟源医药	60,800.00	585,504.00	0.21
196	002434	万里扬	78,500.00	584,825.00	0.21
197	301065	本立科技	25,700.00	584,675.00	0.21
198	000548	湖南投资	107,100.00	583,695.00	0.21
199	688102	斯瑞新材	44,129.00	582,061.51	0.21
200	688793	倍轻松	17,284.00	581,606.60	0.21
201	688306	均普智能	103,956.00	579,034.92	0.21
202	603590	康辰药业	15,200.00	578,816.00	0.21
203	688230	芯导科技	13,816.00	578,061.44	0.21
204	000042	中洲控股	100,400.00	576,296.00	0.21
205	688051	佳华科技	17,275.00	576,121.25	0.21
206	600576	祥源文旅	77,300.00	575,112.00	0.21
207	300935	盈建科	20,900.00	572,869.00	0.21
208	300245	天玑科技	64,900.00	572,418.00	0.21
209	600488	津药药业	116,800.00	572,320.00	0.21
210	605296	神农集团	18,600.00	571,578.00	0.21
211	600828	茂业商业	156,500.00	571,225.00	0.21
212	300318	博晖创新	91,500.00	570,960.00	0.21
213	688021	奥福环保	27,301.00	569,225.85	0.21
214	688176	亚虹医药-U	52,764.00	568,795.92	0.21
215	688529	豪森智能	24,652.00	568,721.64	0.21
216	300448	浩云科技	105,700.00	568,666.00	0.21
217	300271	华宇软件	69,400.00	568,386.00	0.21
218	002787	华源控股	61,439.00	563,395.63	0.21
219	688013	天臣医疗	26,660.00	562,526.00	0.21
220	300915	海融科技	17,100.00	561,564.00	0.21
221	300908	仲景食品	13,600.00	561,272.00	0.21
222	688201	信安世纪	28,508.00	561,037.44	0.21
223	688010	福光股份	23,313.00	560,910.78	0.21
224	688004	博汇科技	19,080.00	560,379.60	0.21
225	002277	友阿股份	138,800.00	559,364.00	0.21
226	300027	华谊兄弟	208,700.00	559,316.00	0.21
227	000572	海马汽车	113,900.00	559,249.00	0.21
228	300752	隆利科技	30,700.00	557,819.00	0.20
229	688227	品高股份	29,233.00	557,473.31	0.20
230	301097	天益医疗	10,500.00	552,615.00	0.20
231	688606	奥泰生物	8,000.00	548,800.00	0.20

232	002488	金固股份	76,300.00	547,834.00	0.20
233	000793	华闻集团	248,700.00	542,166.00	0.20
234	601901	方正证券	67,000.00	540,020.00	0.20
235	688613	奥精医疗	23,972.00	533,616.72	0.20
236	000917	电广传媒	96,800.00	530,464.00	0.19
237	300359	全通教育	94,700.00	520,850.00	0.19
238	002181	粤传媒	111,500.00	512,900.00	0.19
239	688365	光云科技	46,943.00	511,209.27	0.19
240	000661	长春高新	3,500.00	510,300.00	0.19
241	601156	东航物流	34,200.00	505,476.00	0.19
242	688548	广钢气体	38,343.00	500,759.58	0.18
243	300262	巴安水务	153,000.00	498,780.00	0.18
244	688085	三友医疗	25,391.00	495,124.50	0.18
245	688020	方邦股份	10,088.00	489,066.24	0.18
246	300419	浩丰科技	82,300.00	485,570.00	0.18
247	300049	福瑞股份	10,900.00	475,131.00	0.17
248	600626	申达股份	113,600.00	473,712.00	0.17
249	688468	科美诊断	43,155.00	465,642.45	0.17
250	688310	迈得医疗	15,378.00	459,802.20	0.17
251	603703	盛洋科技	34,700.00	444,507.00	0.16
252	600137	浪莎股份	23,700.00	431,814.00	0.16
253	301100	风光股份	21,200.00	429,936.00	0.16
254	301258	富士莱	12,900.00	416,412.00	0.15
255	688697	纽威数控	22,034.00	414,900.22	0.15
256	300034	钢研高纳	20,000.00	407,000.00	0.15
257	300667	必创科技	23,700.00	406,692.00	0.15
258	688332	中科蓝讯	5,288.00	398,820.96	0.15
259	600547	山东黄金	17,300.00	395,651.00	0.15
260	300992	泰福泵业	18,300.00	394,914.00	0.14
261	300195	长荣股份	57,800.00	393,040.00	0.14
262	000590	启迪药业	43,600.00	390,656.00	0.14
263	688506	百利天恒-U	2,754.00	385,284.60	0.14
264	300389	艾比森	22,100.00	383,214.00	0.14
265	603701	德宏股份	24,200.00	379,698.00	0.14
266	688148	芳源股份	49,471.00	379,442.57	0.14
267	300382	斯莱克	37,800.00	375,354.00	0.14
268	300239	东宝生物	58,900.00	366,947.00	0.13
269	600663	陆家嘴	41,900.00	366,625.00	0.13
270	688519	南亚新材	13,861.00	357,059.36	0.13
271	600797	浙大网新	54,300.00	356,208.00	0.13
272	688215	瑞晟智能	9,735.00	349,973.25	0.13
273	688111	金山办公	1,105.00	349,401.00	0.13
274	600880	博瑞传播	68,300.00	342,183.00	0.13

275	601166	兴业银行	20,600.00	333,926.00	0.12
276	603816	顾家家居	9,200.00	322,000.00	0.12
277	600715	文投控股	120,700.00	319,855.00	0.12
278	605060	联德股份	17,100.00	319,770.00	0.12
279	300886	华业香料	12,400.00	307,148.00	0.11
280	000596	古井贡酒	1,300.00	302,640.00	0.11
281	600276	恒瑞医药	6,600.00	298,518.00	0.11
282	601865	福莱特	10,900.00	291,030.00	0.11
283	300181	佐力药业	26,900.00	286,754.00	0.11
284	688590	新致软件	12,652.00	286,188.24	0.11
285	600161	天坛生物	9,200.00	284,648.00	0.10
286	603101	汇嘉时代	41,700.00	280,224.00	0.10
287	300543	朗科智能	25,200.00	275,184.00	0.10
288	600938	中国海油	13,100.00	274,707.00	0.10
289	688335	复洁环保	20,730.00	265,965.90	0.10
290	002960	青鸟消防	19,100.00	264,344.00	0.10
291	688557	兰剑智能	7,070.00	260,388.10	0.10
292	000625	长安汽车	13,200.00	222,156.00	0.08
293	301262	海看股份	7,030.00	218,984.50	0.08
294	600426	华鲁恒升	7,700.00	212,443.00	0.08
295	688505	复旦张江	19,940.00	184,046.20	0.07
296	300381	溢多利	24,100.00	177,617.00	0.07
297	002244	滨江集团	24,000.00	174,480.00	0.06
298	002594	比亚迪	860.00	170,280.00	0.06
299	301015	百洋医药	4,600.00	164,956.00	0.06
300	002662	京威股份	46,700.00	163,917.00	0.06
301	688062	迈威生物-U	4,891.00	159,886.79	0.06
302	688658	悦康药业	7,540.00	157,284.40	0.06
303	300743	天地数码	10,100.00	140,188.00	0.05
304	600809	山西汾酒	600.00	138,438.00	0.05
305	300970	华绿生物	7,800.00	134,628.00	0.05
306	600986	浙文互联	24,500.00	133,770.00	0.05
307	300442	润泽科技	5,200.00	131,924.00	0.05
308	688661	和林微纳	2,753.00	126,142.46	0.05
309	603283	赛腾股份	1,700.00	123,352.00	0.05
310	300059	东方财富	7,900.00	110,916.00	0.04
311	300626	华瑞股份	10,100.00	109,585.00	0.04
312	601929	吉视传媒	59,900.00	109,018.00	0.04
313	001202	炬申股份	6,200.00	108,934.00	0.04
314	688579	山大地纬	8,356.00	106,121.20	0.04
315	300535	达威股份	5,800.00	101,558.00	0.04
316	603900	莱绅通灵	14,800.00	98,864.00	0.04
317	600406	国电南瑞	4,400.00	98,208.00	0.04

318	300387	富邦股份	11,300.00	94,242.00	0.03
319	688360	德马科技	4,504.00	90,395.28	0.03
320	000599	青岛双星	19,400.00	86,330.00	0.03
321	002946	新乳业	7,300.00	83,804.00	0.03
322	603899	晨光股份	2,200.00	82,610.00	0.03
323	603196	日播时尚	5,800.00	78,358.00	0.03
324	300030	阳普医疗	10,100.00	78,275.00	0.03
325	300289	利德曼	12,500.00	76,875.00	0.03
326	300621	维业股份	6,200.00	71,238.00	0.03
327	688222	成都先导	4,536.00	67,994.64	0.02
328	001979	招商蛇口	6,900.00	65,757.00	0.02
329	688041	海光信息	874.00	62,036.52	0.02
330	688059	华锐精密	786.00	61,866.06	0.02
331	300300	海峡创新	13,600.00	54,536.00	0.02
332	300719	安达维尔	3,900.00	51,987.00	0.02
333	603021	山东华鹏	7,600.00	50,084.00	0.02
334	600009	上海机场	1,300.00	42,614.00	0.02
335	000888	峨眉山 A	4,700.00	41,971.00	0.02
336	300845	捷安高科	2,300.00	41,561.00	0.02
337	688383	新益昌	394.00	41,287.26	0.02
338	300225	金力泰	4,200.00	41,076.00	0.02
339	300316	晶盛机电	900.00	39,681.00	0.01
340	688508	芯朋微	783.00	38,531.43	0.01
341	688025	杰普特	400.00	37,020.00	0.01
342	002444	巨星科技	1,300.00	29,276.00	0.01
343	002555	三七互娱	1,300.00	24,453.00	0.01
344	603105	芯能科技	2,000.00	23,160.00	0.01
345	002811	郑中设计	2,300.00	22,655.00	0.01
346	688166	博瑞医药	634.00	22,190.00	0.01
347	300668	杰恩设计	900.00	22,140.00	0.01
348	300071	福石控股	6,200.00	21,452.00	0.01
349	300695	兆丰股份	400.00	21,184.00	0.01
350	688659	元琛科技	1,698.00	21,140.10	0.01
351	603800	道森股份	800.00	21,120.00	0.01
352	688701	卓锦股份	2,214.00	20,036.70	0.01
353	301209	联合化学	800.00	19,968.00	0.01
354	600025	华能水电	2,200.00	18,986.00	0.01
355	603321	梅轮电梯	1,900.00	16,226.00	0.01
356	601360	三六零	1,800.00	16,218.00	0.01
357	301105	鸿铭股份	400.00	15,052.00	0.01
358	688305	科德数控	194.00	14,831.30	0.01
359	688560	明冠新材	785.00	14,616.70	0.01
360	002129	TCL 中环	900.00	14,076.00	0.01

361	002715	登云股份	800.00	12,984.00	0.00
362	301068	大地海洋	400.00	12,160.00	0.00
363	600570	恒生电子	400.00	11,504.00	0.00
364	688689	银河微电	395.00	11,008.65	0.00
365	688329	艾隆科技	390.00	9,695.40	0.00
366	688443	智翔金泰-U	236.00	9,428.20	0.00
367	300995	奇德新材	400.00	8,508.00	0.00
368	688510	航亚科技	480.00	8,457.60	0.00
369	688336	三生国健	372.00	8,373.72	0.00
370	688208	道通科技	326.00	7,742.50	0.00
371	688589	力合微	190.00	7,582.90	0.00
372	600423	柳化股份	2,000.00	7,320.00	0.00
373	000725	京东方 A	1,700.00	6,630.00	0.00
374	300981	中红医疗	400.00	6,408.00	0.00
375	300947	德必集团	400.00	6,276.00	0.00
376	605298	必得科技	400.00	6,236.00	0.00
377	300150	世纪瑞尔	1,200.00	5,820.00	0.00
378	002402	和而泰	400.00	5,716.00	0.00
379	688038	中科通达	396.00	5,706.36	0.00
380	688488	艾迪药业	403.00	5,041.53	0.00
381	688428	诺诚健华-U	392.00	4,508.00	0.00
382	300292	吴通控股	1,100.00	4,092.00	0.00
383	688565	力源科技	383.00	3,236.35	0.00
384	603389	亚振家居	400.00	2,652.00	0.00
385	601328	交通银行	400.00	2,296.00	0.00
386	400174	中天 3	400.00	0.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600519	贵州茅台	24,782,396.00	7.70
2	300750	宁德时代	22,494,328.80	6.99
3	601138	工业富联	21,869,937.33	6.79
4	688111	金山办公	19,095,052.00	5.93
5	600276	恒瑞医药	14,448,341.00	4.49
6	601689	拓普集团	14,085,038.00	4.38
7	601601	中国太保	13,655,647.00	4.24
8	002415	海康威视	13,566,634.00	4.21
9	601728	中国电信	13,264,430.00	4.12
10	688322	奥比中光-UW	13,249,657.25	4.12

11	300347	泰格医药	12,942,611.00	4.02
12	002236	大华股份	12,697,388.00	3.94
13	688256	寒武纪-U	12,531,958.07	3.89
14	688012	中微公司	12,288,196.63	3.82
15	000625	长安汽车	12,229,243.00	3.80
16	002594	比亚迪	12,131,524.00	3.77
17	600050	中国联通	11,808,474.00	3.67
18	600809	山西汾酒	11,765,113.00	3.65
19	002271	东方雨虹	11,374,714.72	3.53
20	688223	晶科能源	11,246,682.27	3.49
21	000858	五粮液	11,096,199.00	3.45
22	688169	石头科技	10,726,604.51	3.33
23	300122	智飞生物	10,302,758.82	3.20
24	300308	中际旭创	10,247,670.70	3.18
25	002050	三花智控	10,212,985.00	3.17
26	600026	中远海能	10,120,913.00	3.14
27	002371	北方华创	10,112,188.00	3.14
28	601600	中国铝业	9,981,167.00	3.10
29	688235	百济神州-U	9,957,085.68	3.09
30	002463	沪电股份	9,923,074.00	3.08
31	600887	伊利股份	9,900,245.00	3.08
32	002142	宁波银行	9,849,122.00	3.06
33	300033	同花顺	9,821,019.00	3.05
34	605499	东鹏饮料	9,797,227.00	3.04
35	000596	古井贡酒	9,728,794.00	3.02
36	002459	晶澳科技	9,415,573.80	2.92
37	601899	紫金矿业	9,301,353.00	2.89
38	000063	中兴通讯	9,286,610.00	2.88
39	688041	海光信息	9,193,147.69	2.86
40	688599	天合光能	9,015,457.10	2.80
41	300124	汇川技术	9,002,469.00	2.80
42	603259	药明康德	8,888,585.86	2.76
43	600027	华电国际	8,786,600.00	2.73
44	603806	福斯特	8,730,725.60	2.71
45	001979	招商蛇口	8,654,794.00	2.69
46	688472	阿特斯	8,644,824.84	2.69
47	688348	昱能科技	8,635,351.98	2.68
48	601186	中国铁建	8,571,624.00	2.66
49	600150	中国船舶	8,500,801.60	2.64
50	600958	东方证券	8,452,654.80	2.63
51	300832	新产业	8,416,432.83	2.61
52	002920	德赛西威	8,407,961.00	2.61
53	600547	山东黄金	8,284,303.00	2.57

54	600011	华能国际	8,240,892.00	2.56
55	603728	鸣志电器	8,143,823.00	2.53
56	000568	泸州老窖	8,056,067.00	2.50
57	688073	毕得医药	8,026,660.84	2.49
58	688063	派能科技	7,997,136.32	2.48
59	601088	中国神华	7,869,274.00	2.44
60	300274	阳光电源	7,827,911.00	2.43
61	688382	益方生物-U	7,811,996.34	2.43
62	601127	赛力斯	7,729,185.33	2.40
63	600009	上海机场	7,722,165.00	2.40
64	603345	安井食品	7,633,860.64	2.37
65	002555	三七互娱	7,559,712.00	2.35
66	300015	爱尔眼科	7,556,650.00	2.35
67	600010	包钢股份	7,545,409.00	2.34
68	688392	骄成超声	7,458,401.65	2.32
69	688176	亚虹医药-U	7,431,480.09	2.31
70	002714	牧原股份	7,388,821.00	2.30
71	002129	TCL 中环	7,378,777.50	2.29
72	300394	天孚通信	7,356,304.00	2.29
73	601881	中国银河	7,279,943.00	2.26
74	688318	财富趋势	7,218,210.49	2.24
75	688032	禾迈股份	7,206,231.30	2.24
76	601318	中国平安	7,172,291.86	2.23
77	688188	柏楚电子	7,133,765.94	2.22
78	002475	立讯精密	7,014,145.58	2.18
79	600602	云赛智联	6,962,377.00	2.16
80	600436	片仔癀	6,904,186.00	2.14
81	601390	中国中铁	6,872,515.00	2.13
82	601688	华泰证券	6,771,595.00	2.10
83	688213	思特威-W	6,747,788.88	2.10
84	601225	陕西煤业	6,715,212.00	2.09
85	000100	TCL 科技	6,702,383.00	2.08
86	600570	恒生电子	6,697,510.00	2.08
87	688981	中芯国际	6,692,875.03	2.08
88	000066	中国长城	6,666,552.00	2.07
89	600886	国投电力	6,664,901.00	2.07
90	002605	姚记科技	6,649,326.00	2.07
91	601865	福莱特	6,443,454.00	2.00

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

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

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

1	601138	工业富联	22,930,842.00	7.12
2	300750	宁德时代	20,246,598.40	6.29
3	688111	金山办公	19,473,468.70	6.05
4	600519	贵州茅台	17,672,703.00	5.49
5	002594	比亚迪	17,293,826.00	5.37
6	601728	中国电信	17,103,320.00	5.31
7	600050	中国联通	15,751,043.00	4.89
8	601689	拓普集团	14,909,361.00	4.63
9	600276	恒瑞医药	14,383,199.40	4.47
10	688256	寒武纪-U	14,367,698.82	4.46
11	688322	奥比中光 -UW	13,973,808.52	4.34
12	002371	北方华创	13,748,958.00	4.27
13	002236	大华股份	13,319,099.00	4.14
14	601601	中国太保	13,189,737.00	4.10
15	002415	海康威视	12,370,385.54	3.84
16	688012	中微公司	12,219,378.71	3.80
17	600809	山西汾酒	12,211,862.00	3.79
18	688223	晶科能源	12,125,417.75	3.77
19	300347	泰格医药	12,030,086.00	3.74
20	000625	长安汽车	11,995,455.00	3.73
21	601899	紫金矿业	11,682,228.55	3.63
22	002459	晶澳科技	11,207,398.60	3.48
23	002142	宁波银行	10,967,823.70	3.41
24	300033	同花顺	10,854,710.00	3.37
25	002714	牧原股份	10,651,376.72	3.31
26	002475	立讯精密	10,616,960.94	3.30
27	300124	汇川技术	10,526,838.00	3.27
28	688169	石头科技	10,333,653.15	3.21
29	601012	隆基绿能	10,255,354.72	3.19
30	300832	新产业	10,241,752.44	3.18
31	000333	美的集团	10,179,409.33	3.16
32	002463	沪电股份	10,132,162.00	3.15
33	600026	中远海能	10,099,860.00	3.14
34	300308	中际旭创	9,663,770.00	3.00
35	605499	东鹏饮料	9,594,435.81	2.98
36	300059	东方财富	9,578,554.23	2.98
37	688041	海光信息	9,444,951.03	2.93
38	002050	三花智控	9,410,045.00	2.92
39	688599	天合光能	9,311,441.59	2.89
40	000568	泸州老窖	9,291,332.00	2.89
41	000596	古井贡酒	9,268,355.00	2.88
42	601186	中国铁建	9,114,755.00	2.83

43	300122	智飞生物	8,895,743.19	2.76
44	601127	赛力斯	8,890,476.44	2.76
45	002271	东方雨虹	8,873,602.00	2.76
46	600887	伊利股份	8,871,689.00	2.76
47	000063	中兴通讯	8,851,071.00	2.75
48	688472	阿特斯	8,829,047.05	2.74
49	601100	恒立液压	8,763,199.00	2.72
50	688063	派能科技	8,630,487.08	2.68
51	688235	百济神州-U	8,505,346.51	2.64
52	603728	鸣志电器	8,370,158.00	2.60
53	000001	平安银行	8,369,610.00	2.60
54	600027	华电国际	8,344,952.00	2.59
55	600588	用友网络	8,334,322.00	2.59
56	601600	中国铝业	8,283,189.00	2.57
57	688348	昱能科技	8,281,284.65	2.57
58	001979	招商蛇口	8,278,620.00	2.57
59	601088	中国神华	8,047,812.00	2.50
60	002129	TCL 中环	8,031,338.00	2.49
61	603259	药明康德	7,945,544.30	2.47
62	600958	东方证券	7,942,441.20	2.47
63	002555	三七互娱	7,890,477.00	2.45
64	601318	中国平安	7,870,939.20	2.45
65	600602	云赛智联	7,830,976.00	2.43
66	600547	山东黄金	7,780,907.84	2.42
67	688073	毕得医药	7,776,012.18	2.42
68	688382	益方生物-U	7,621,420.74	2.37
69	603806	福斯特	7,582,977.96	2.36
70	600009	上海机场	7,569,993.75	2.35
71	300724	捷佳伟创	7,539,235.00	2.34
72	300015	爱尔眼科	7,514,392.16	2.33
73	002812	恩捷股份	7,462,449.00	2.32
74	603345	安井食品	7,450,847.00	2.31
75	600010	包钢股份	7,446,195.00	2.31
76	300274	阳光电源	7,430,871.00	2.31
77	002920	德赛西威	7,407,976.00	2.30
78	688318	财富趋势	7,400,182.90	2.30
79	688188	柏楚电子	7,393,322.77	2.30
80	600150	中国船舶	7,391,223.00	2.30
81	002605	姚记科技	7,380,855.00	2.29
82	300014	亿纬锂能	7,372,281.00	2.29
83	688126	沪硅产业	7,354,436.76	2.28
84	688392	骄成超声	7,322,573.67	2.27
85	601688	华泰证券	7,256,236.00	2.25

86	601390	中国中铁	7,230,044.00	2.25
87	601633	长城汽车	7,159,653.00	2.22
88	601857	中国石油	7,147,843.00	2.22
89	300316	晶盛机电	7,128,392.00	2.21
90	603737	三棵树	7,116,697.00	2.21
91	601319	中国人保	7,093,710.00	2.20
92	688032	禾迈股份	7,045,098.59	2.19
93	300394	天孚通信	7,010,560.00	2.18
94	688981	中芯国际	7,009,566.97	2.18
95	601816	京沪高铁	6,953,538.00	2.16
96	300498	温氏股份	6,933,964.00	2.15
97	601225	陕西煤业	6,905,959.00	2.15
98	601800	中国交建	6,828,596.00	2.12
99	600415	小商品城	6,823,603.00	2.12
100	688213	思特威-W	6,738,147.23	2.09
101	600011	华能国际	6,519,655.00	2.03
102	002607	中公教育	6,467,773.00	2.01
103	000066	中国长城	6,456,557.00	2.01

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	3,976,951,672.04
卖出股票的收入（成交）总额	4,013,293,412.85

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	17,279,126.02	6.34
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	公司债	-	-
10	地方债	-	-
11	定向工具	-	-

12	其他	-	-
13	合计	17,279,126.02	6.34

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	019703	23 国债 10	100,000.00	10,141,972.60	3.72
2	019709	23 国债 16	71,000.00	7,137,153.42	2.62

注：报告期末，本基金仅持有上述 2 支债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末无股指期货投资。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末无国债期货投资。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末无国债期货投资。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 基金投资前十名证券的发行主体未出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	125,920.70
2	应收清算款	2,469,383.79
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	557.71
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,595,862.20

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
中信证券量 化优选 A	4,313	34,644.73	2,067,180.92	1.38%	147,355,553.77	98.62%
中信证券量 化优选 C	3,951	39,226.11	4,366,041.18	2.82%	150,616,306.84	97.18%
合计	8,264	36,835.08	6,433,222.10	2.11%	297,971,860.61	97.89%

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

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	中信证券量化优选 A	421,576.64	0.28%
	中信证券量化优选 C	382,583.48	0.25%
	合计	804,160.12	0.26%

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

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间的情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	中信证券量化优选 A	10~50
	中信证券量化优选 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	中信证券量化优选 A	0
	中信证券量化优选 C	0
	合计	0

§10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	中信证券量化优选 A	中信证券量化优选 C
基金合同生效日（2020 年 5 月 22 日）基金份额总额	10,480,536.08	-
本报告期初基金份额总额	179,378,845.07	166,063,545.64
本报告期基金总申购份额	6,146,425.85	39,616,157.98
减：本报告期基金总赎回份额	36,102,536.23	50,697,355.60
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	149,422,734.69	154,982,348.02

注：基金合同生效日：2020 年 05 月 22 日

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

中信证券股份有限公司与中信证券资产管理有限公司发布《关于中信证券股份有限公司管理的

资产管理计划变更管理人的公告》，根据《中华人民共和国证券投资基金法》，按照本基金合同约定，经与托管人协商一致，本基金的管理人自 2023 年 11 月 1 日起由中信证券股份有限公司变更为中信证券资产管理有限公司。

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

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

本基金本报告期投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本基金本报告期应支付给毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)的报酬为 24,300 元人民币，该会计师事务所自 2023 年 10 月 30 日至今为本基金提供审计服务。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金托管人及其高级管理人员未受到稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券	2	7,990,842,803.99	100.00%	2,621,201.32	100.00%	-

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

②交易单元的选择标准和程序：

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

(3) 有良好的内控制度，在业内有良好的声誉；

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

(5) 建立了广泛的信息网络，能及时提供准确地信息资讯服务。

基金管理人根据以上标准进行考察后确定使用券商的交易单元。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例
中信证券	49,293,960.85	100.00%	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中信证券股份有限公司关于旗下部分公募大集合产品开放转换业务的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-02-15
2	关于中信证券股份有限公司管理的资产管理计划变更管理人的提示性公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-03-02
3	关于中信证券股份有限公司旗下资产管理产品实施固定收益品种估值新标准的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-03-30
4	中信证券股份有限公司中信证券量化优选股票型集合资产管理计划暂停申购（转换转入、定期定额投资）公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-05-15
5	中信证券股份有限公司关于中信证券量化优选股票型集合资产管理计划延长存续期限并修改资产管理合同、招募说明书的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-05-16
6	中信证券股份有限公司中信证券量化优选股票型集合资产管理计划恢复申购（转换转入、定期定额投资）公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-06-02
7	关于中信证券量化优选股票型集合资产管理计划持有停牌股票估值调整的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-07-05
8	中信证券股份有限公司关于运用自有资金投资旗下集合资产管理计划的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-07-13
9	中信证券股份有限公司关于运用自有资金投资旗下集合资产管理计划的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-08-21
10	中信证券股份有限公司关于旗下基金改聘会计师事务所的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-10-30
11	关于中信证券股份有限公司管理的资产管理计划变更管理人的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-11-01
12	关于资产管理计划管理人基本信息的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-11-02
13	中信证券资产管理有限公司关于大集合产品因管理人变更修改资产管理合同、托管协议和招募说明书的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-11-14

14	关于资产管理计划直销募集渠道及相关账户更新的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-11-17
15	关于中信证券资产管理有限公司管理的资产管理计划管理人网站地址变更的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-12-05
16	中信证券资产管理有限公司关于旗下部分大集合产品延长存续期限并修改资产管理合同、招募说明书的公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-12-22
17	中信证券资产管理有限公司中信证券量化优选股票型集合资产管理计划暂停申购（含转换转入、定期定额投资）公告	中国证监会指定报刊及网站	2023-12-26

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本基金本报告期内未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

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

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

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

13.2 存放地点

北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦 16 层。

13.3 查阅方式

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

投资者对本报告如有疑问，可咨询本管理人。

咨询电话：95548 转 5

公司网址：<http://www.citicsam.com>

中信证券资产管理有限公司

二〇二四年三月二十九日