

中信建投中证 1000 指数增强型证券投资基金

2024 年中期报告

2024 年 06 月 30 日

基金管理人:中信建投基金管理有限公司

基金托管人:中信银行股份有限公司

送出日期:2024 年 08 月 30 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2024年1月1日起至6月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	48
7.1 期末基金资产组合情况	48
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	48
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	50
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	68
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	69
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	70
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	70
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	70
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	70
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	70
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	70
7.12 投资组合报告附注	70
§8 基金份额持有人信息	71
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	71
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	72

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	72
§9 开放式基金份额变动	73
§10 重大事件揭示	73
10.1 基金份额持有人大会决议	73
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	73
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	73
10.4 基金投资策略的改变	73
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	73
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	73
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	74
10.8 其他重大事件	76
§11 影响投资者决策的其他重要信息	77
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	77
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	77
§12 备查文件目录	77
12.1 备查文件目录	77
12.2 存放地点	78
12.3 查阅方式	78

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中信建投中证1000指数增强型证券投资基金	
基金简称	中信建投中证1000指数增强	
基金主代码	015784	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022年06月28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	456,550,349.34份	
基金合同存续期	不定期	
下属各类别基金的基金简称	中信建投中证1000指数增强A	中信建投中证1000指数增强C
下属各类别基金的交易代码	015784	015785
报告期末下属各类别基金的份额总额	287,509,938.64份	169,040,410.70份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为指数增强型基金，在力求对中证1000指数进行有效跟踪的基础上，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	本基金为指数增强型基金，以中证1000指数为标的指数，基金股票投资方面将主要采用指数增强量化投资策略，在严格控制跟踪误差的基础上，力求获得超越标的指数的超额收益。 指数增强量化投资策略主要借鉴国内外成熟的组合投资策略，在对标的指数成份股及其他股票基本面的深入研究的基础上，运用多因子分析模型和机器学习模型构建投资组合，同时优化组合交易并严格控制组合风险，实现超额收益。
业绩比较基准	中证1000指数收益率×95%+中证综合债指数收益

	率×5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益和预期风险高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中信建投基金管理有限公司	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	朱伟	滕菲菲
	联系电话	010-59100208	4006800000
	电子邮箱	zhuweibj@csc.com.cn	tengfeifei@citicbank.com
客户服务电话		4009-108-108	95558
传真		010-59100298	010-85230024
注册地址		北京市怀柔区桥梓镇八龙桥雅苑3号楼1室	北京市朝阳区光华路10号院1号楼6-30层、32-42层
办公地址		北京市东城区朝阳门内大街2号凯恒中心B座17层	北京市朝阳区光华路10号院1号楼6-30层、32-42层
邮政编码		100010	100020
法定代表人		黄凌	方合英

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.cfund108.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2024年01月01日-2024年06月30日)	
	中信建投中证1000 指数增强A	中信建投中证1000 指数增强C
本期已实现收益	-18,923,173.29	-10,738,262.15
本期利润	-30,465,865.48	-14,522,131.63
加权平均基金份额本期利润	-0.1044	-0.0894
本期加权平均净值利润率	-11.81%	-10.20%
本期基金份额净值增长率	-10.41%	-10.58%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2024年06月30日)	
期末可供分配利润	-42,680,531.84	-26,242,766.62
期末可供分配基金份额利润	-0.1484	-0.1552
期末基金资产净值	244,829,406.80	142,797,644.08
期末基金份额净值	0.8516	0.8448
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2024年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	-14.84%	-15.52%

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

中信建投中证1000指数增强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
过去一个月	-6.36%	1.34%	-8.11%	1.36%	1.75%	-0.02%
过去三个月	-4.67%	1.38%	-9.44%	1.41%	4.77%	-0.03%
过去六个月	-10.41%	1.89%	-15.81%	1.87%	5.40%	0.02%
过去一年	-17.26%	1.48%	-24.40%	1.47%	7.14%	0.01%
自基金合同 生效起至今	-14.84%	1.22%	-28.31%	1.28%	13.47%	-0.06%

中信建投中证1000指数增强C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	-6.38%	1.34%	-8.11%	1.36%	1.73%	-0.02%
过去三个月	-4.77%	1.38%	-9.44%	1.41%	4.67%	-0.03%
过去六个月	-10.58%	1.89%	-15.81%	1.87%	5.23%	0.02%
过去一年	-17.60%	1.48%	-24.40%	1.47%	6.80%	0.01%
自基金合同 生效起至今	-15.52%	1.23%	-28.31%	1.28%	12.79%	-0.05%

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

中信建投中证1000指数增强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
(2022年06月28日-2024年06月30日)



中信建投中证1000指数增强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
(2022年06月28日-2024年06月30日)



§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

截至报告期末，中信建投基金在管公募证券投资基金共57个。

中信建投基金以公募基金为业务本源，以专户业务为服务抓手，加强投研体系建设，注重核心投资人才的积累、培养，不断提升主动投资管理能力。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	2022-06-28	-	9年	中国籍，1984年8月生，哥伦比亚大学统计学硕士。曾任中财期货分析师、LCM Commodities研究员、CIBC World Market期权交易员、中金基金管理有限公司量化投资副总经理、中金睿投投资管理有限公司量化投资副总经理、中信建投证券股份有限公司量化投资总监。2019年2月加入中信建投基金管理有限公司，曾任权益投资部-指数与量化投资部负责人、总监，现任本公司指数与量化投资部行政负责人、基金经理，担任中信建投中证500指数增强型证券投资基金、

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

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

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

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

全市场量化产品在一季度受微盘杀跌影响，发生踩踏，普遍超额回撤显著，本产品严格控制投资组合相对于基准在行业与风格上的偏离，受影响相对较小，今年策略端一直维持稳健经营的理念，后续也将在风控端把控严格，力争带来稳健的超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中信建投中证1000指数增强A基金份额净值为0.8516元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-10.41%，同期业绩比较基准收益率为-15.81%；截至报告期末中信建投中证1000指数增强C基金份额净值为0.8448元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-10.58%，同期业绩比较基准收益率为-15.81%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术；建立了估值委员会，由公司分管运营领导任估值委员会主任，委员包括权益

投资相关部门、固定收益部、多元资产配置部、研究部、特定资产管理部、稽核合规部、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，对中信建投中证1000指数增强型证券投资基金2024年上半年的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，中信建投基金管理有限公司在中信建投中证1000指数增强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真实、准确和完整发表意见

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

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：中信建投中证1000指数增强型证券投资基金

报告截止日：2024年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	28,789,636.34	33,020,291.29
结算备付金		6,416,596.48	4,392,476.96
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	353,000,745.23	404,611,683.50
其中：股票投资		353,000,745.23	404,065,217.86
基金投资		-	-
债券投资		-	546,465.64
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		960,740.28	2,775,327.12
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-

资产总计		389,167,718.33	444,799,778.87
负债和净资产	附注号	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		1,024,952.53	715,704.80
应付管理人报酬		323,371.12	372,495.64
应付托管费		32,337.13	37,249.55
应付销售服务费		46,284.98	52,780.28
应付投资顾问费		-	-
应交税费		18.04	3.63
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	113,703.65	170,047.29
负债合计		1,540,667.45	1,348,281.19
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	456,550,349.34	467,538,321.18
未分配利润	6.4.7.8	-68,923,298.46	-24,086,823.50
净资产合计		387,627,050.88	443,451,497.68
负债和净资产总计		389,167,718.33	444,799,778.87

注：报告截止日2024年06月30日，基金份额总额456,550,349.34份，其中A类基金份额净值0.8516元，基金份额287,509,938.64份；C类基金份额净值0.8448元，基金份额169,040,410.70份。

6.2 利润表

会计主体：中信建投中证1000指数增强型证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024年01月01日至 2024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023 年06月30日
一、营业总收入		-42,431,362.25	93,658,986.37
1.利息收入		89,776.65	157,933.52
其中：存款利息收入	6.4.7.9	89,776.65	157,933.52
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）		-27,382,792.49	57,152,882.76
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-31,097,247.24	53,425,476.46
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	167,096.91	549,910.46
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	-	20,196.48
股利收益	6.4.7.13	3,547,357.84	3,157,299.36
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	-15,326,561.67	36,227,825.78
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	188,215.26	120,344.31
减：二、营业总支出		2,556,634.86	3,628,809.82
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	1,987,993.46	2,942,622.73
2.托管费	6.4.10.2.2	198,799.38	294,262.27

3.销售服务费	6.4.10.2.3	283,310.65	293,148.82
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		1.59	64.37
8.其他费用	6.4.7.17	86,529.78	98,711.63
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-44,987,997.11	90,030,176.55
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-44,987,997.11	90,030,176.55
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-44,987,997.11	90,030,176.55

6.3 净资产变动表

会计主体：中信建投中证1000指数增强型证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	467,538,321.18	-24,086,823.50	443,451,497.68
二、本期期初净资产	467,538,321.18	-24,086,823.50	443,451,497.68
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-10,987,971.84	-44,836,474.96	-55,824,446.80
（一）、综合收益	-	-44,987,997.11	-44,987,997.11

总额			
（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）	-10,987,971.84	151,522.15	-10,836,449.69
其中：1.基金申购款	120,670,076.30	-16,292,839.27	104,377,237.03
2.基金赎回款	-131,658,048.14	16,444,361.42	-115,213,686.72
（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	456,550,349.34	-68,923,298.46	387,627,050.88
项 目	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	975,491,986.58	-59,115,523.93	916,376,462.65
二、本期期初净资产	975,491,986.58	-59,115,523.93	916,376,462.65
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-573,080,390.53	70,518,987.54	-502,561,402.99
（一）、综合收益总额	-	90,030,176.55	90,030,176.55
（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）	-573,080,390.53	-19,511,189.01	-592,591,579.54

其中：1.基金申购款	77,257,696.86	1,745,264.82	79,002,961.68
2.基金赎回款	-650,338,087.39	-21,256,453.83	-671,594,541.22
（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	402,411,596.05	11,403,463.61	413,815,059.66

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

中信建投中证1000指数增强型证券投资基金(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〔2022〕913号《关于准予中信建投中证1000指数增强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《中信建投中证1000指数增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,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1,293,974,558.36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(2022)第0480号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《中信建投中证1000指数增强型证券投资基金基金合同》于2022年6月28日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,294,152,423.35份基金份额,其中认购资金利息折合177,864.99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《中信建投中证1000指数增强型证券投资基金招募说明书》,本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式等的不同,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、申购费用的基金份额,称为C类基金份额。本基金A类、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《中信建投中证1000指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数的成份股、备选成份股（含存托凭证）。为更好地实现投资目标，本基金的投资范围还可包括国内依法发行上市的其他股票（含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、公开发行的次级债券、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）。本基金可以根据有关法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。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：本基金股票（含存托凭证）资产占基金资产的比例为80%-95%，投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于非现金基金资产的80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金以后，本基金保持的现金（不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等）或投资于到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为：中证1000指数收益率×95%+中证综合债指数收益率×5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《中信建投中证1000指数增强型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的相关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

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

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产

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

1) 债务工具

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

① 以摊余成本计量：

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

② 以公允价值计量且其变动计入当期损益：

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

2) 权益工具

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

(2)金融负债

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

(3)衍生金融工具

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

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产,以预期信用损失为基础确认损失准备。

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

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

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

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

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

6.4.4.7 实收基金

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

6.4.4.8 损益平准金

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

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

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

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

6.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

6.4.4.11 基金的收益分配政策

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

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

6.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

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

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

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

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

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

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

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

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日
活期存款	4,568,230.50
等于：本金	4,566,540.81
加：应计利息	1,689.69
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	24,221,405.84
等于：本金	24,219,439.57
加：应计利息	1,966.27

减：坏账准备	-
合计	28,789,636.34

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2024年06月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		372,380,325.90	-	353,000,745.23	-19,379,580.67
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		372,380,325.90	-	353,000,745.23	-19,379,580.67

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

无余额。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

6.4.7.5 其他资产

无余额。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	10.71
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	84,535.36
其他应付	29,157.58
合计	113,703.65

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 中信建投中证1000指数增强A

金额单位：人民币元

项目 (中信建投中证1000指数增强 A)	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	304,031,470.90	304,031,470.90
本期申购	40,611,166.92	40,611,166.92
本期赎回（以“-”号填列）	-57,132,699.18	-57,132,699.18
本期末	287,509,938.64	287,509,938.64

6.4.7.7.2 中信建投中证1000指数增强C

金额单位：人民币元

项目 (中信建投中证1000指数增强 C)	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	163,506,850.28	163,506,850.28
本期申购	80,058,909.38	80,058,909.38

本期赎回（以“-”号填列）	-74,525,348.96	-74,525,348.96
本期末	169,040,410.70	169,040,410.70

6.4.7.8 未分配利润

6.4.7.8.1 中信建投中证1000指数增强A

单位：人民币元

项目 (中信建投中证1000指数增强A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-6,556,605.49	-8,499,653.20	-15,056,258.69
本期期初	-6,556,605.49	-8,499,653.20	-15,056,258.69
本期利润	-18,923,173.29	-11,542,692.19	-30,465,865.48
本期基金份额交易产生的变动数	1,685,334.48	1,156,257.85	2,841,592.33
其中：基金申购款	-3,020,471.82	-1,306,538.79	-4,327,010.61
基金赎回款	4,705,806.30	2,462,796.64	7,168,602.94
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-23,794,444.30	-18,886,087.54	-42,680,531.84

6.4.7.8.2 中信建投中证1000指数增强C

单位：人民币元

项目 (中信建投中证1000指数增强C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-4,467,009.76	-4,563,555.05	-9,030,564.81
本期期初	-4,467,009.76	-4,563,555.05	-9,030,564.81
本期利润	-10,738,262.15	-3,783,869.48	-14,522,131.63
本期基金份额交易产生的变动数	8,666.02	-2,698,736.20	-2,690,070.18
其中：基金申购款	-7,200,142.62	-4,765,686.04	-11,965,828.66
基金赎回款	7,208,808.64	2,066,949.84	9,275,758.48
本期已分配利润	-	-	-

本期末	-15,196,605.89	-11,046,160.73	-26,242,766.62
-----	----------------	----------------	----------------

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
活期存款利息收入	17,120.36
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	48,536.77
结算备付金利息收入	24,119.52
其他	-
合计	89,776.65

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 2024年01月01日至2024年06月30日
卖出股票成交总额	2,322,252,219.80
减：卖出股票成本总额	2,349,941,016.23
减：交易费用	3,408,450.81
买卖股票差价收入	-31,097,247.24

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 2024年01月01日至2024年06月30日
债券投资收益——利息收入	508.39
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	166,588.52
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	167,096.91
----	------------

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 2024年01月01日至2024年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	771,714.92
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	604,500.00
减：应计利息总额	594.82
减：交易费用	31.58
买卖债券差价收入	166,588.52

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 2024年01月01日至2024年06月30日
股票投资产生的股利收益	3,547,357.84
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	3,547,357.84

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
------	-------------------------------

1.交易性金融资产	-15,326,561.67
——股票投资	-15,318,166.73
——债券投资	-8,394.94
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-15,326,561.67

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
基金赎回费收入	186,076.01
转换费收入	2,139.25
合计	188,215.26

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额中归入基金资产的比例按持有期间递减且不低于25%。

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 2024年01月01日至2024年06月30日
审计费用	24,863.02

信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
汇划手续费	1,994.42
合计	86,529.78

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无重大资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日	
	成交金额	占当期 股票成	成交金额	占当期 股票成

		交总额 的比例		交总额 的比例
中信建投 证券股份 有限公司	2,891,255,812.00	62.36%	3,987,144,897.74	64.11%

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 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日	
	成交金额	占当期 债券买 卖成交 总额的 比例	成交金额	占当期 债券买 卖成交 总额的 比例
中信建投 证券股份 有限公司	401,314.87	52.00%	1,568,707.30	65.60%

6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日			
	当期佣金	占当期 佣金总 量的比 例	期末应付佣金余额	占期末应 付佣金总 额的比例

中信建投 证券股份 有限公司	1,207,343.62	61.92%	-	-
关联方名 称	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日			
	当期佣金	占当期 佣金总 量的比 例	期末应付佣金余额	占期末应 付佣金总 额的比例
中信建投 证券股份 有限公司	1,698,214.00	64.00%	-	-

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

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024 年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至 2023年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,987,993.46	2,942,622.73
其中：应支付销售机构的客户维护费	866,397.48	1,359,717.32
应支付基金管理人的净管理费	1,121,595.98	1,582,905.41

注：支付基金管理人中信建投基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.00%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×1.00%/当年天数。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2024年01月01日至2024 年06月30日	2023年01月01日至2023 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管 费	198,799.38	294,262.27

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0.10%的
费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费=前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售 服务费的 各关联方 名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中信建投中证1000指数增强 A	中信建投中证1000指数增强 C	合计
中信建投 证券股份 有限公司	0.00	99,281.24	99,281.24
中信银行 股份有限 公司	0.00	25,179.31	25,179.31
中信建投 基金管理 有限公司	0.00	16,326.66	16,326.66
合计	0.00	140,787.21	140,787.21
获得销售 服务费的 各关联方 名称	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中信建投中证1000指数增强 A	中信建投中证1000指数增强 C	合计
中信建投 证券股份 有限公司	0.00	179,721.60	179,721.60

中信银行股份有限公司	0.00	25,624.94	25,624.94
合计	0.00	205,346.54	205,346.54

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信银行股份有限公司	4,568,230.50	17,120.36	4,452,906.84	34,928.12
中信建投证券股份有限公司	19,316,436.95	18,059.21	12,745,149.17	30,967.54

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

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张/股）	总金额
中信建投证券股份有限公司	301260	格力博	网下配售	18,123	559,094.55
中信建投证券股份有限公司	301358	湖南裕能	网下配售	13,204	313,859.08
中信建投证券股份有限公司	001337	四川黄金	网下配售	795	5,636.55

注：本基金本报告期不涉及在承销期内买入关联方承销证券的情况。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

无。

6.4.12 期末（2024年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人及结算券商的证券账户，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易主要以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无余额。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无余额。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无余额。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
AAA	-	-
AAA以下	-	546,465.64
未评级	-	-
合计	-	546,465.64

注：以上按长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无余额。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无余额。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时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每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。

本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

于2024年6月30日，除附注6.4.12.3中列示的卖出回购金融资产款余额将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合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。

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

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

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。于2024年6月30日，本基金确认的净赎回申请未超过7个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质

押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年0 6月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	28,789,636.34	-	-	-	28,789,636.34
结算备付金	6,416,596.48	-	-	-	6,416,596.48
交易性金融资产	-	-	-	353,000,745.23	353,000,745.23
应收申购款	-	-	-	960,740.28	960,740.28
资产总计	35,206,232.82	-	-	353,961,485.51	389,167,718.33

负债					
应付赎回款	-	-	-	1,024,952.53	1,024,952.53
应付管理人报酬	-	-	-	323,371.12	323,371.12
应付托管费	-	-	-	32,337.13	32,337.13
应付销售服务费	-	-	-	46,284.98	46,284.98
应交税费	-	-	-	18.04	18.04
其他负债	-	-	-	113,703.65	113,703.65
负债总计	-	-	-	1,540,667.45	1,540,667.45
利率敏感度缺口	35,206,232.82	-	-	352,420,818.06	387,627,050.88
上年度末 2023年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	33,020,291.29	-	-	-	33,020,291.29
结算备付金	4,392,476.96	-	-	-	4,392,476.96
交易性金融资产	-	504,033.14	42,432.50	404,065,217.86	404,611,683.50
应收申购款	-	-	-	2,775,327.12	2,775,327.12
资产总计	37,412,768.25	504,033.14	42,432.50	406,840,544.98	444,799,778.87

负债					
应付赎回款	-	-	-	715,704.80	715,704.80
应付管理人报酬	-	-	-	372,495.64	372,495.64
应付托管费	-	-	-	37,249.55	37,249.55
应付销售服务费	-	-	-	52,780.28	52,780.28
应交税费	-	-	-	3.63	3.63
其他负债	-	-	-	170,047.29	170,047.29
负债总计	-	-	-	1,348,281.19	1,348,281.19
利率敏感度缺口	37,412,768.25	504,033.14	42,432.50	405,492,263.79	443,451,497.68

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金为指数增强型基金，以中证1000指数为标的指数，基金股票投资方面将主要采用指数增强量化投资策略，在严格控制跟踪误差的基础上，力求获得超越标的指数的超额收益。

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日		上年度末 2023年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	353,000,745.23	91.07	404,065,217.86	91.12
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	546,465.64	0.12
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	353,000,745.23	91.07	404,611,683.50	91.24

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位：

		人民币元)	
		本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
	业绩比较基准上升5%	19,358,070.97	20,697,358.26
	业绩比较基准下降5%	-19,358,070.97	-20,697,358.26

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

- 第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。
- 第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。
- 第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	353,000,745.23	402,626,940.36
第二层次	-	1,984,743.14
第三层次	-	-
合计	353,000,745.23	404,611,683.50

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票、债券和基金的公允价值应属第二层次还是第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	353,000,745.23	90.71
	其中：股票	353,000,745.23	90.71
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	35,206,232.82	9.05
8	其他各项资产	960,740.28	0.25
9	合计	389,167,718.33	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（指数投资）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	1,974,208.00	0.51
B	采矿业	14,105,548.00	3.64
C	制造业	208,840,151.74	53.88
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,592,295.00	1.44
E	建筑业	3,866,256.00	1.00
F	批发和零售业	12,730,349.00	3.28
G	交通运输、仓储和邮政业	11,062,713.60	2.85
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	45,794,762.66	11.81
J	金融业	7,530,453.00	1.94
K	房地产业	2,207,928.00	0.57
L	租赁和商务服务业	2,182,341.00	0.56
M	科学研究和技术服务业	3,567,690.00	0.92
N	水利、环境和公共设施管理业	4,329,072.00	1.12
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	5,247,303.00	1.35
S	综合	-	-
	合计	329,031,071.00	84.88

7.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	481,283.00	0.12

C	制造业	18,098,605.53	4.67
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	267,822.60	0.07
E	建筑业	266,205.00	0.07
F	批发和零售业	264,820.00	0.07
G	交通运输、仓储和邮政业	131,040.00	0.03
H	住宿和餐饮业	131,040.00	0.03
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,494,308.10	0.64
J	金融业	-	-
K	房地产业	131,930.00	0.03
L	租赁和商务服务业	127,421.00	0.03
M	科学研究和技术服务业	264,294.00	0.07
N	水利、环境和公共设施管理业	783,947.00	0.20
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	131,886.00	0.03
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	260,000.00	0.07
S	综合	135,072.00	0.03
	合计	23,969,674.23	6.18

7.2.3 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

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
----	------	------	-------	---------	--------------

1	002635	安洁科技	207,500	3,203,800.00	0.83
2	688127	蓝特光学	173,600	3,192,504.00	0.82
3	002291	遥望科技	704,000	3,027,200.00	0.78
4	300113	顺网科技	292,100	2,991,104.00	0.77
5	002583	海能达	693,500	2,822,545.00	0.73
6	300841	康华生物	55,500	2,810,520.00	0.73
7	000923	河钢资源	162,800	2,803,416.00	0.72
8	002036	联创电子	401,800	2,712,150.00	0.70
9	300409	道氏技术	307,300	2,630,488.00	0.68
10	300233	金城医药	175,600	2,619,952.00	0.68
11	300303	聚飞光电	533,000	2,590,380.00	0.67
12	301316	慧博云通	171,500	2,517,620.00	0.65
13	002705	新宝股份	176,900	2,488,983.00	0.64
14	601101	昊华能源	262,700	2,414,213.00	0.62
15	002215	诺普信	322,700	2,404,115.00	0.62
16	600577	精达股份	603,500	2,395,895.00	0.62
17	300857	协创数据	42,000	2,394,000.00	0.62
18	300170	汉得信息	384,300	2,359,602.00	0.61
19	002123	梦网科技	328,700	2,310,761.00	0.60
20	300687	赛意信息	161,800	2,252,256.00	0.58
21	002928	华夏航空	348,100	2,206,954.00	0.57
22	688208	道通科技	90,800	2,191,912.00	0.57
23	002020	京新药业	206,200	2,158,914.00	0.56
24	002274	华昌化工	287,900	2,136,218.00	0.55
25	300783	三只松鼠	95,600	2,090,772.00	0.54
26	600158	中体产业	268,700	2,066,303.00	0.53
27	002859	洁美科技	102,400	2,056,192.00	0.53
28	600475	华光环能	233,300	2,032,043.00	0.52
29	603766	隆鑫通用	299,500	2,030,610.00	0.52
30	002237	恒邦股份	175,800	2,023,458.00	0.52
31	002745	木林森	250,900	2,022,254.00	0.52

32	301071	力量钻石	72,900	2,020,059.00	0.52
33	300369	绿盟科技	392,800	2,007,208.00	0.52
34	300761	立华股份	87,200	1,974,208.00	0.51
35	600711	盛屯矿业	529,000	1,941,430.00	0.50
36	002245	蔚蓝锂芯	249,600	1,934,400.00	0.50
37	000758	中色股份	375,500	1,907,540.00	0.49
38	300679	电连技术	46,100	1,854,603.00	0.48
39	600125	铁龙物流	310,600	1,854,282.00	0.48
40	300451	创业慧康	534,500	1,849,370.00	0.48
41	600729	重庆百货	79,400	1,775,384.00	0.46
42	300319	麦捷科技	184,600	1,722,318.00	0.44
43	603985	恒润股份	142,200	1,692,180.00	0.44
44	000821	京山轻机	147,500	1,671,175.00	0.43
45	002467	二六三	497,700	1,662,318.00	0.43
46	001287	中电港	99,700	1,648,041.00	0.43
47	002891	中宠股份	78,200	1,632,034.00	0.42
48	688408	中信博	17,500	1,611,400.00	0.42
49	688578	艾力斯	25,100	1,599,874.00	0.41
50	300049	福瑞股份	31,700	1,595,778.00	0.41
51	002701	奥瑞金	380,300	1,582,048.00	0.41
52	300768	迪普科技	133,400	1,580,790.00	0.41
53	000517	荣安地产	580,800	1,556,544.00	0.40
54	002351	漫步者	118,200	1,554,330.00	0.40
55	605333	沪光股份	55,400	1,542,890.00	0.40
56	688158	优刻得	148,600	1,520,178.00	0.39
57	688007	光峰科技	90,700	1,460,270.00	0.38
58	601222	林洋能源	230,700	1,446,489.00	0.37
59	600301	华锡有色	71,400	1,443,708.00	0.37
60	002226	江南化工	322,200	1,443,456.00	0.37
61	300634	彩讯股份	85,600	1,440,648.00	0.37
62	300166	东方国信	233,700	1,430,244.00	0.37

63	603348	文灿股份	51,200	1,417,728.00	0.37
64	688123	聚辰股份	23,164	1,409,066.12	0.36
65	600556	天下秀	385,100	1,401,764.00	0.36
66	002405	四维图新	225,100	1,400,122.00	0.36
67	002053	云南能投	115,700	1,398,813.00	0.36
68	300428	立中集团	74,200	1,379,378.00	0.36
69	001309	德明利	15,900	1,373,760.00	0.35
70	300685	艾德生物	77,200	1,361,808.00	0.35
71	301219	腾远钴业	35,508	1,358,536.08	0.35
72	600335	国机汽车	232,800	1,343,256.00	0.35
73	002315	焦点科技	49,300	1,329,128.00	0.34
74	301498	乖宝宠物	24,500	1,318,100.00	0.34
75	300406	九强生物	85,700	1,318,066.00	0.34
76	000913	钱江摩托	83,600	1,317,536.00	0.34
77	300203	聚光科技	128,100	1,292,529.00	0.33
78	300034	钢研高纳	81,300	1,291,857.00	0.33
79	603220	中贝通信	46,200	1,254,792.00	0.32
80	000035	中国天楹	275,300	1,247,109.00	0.32
81	603306	华懋科技	67,500	1,219,725.00	0.31
82	600320	振华重工	355,000	1,214,100.00	0.31
83	002993	奥海科技	32,300	1,201,560.00	0.31
84	002267	陕天然气	157,700	1,192,212.00	0.31
85	002139	拓邦股份	112,100	1,190,502.00	0.31
86	301155	海力风电	29,500	1,186,785.00	0.31
87	600718	东软集团	142,900	1,181,783.00	0.30
88	601163	三角轮胎	77,500	1,179,550.00	0.30
89	605365	立达信	74,200	1,177,554.00	0.30
90	300035	中科电气	135,400	1,152,254.00	0.30
91	300973	立高食品	41,000	1,151,690.00	0.30
92	603039	泛微网络	36,100	1,146,536.00	0.30
93	301246	宏源药业	83,800	1,127,948.00	0.29

94	600285	羚锐制药	46,100	1,116,081.00	0.29
95	688018	乐鑫科技	11,232	1,108,373.76	0.29
96	000860	顺鑫农业	65,600	1,098,144.00	0.28
97	000600	建投能源	170,100	1,071,630.00	0.28
98	000488	晨鸣纸业	309,400	1,070,524.00	0.28
99	300620	光库科技	29,000	1,066,620.00	0.28
100	603328	依顿电子	135,500	1,065,030.00	0.27
101	000415	渤海租赁	417,500	1,064,625.00	0.27
102	300482	万孚生物	43,600	1,063,840.00	0.27
103	300446	航天智造	89,100	1,060,290.00	0.27
104	002204	大连重工	246,900	1,054,263.00	0.27
105	601311	骆驼股份	131,100	1,051,422.00	0.27
106	688800	瑞可达	37,400	1,050,192.00	0.27
107	600874	创业环保	187,300	1,047,007.00	0.27
108	600864	哈投股份	220,300	1,046,425.00	0.27
109	002534	西子洁能	104,200	1,043,042.00	0.27
110	000990	诚志股份	140,100	1,042,344.00	0.27
111	688372	伟测科技	26,500	1,042,245.00	0.27
112	601068	中铝国际	247,500	1,041,975.00	0.27
113	688776	国光电气	18,800	1,041,520.00	0.27
114	002061	浙江交科	284,800	1,039,520.00	0.27
115	688686	奥普特	16,183	1,036,197.49	0.27
116	000811	冰轮环境	107,300	1,035,445.00	0.27
117	300953	震裕科技	19,100	1,035,220.00	0.27
118	002100	天康生物	148,900	1,031,877.00	0.27
119	301291	明阳电气	34,300	1,030,715.00	0.27
120	002646	天佑德酒	100,000	1,023,000.00	0.26
121	600507	方大特钢	272,100	1,017,654.00	0.26
122	000030	富奥股份	207,100	1,016,861.00	0.26
123	301376	致欧科技	47,600	1,007,692.00	0.26
124	600480	凌云股份	101,500	997,745.00	0.26

125	603583	捷昌驱动	48,900	996,582.00	0.26
126	688105	诺唯赞	49,500	990,495.00	0.26
127	600596	新安股份	129,900	987,240.00	0.25
128	000543	皖能电力	106,400	941,640.00	0.24
129	300379	东方通	116,300	939,704.00	0.24
130	002174	游族网络	122,500	929,775.00	0.24
131	000828	东莞控股	102,800	926,228.00	0.24
132	000025	特力A	67,200	903,168.00	0.23
133	000426	兴业银锡	66,500	903,070.00	0.23
134	000550	江铃汽车	41,300	896,623.00	0.23
135	000065	北方国际	85,700	888,709.00	0.23
136	688798	艾为电子	15,200	860,624.00	0.22
137	300747	锐科激光	48,000	852,000.00	0.22
138	300432	富临精工	131,300	845,572.00	0.22
139	002612	朗姿股份	59,500	822,290.00	0.21
140	002782	可立克	73,800	817,704.00	0.21
141	601369	陕鼓动力	100,900	809,218.00	0.21
142	601528	瑞丰银行	171,100	807,592.00	0.21
143	603299	苏盐井神	84,300	800,850.00	0.21
144	601038	一拖股份	50,600	799,986.00	0.21
145	300476	胜宏科技	24,700	796,822.00	0.21
146	688232	新点软件	39,800	784,856.00	0.20
147	002043	兔宝宝	74,700	774,639.00	0.20
148	002126	银轮股份	44,100	767,781.00	0.20
149	600197	伊力特	43,000	765,830.00	0.20
150	600986	浙文互联	178,000	747,600.00	0.19
151	300627	华测导航	24,700	737,295.00	0.19
152	002777	久远银海	49,100	736,009.00	0.19
153	688278	特宝生物	13,700	733,635.00	0.19
154	000810	创维数字	85,500	733,590.00	0.19
155	601333	广深铁路	220,800	715,392.00	0.18

156	603267	鸿远电子	20,900	712,690.00	0.18
157	605589	圣泉集团	34,400	697,976.00	0.18
158	603713	密尔克卫	13,000	695,760.00	0.18
159	600685	中船防务	24,700	689,130.00	0.18
160	603132	金徽股份	50,000	688,000.00	0.18
161	300638	广和通	40,200	687,420.00	0.18
162	603678	火炬电子	27,600	681,444.00	0.18
163	002948	青岛银行	202,200	681,414.00	0.18
164	603162	海通发展	73,132	680,127.60	0.18
165	002681	奋达科技	185,800	678,170.00	0.17
166	600428	中远海特	110,700	677,484.00	0.17
167	688380	中微半导	40,500	677,160.00	0.17
168	601187	厦门银行	126,700	675,311.00	0.17
169	688586	江航装备	72,600	675,180.00	0.17
170	600323	瀚蓝环境	32,300	675,070.00	0.17
171	300527	中船应急	104,200	674,174.00	0.17
172	003021	兆威机电	14,600	673,790.00	0.17
173	000528	柳工	60,200	673,638.00	0.17
174	002249	大洋电机	142,400	673,552.00	0.17
175	601069	西部黄金	57,900	673,377.00	0.17
176	300470	中密控股	19,900	672,819.00	0.17
177	603693	江苏新能	57,900	672,798.00	0.17
178	605222	起帆电缆	43,800	671,892.00	0.17
179	600717	天津港	157,200	671,244.00	0.17
180	002446	盛路通信	118,800	671,220.00	0.17
181	601918	新集能源	68,800	670,800.00	0.17
182	600908	无锡银行	126,000	670,320.00	0.17
183	688209	英集芯	54,000	670,140.00	0.17
184	688239	航宇科技	19,249	669,865.20	0.17
185	002378	章源钨业	116,700	669,858.00	0.17
186	002318	久立特材	28,700	669,571.00	0.17

187	002498	汉缆股份	203,400	669,186.00	0.17
188	300134	大富科技	98,100	669,042.00	0.17
189	600273	嘉化能源	93,700	669,018.00	0.17
190	601975	招商南油	186,300	668,817.00	0.17
191	600420	国药现代	62,600	668,568.00	0.17
192	000727	冠捷科技	324,400	668,264.00	0.17
193	600490	鹏欣资源	256,800	667,680.00	0.17
194	603393	新天然气	19,200	667,008.00	0.17
195	600295	鄂尔多斯	67,200	666,624.00	0.17
196	601702	华峰铝业	36,500	666,490.00	0.17
197	688262	国芯科技	36,600	666,486.00	0.17
198	300323	华灿光电	153,200	666,420.00	0.17
199	601028	玉龙股份	53,300	666,250.00	0.17
200	300772	运达股份	69,300	665,280.00	0.17
201	002048	宁波华翔	51,400	665,116.00	0.17
202	600210	紫江企业	125,000	665,000.00	0.17
203	600888	新疆众和	93,900	663,873.00	0.17
204	603308	应流股份	53,400	663,228.00	0.17
205	002097	山河智能	109,900	662,697.00	0.17
206	603699	纽威股份	38,700	662,544.00	0.17
207	603093	南华期货	76,400	661,624.00	0.17
208	000917	电广传媒	130,900	661,045.00	0.17
209	600618	氯碱化工	75,200	660,256.00	0.17
210	601969	海南矿业	104,100	659,994.00	0.17
211	605020	永和股份	34,400	659,792.00	0.17
212	600682	南京新百	132,200	659,678.00	0.17
213	002468	申通快递	78,500	659,400.00	0.17
214	002265	建设工业	76,400	659,332.00	0.17
215	688739	成大生物	27,200	659,328.00	0.17
216	600201	生物股份	91,400	658,994.00	0.17
217	001338	永顺泰	67,200	658,560.00	0.17

218	603055	台华新材	65,000	658,450.00	0.17
219	600623	华谊集团	113,900	658,342.00	0.17
220	002773	康弘药业	30,400	658,160.00	0.17
221	002287	奇正藏药	33,600	657,888.00	0.17
222	000627	天茂集团	375,800	657,650.00	0.17
223	688289	圣湘生物	37,400	657,492.00	0.17
224	600645	中源协和	40,800	656,880.00	0.17
225	300463	迈克生物	57,700	656,626.00	0.17
226	688383	新益昌	12,600	656,586.00	0.17
227	600810	神马股份	105,900	656,580.00	0.17
228	300570	太辰光	20,100	656,466.00	0.17
229	002354	天娱数科	219,500	656,305.00	0.17
230	605507	国邦医药	39,400	656,010.00	0.17
231	002292	奥飞娱乐	109,700	656,006.00	0.17
232	601886	江河集团	134,400	655,872.00	0.17
233	601811	新华文轩	46,800	655,668.00	0.17
234	601375	中原证券	192,200	655,402.00	0.17
235	688336	三生国健	32,200	655,270.00	0.17
236	002004	华邦健康	172,300	654,740.00	0.17
237	603063	禾望电气	42,700	654,591.00	0.17
238	300821	东岳硅材	95,700	654,588.00	0.17
239	300182	捷成股份	176,400	654,444.00	0.17
240	688062	迈威生物	22,600	654,044.00	0.17
241	002961	瑞达期货	59,700	653,715.00	0.17
242	688388	嘉元科技	67,015	653,396.25	0.17
243	300188	国投智能	58,800	653,268.00	0.17
244	688690	纳微科技	37,600	653,112.00	0.17
245	001323	慕思股份	22,700	653,079.00	0.17
246	601011	宝泰隆	408,000	652,800.00	0.17
247	688033	天宜上佳	108,649	651,894.00	0.17
248	600649	城投控股	196,200	651,384.00	0.17

249	601595	上海电影	32,900	650,762.00	0.17
250	002212	天融信	133,600	650,632.00	0.17
251	603103	横店影视	47,000	650,480.00	0.17
252	002727	一心堂	43,100	650,379.00	0.17
253	002453	华软科技	151,500	649,935.00	0.17
254	600776	东方通信	66,000	648,780.00	0.17
255	688177	百奥泰	30,715	648,700.80	0.17
256	603919	金徽酒	35,700	648,669.00	0.17
257	688147	微导纳米	26,044	648,495.60	0.17
258	300180	华峰超纤	183,700	648,461.00	0.17
259	600446	金证股份	65,300	648,429.00	0.17
260	688023	安恒信息	16,200	648,162.00	0.17
261	000712	锦龙股份	86,200	646,500.00	0.17
262	688351	微电生理	29,300	645,772.00	0.17
263	688046	药康生物	63,100	644,882.00	0.17
264	301015	百洋医药	27,400	644,722.00	0.17
265	002946	新乳业	73,400	642,984.00	0.17
266	603236	移远通信	13,500	630,855.00	0.16
267	300079	数码视讯	154,900	628,894.00	0.16
268	601801	皖新传媒	82,200	569,646.00	0.15
269	603733	仙鹤股份	31,800	559,044.00	0.14
270	301050	雷电微力	11,500	553,840.00	0.14
271	002023	海特高新	60,400	552,660.00	0.14
272	600269	赣粤高速	105,300	544,401.00	0.14
273	001308	康冠科技	24,100	542,250.00	0.14
274	688322	奥比中光	19,600	523,516.00	0.14
275	600610	中毅达	126,900	505,062.00	0.13
276	603612	索通发展	34,700	442,772.00	0.11
277	000951	中国重汽	29,500	422,440.00	0.11
278	688789	宏华数科	3,900	420,420.00	0.11
279	002906	华阳集团	15,300	409,428.00	0.11

280	600575	淮河能源	99,600	387,444.00	0.10
281	002402	和而泰	35,400	379,134.00	0.10
282	002051	中工国际	54,400	378,624.00	0.10
283	000795	英洛华	68,200	377,828.00	0.10
284	600651	飞乐音响	136,700	377,292.00	0.10
285	603281	江瀚新材	16,800	377,160.00	0.10
286	601609	金田股份	66,500	376,390.00	0.10
287	002643	万润股份	37,600	376,000.00	0.10
288	000928	中钢国际	67,700	375,735.00	0.10
289	601677	明泰铝业	32,500	375,700.00	0.10
290	600456	宝钛股份	14,700	375,291.00	0.10
291	601952	苏垦农发	41,600	375,232.00	0.10
292	600787	中储股份	78,000	375,180.00	0.10
293	300660	江苏雷利	14,700	375,144.00	0.10
294	300031	宝通科技	26,100	375,057.00	0.10
295	002101	广东鸿图	35,600	374,868.00	0.10
296	601200	上海环境	44,100	374,850.00	0.10
297	600688	上海石化	143,500	374,535.00	0.10
298	600502	安徽建工	87,100	374,530.00	0.10
299	601860	紫金银行	149,800	374,500.00	0.10
300	600195	中牧股份	49,900	373,751.00	0.10
301	600662	外服控股	93,200	373,732.00	0.10
302	603025	大豪科技	27,000	373,140.00	0.10
303	002967	广电计量	31,600	372,880.00	0.10
304	002158	汉钟精机	22,300	372,856.00	0.10
305	002283	天润工业	86,900	372,801.00	0.10
306	300226	上海钢联	22,000	372,680.00	0.10
307	002545	东方铁塔	54,700	372,507.00	0.10
308	600409	三友化工	74,200	372,484.00	0.10
309	603169	兰石重装	82,700	372,150.00	0.10
310	003006	百亚股份	15,700	372,090.00	0.10

311	600586	金晶科技	64,100	371,780.00	0.10
312	600929	雪天盐业	70,100	371,530.00	0.10
313	002697	红旗连锁	80,200	371,326.00	0.10
314	000061	农产品	76,400	371,304.00	0.10
315	688389	普门科技	22,800	370,728.00	0.10
316	600861	北京人力	22,700	370,464.00	0.10
317	002960	青鸟消防	29,300	370,352.00	0.10
318	688315	诺禾致源	33,900	370,188.00	0.10
319	300755	华致酒行	27,100	370,186.00	0.10
320	603881	数据港	29,090	369,733.90	0.10
321	002987	京北方	35,100	369,603.00	0.10
322	688630	芯碁微装	5,900	369,163.00	0.10
323	603297	永新光学	6,100	368,989.00	0.10
324	300596	利安隆	13,600	368,968.00	0.10
325	300741	华宝股份	24,200	368,808.00	0.10
326	600477	杭萧钢构	158,000	368,140.00	0.09
327	688268	华特气体	7,132	368,082.52	0.09
328	603008	喜临门	21,200	367,396.00	0.09
329	002145	中核钛白	111,500	365,720.00	0.09
330	603197	保隆科技	11,600	365,400.00	0.09
331	002068	黑猫股份	51,400	364,940.00	0.09
332	688556	高测股份	30,500	362,645.00	0.09
333	688050	爱博医疗	4,724	346,363.68	0.09
334	300415	伊之密	16,200	336,636.00	0.09
335	600993	马应龙	10,300	274,701.00	0.07
336	688076	诺泰生物	3,400	266,152.00	0.07
337	301308	江波龙	2,800	265,272.00	0.07
338	002456	欧菲光	33,900	264,759.00	0.07
339	605376	博迁新材	11,300	255,041.00	0.07
340	002567	唐人神	46,700	250,312.00	0.06
341	600459	贵研铂业	17,900	241,829.00	0.06

342	000681	视觉中国	16,200	186,300.00	0.05
343	301080	百普赛斯	4,200	147,000.00	0.04
344	002617	露笑科技	26,600	127,680.00	0.03
345	688100	威胜信息	2,580	98,427.00	0.03

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600941	中国移动	3,600	387,000.00	0.10
2	600519	贵州茅台	200	293,478.00	0.08
3	000566	海南海药	62,800	183,376.00	0.05
4	300968	格林精密	15,200	140,752.00	0.04
5	301067	显盈科技	7,100	139,941.00	0.04
6	688510	航亚科技	7,600	139,916.00	0.04
7	300120	经纬辉开	26,500	137,535.00	0.04
8	002916	深南电路	1,300	137,501.00	0.04
9	301011	华立科技	8,900	137,149.00	0.04
10	601616	广电电气	47,100	137,061.00	0.04
11	600183	生益科技	6,500	136,890.00	0.04
12	603890	春秋电子	15,100	136,806.00	0.04
13	300743	天地数码	10,100	136,754.00	0.04
14	688678	福立旺	12,600	136,458.00	0.04
15	002273	水晶光电	8,000	135,840.00	0.04
16	301280	珠城科技	3,500	135,800.00	0.04
17	605218	伟时电子	8,400	135,660.00	0.03
18	300900	广联航空	7,240	135,605.20	0.03
19	688216	气派科技	7,600	135,584.00	0.03
20	002111	威海广泰	13,000	135,460.00	0.03
21	688132	邦彦技术	7,800	135,330.00	0.03

22	002058	威尔泰	17,800	135,280.00	0.03
23	600219	南山铝业	35,500	135,255.00	0.03
24	002879	长缆科技	10,300	135,239.00	0.03
25	002933	新兴装备	5,900	135,169.00	0.03
26	300410	正业科技	26,400	135,168.00	0.03
27	603897	长城科技	7,700	135,135.00	0.03
28	001210	金房能源	10,180	135,088.60	0.03
29	000532	华金资本	11,200	135,072.00	0.03
30	002476	宝莫股份	36,800	135,056.00	0.03
31	002128	电投能源	6,400	135,040.00	0.03
32	002519	银河电子	27,500	135,025.00	0.03
33	688233	神工股份	7,000	134,890.00	0.03
34	300652	雷迪克	6,800	134,844.00	0.03
35	002282	博深股份	21,100	134,829.00	0.03
36	603088	宁波精达	17,900	134,787.00	0.03
37	300048	合康新能	29,100	134,733.00	0.03
38	300810	中科海讯	8,800	134,728.00	0.03
39	688028	沃尔德	8,200	134,726.00	0.03
40	002979	雷赛智能	7,400	134,680.00	0.03
41	002047	宝鹰股份	93,500	134,640.00	0.03
42	603507	振江股份	4,100	134,562.00	0.03
43	000725	京东方A	32,900	134,561.00	0.03
44	603380	易德龙	6,700	134,536.00	0.03
45	300870	欧陆通	3,100	134,478.00	0.03
46	002722	物产金轮	11,900	134,470.00	0.03
47	002975	博杰股份	4,500	134,460.00	0.03
47	002026	山东威达	16,200	134,460.00	0.03
49	000551	创元科技	15,400	134,442.00	0.03
50	605068	明新旭腾	10,200	134,436.00	0.03
51	301299	卓创资讯	3,200	134,400.00	0.03
51	002884	凌霄泵业	7,000	134,400.00	0.03

53	003015	日久光电	14,800	134,384.00	0.03
54	688237	超卓航科	6,700	134,335.00	0.03
55	301007	德迈仕	11,500	134,320.00	0.03
56	603727	博迈科	10,200	134,232.00	0.03
57	688338	赛科希德	6,200	134,230.00	0.03
58	001234	泰慕士	7,900	134,221.00	0.03
59	002392	北京利尔	42,600	134,190.00	0.03
60	301028	东亚机械	15,300	134,181.00	0.03
61	605378	野马电池	8,700	134,154.00	0.03
62	600660	福耀玻璃	2,800	134,120.00	0.03
63	300950	德固特	8,800	134,112.00	0.03
64	300176	派生科技	30,400	134,064.00	0.03
65	688448	磁谷科技	7,100	134,048.00	0.03
66	688317	之江生物	9,300	134,013.00	0.03
67	603681	永冠新材	10,500	133,875.00	0.03
68	688150	莱特光电	6,900	133,860.00	0.03
68	600299	安迪苏	13,800	133,860.00	0.03
70	002787	华源控股	19,800	133,848.00	0.03
71	000856	冀东装备	22,000	133,760.00	0.03
72	688229	博睿数据	5,200	133,744.00	0.03
73	688329	艾隆科技	9,000	133,740.00	0.03
74	300230	永利股份	39,800	133,728.00	0.03
75	301157	华塑科技	4,100	133,660.00	0.03
76	688401	路维光电	5,100	133,620.00	0.03
77	300694	蠡湖股份	15,700	133,607.00	0.03
78	002380	科远智慧	7,300	133,590.00	0.03
79	001203	大中矿业	13,900	133,579.00	0.03
80	600727	鲁北化工	21,200	133,560.00	0.03
80	301065	本立科技	8,400	133,560.00	0.03
82	301032	新柴股份	19,900	133,529.00	0.03
83	300710	万隆光电	8,800	133,496.00	0.03

83	300207	欣旺达	8,800	133,496.00	0.03
85	002298	中电兴发	30,200	133,484.00	0.03
86	603189	网达软件	12,200	133,468.00	0.03
87	603790	雅运股份	13,900	133,440.00	0.03
87	600152	维科技术	27,800	133,440.00	0.03
89	300441	鲍斯股份	22,500	133,425.00	0.03
90	000703	恒逸石化	18,800	133,292.00	0.03
91	002686	亿利达	31,800	133,242.00	0.03
92	003019	宸展光电	5,260	133,235.80	0.03
93	603161	科华控股	8,900	133,233.00	0.03
94	603031	安孚科技	5,900	133,222.00	0.03
95	002788	鹭燕医药	16,900	133,172.00	0.03
96	300194	福安药业	35,600	133,144.00	0.03
97	603015	弘讯科技	17,600	133,056.00	0.03
98	300976	达瑞电子	2,900	132,965.00	0.03
99	603629	利通电子	7,200	132,912.00	0.03
100	603017	中衡设计	15,000	132,900.00	0.03
101	603177	德创环保	18,900	132,867.00	0.03
102	300837	浙矿股份	6,400	132,864.00	0.03
103	301066	万事利	16,400	132,840.00	0.03
104	001206	依依股份	10,200	132,804.00	0.03
105	002256	兆新股份	99,800	132,734.00	0.03
106	301056	森赫股份	17,300	132,691.00	0.03
107	300247	融捷健康	54,600	132,678.00	0.03
108	002399	海普瑞	15,300	132,651.00	0.03
109	605069	正和生态	21,600	132,624.00	0.03
109	300381	溢多利	21,600	132,624.00	0.03
111	000949	新乡化纤	39,000	132,600.00	0.03
112	603683	晶华新材	16,700	132,598.00	0.03
113	300673	佩蒂股份	10,100	132,512.00	0.03
114	300076	GQY视讯	41,400	132,480.00	0.03

114	001209	洪兴股份	9,600	132,480.00	0.03
116	300707	威唐工业	10,700	132,466.00	0.03
117	603385	惠达卫浴	24,100	132,309.00	0.03
118	002633	申科股份	22,500	132,300.00	0.03
119	688201	信安世纪	11,200	132,272.00	0.03
120	688296	和达科技	13,600	132,192.00	0.03
121	300535	达威股份	11,200	132,160.00	0.03
122	600243	青海华鼎	49,100	132,079.00	0.03
123	002035	华帝股份	21,200	132,076.00	0.03
124	002988	豪美新材	8,600	132,010.00	0.03
125	688178	万德斯	12,800	131,968.00	0.03
126	000042	中洲控股	33,400	131,930.00	0.03
127	603655	朗博科技	8,900	131,898.00	0.03
128	002607	中公教育	86,200	131,886.00	0.03
129	002790	瑞尔特	14,600	131,838.00	0.03
130	688011	新光光电	8,700	131,805.00	0.03
131	603355	莱克电气	6,100	131,760.00	0.03
132	300442	润泽科技	5,500	131,725.00	0.03
133	688528	秦川物联	16,485	131,715.15	0.03
134	001256	炜冈科技	9,600	131,712.00	0.03
135	000701	厦门信达	35,200	131,648.00	0.03
136	300453	三鑫医疗	20,600	131,634.00	0.03
137	002642	荣联科技	25,500	131,580.00	0.03
138	002620	瑞和股份	53,700	131,565.00	0.03
139	605180	华生科技	11,100	131,535.00	0.03
140	688136	科兴制药	7,847	131,515.72	0.03
141	688355	明志科技	9,793	131,422.06	0.03
142	000710	贝瑞基因	18,300	131,394.00	0.03
143	605088	冠盛股份	6,300	131,292.00	0.03
144	301043	绿岛风	5,500	131,285.00	0.03
145	688350	富淼科技	11,500	131,215.00	0.03

146	301003	江苏博云	6,100	131,211.00	0.03
147	688367	工大高科	10,748	131,125.60	0.03
148	600603	广汇物流	26,000	131,040.00	0.03
148	301073	君亭酒店	7,200	131,040.00	0.03
148	300846	首都在线	14,000	131,040.00	0.03
151	688056	莱伯泰科	5,900	130,744.00	0.03
152	300915	海融科技	5,000	130,700.00	0.03
153	688273	麦澜德	6,600	130,680.00	0.03
154	300380	安硕信息	8,500	130,560.00	0.03
155	688369	致远互联	8,300	130,559.00	0.03
156	688590	新致软件	10,119	130,535.10	0.03
157	688371	菲沃泰	13,000	130,520.00	0.03
158	000786	北新建材	4,400	130,504.00	0.03
159	002422	科伦药业	4,300	130,419.00	0.03
160	300091	金通灵	111,400	130,338.00	0.03
161	000546	金圆股份	32,500	130,325.00	0.03
162	300266	兴源环境	112,300	130,268.00	0.03
163	002638	勤上股份	87,400	130,226.00	0.03
164	002858	力盛体育	12,500	130,000.00	0.03
164	000892	欢瑞世纪	52,000	130,000.00	0.03
166	688228	开普云	3,400	129,744.00	0.03
167	688516	奥特维	3,100	129,611.00	0.03
168	688253	英诺特	3,400	129,574.00	0.03
169	002570	贝因美	55,200	129,168.00	0.03
170	000592	平潭发展	99,000	128,700.00	0.03
171	603201	常润股份	5,300	128,260.00	0.03
172	688480	赛恩斯	4,600	128,156.00	0.03
173	000826	启迪环境	92,800	128,064.00	0.03
174	002371	北方华创	400	127,956.00	0.03
175	300242	佳云科技	76,300	127,421.00	0.03
176	688095	福昕软件	2,700	123,687.00	0.03

177	601857	中国石油	7,600	78,432.00	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	300113	顺网科技	10,993,578.00	2.48
2	300687	赛意信息	9,839,394.00	2.22
3	002928	华夏航空	9,346,453.02	2.11
4	002123	梦网科技	9,234,723.00	2.08
5	688127	蓝特光学	8,644,971.84	1.95
6	002745	木林森	8,487,032.00	1.91
7	000035	中国天楹	8,256,869.00	1.86
8	000923	河钢资源	8,221,501.65	1.85
9	002837	英维克	8,107,943.00	1.83
10	002859	洁美科技	7,887,405.00	1.78
11	603583	捷昌驱动	7,828,141.93	1.77
12	603368	柳药集团	7,778,139.60	1.75
13	600556	天下秀	7,684,533.00	1.73
14	600718	东软集团	7,652,217.00	1.73
15	600480	凌云股份	7,533,996.00	1.70
16	688596	正帆科技	7,453,024.51	1.68
17	002068	黑猫股份	7,409,292.00	1.67
18	300451	创业慧康	7,409,069.16	1.67
19	600577	精达股份	7,364,358.00	1.66
20	300679	电连技术	7,263,114.00	1.64

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	600480	凌云股份	10,532,722.19	2.38
2	600312	平高电气	10,184,685.91	2.30
3	300226	上海钢联	9,863,564.00	2.22
4	601333	广深铁路	9,722,304.00	2.19
5	601137	博威合金	9,562,551.00	2.16
6	300638	广和通	9,423,236.36	2.12
7	601918	新集能源	8,957,986.00	2.02
8	002984	森麒麟	8,868,974.51	2.00
9	002745	木林森	8,852,612.00	2.00
10	300687	赛意信息	8,623,397.00	1.94
11	688596	正帆科技	8,349,844.34	1.88
12	002837	英维克	8,267,074.15	1.86
13	603368	柳药集团	8,235,519.43	1.86
14	300113	顺网科技	8,058,458.00	1.82
15	601222	林洋能源	8,019,779.35	1.81
16	000923	河钢资源	7,890,504.00	1.78
17	000426	兴业银锡	7,890,325.00	1.78
18	603583	捷昌驱动	7,844,169.91	1.77
19	603920	世运电路	7,791,113.80	1.76
20	300319	麦捷科技	7,704,056.00	1.74

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	2,314,194,710.33
卖出股票收入（成交）总额	2,322,252,219.80

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无余额。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

无余额。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无余额。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无余额。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无余额。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体中，浙江蓝特光学股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到上海浦东国际机场海关的处罚，杭州顺网科技股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到杭州市西湖区市场监督管理局的处罚。

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

7.12.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	-
5	应收申购款	960,740.28
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	960,740.28

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

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无余额。

7.12.5.2 期末积极投资前五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 中证 1000 指数 增强	24,080	11,939.78	13,707,463.09	4.7676%	273,802,475.55	95.2324%

A						
中信建投中证1000指数增强C	8,106	20,853.74	63,921,262.00	37.8142%	105,119,148.70	62.1858%
合计	31,966	14,282.37	77,628,725.09	17.0033%	378,921,624.25	82.9967%

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	中信建投中证1000指数增强A	161,295.03	0.0561%
	中信建投中证1000指数增强C	7,051.45	0.0042%
	合计	168,346.48	0.0369%

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	中信建投中证1000指数增强A	0
	中信建投中证1000指数增强C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	中信建投中证1000指数增强A	0
	中信建投中证1000指数增强C	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	中信建投中证1000指数 增强A	中信建投中证1000指数 增强C
基金合同生效日(2022年06月28日)基金份额总额	913,074,067.12	381,078,356.23
本报告期期初基金份额总额	304,031,470.90	163,506,850.28
本报告期基金总申购份额	40,611,166.92	80,058,909.38
减：本报告期基金总赎回份额	57,132,699.18	74,525,348.96
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	287,509,938.64	169,040,410.70

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

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

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

注：报告期内基金管理人的高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
方正证券（券商柜台）	2	1,732,428,798.74	37.37%	737,056.13	37.80%	-
信达证券（券商	2	12,762,319.39	0.28%	5,503.74	0.28%	-

柜台)						
中信建投证券	4	2,891,255,812.00	62.36%	1,207,343.62	61.92%	-

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

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

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

（3）评估实行评分制，具体如下：
分配权重（100分）=基础研究服务（70%）+综合研究服务（20%）+专项研究服务（10%）。基础研究服务占70%权重和综合研究服务占20%权重，由权益投资相关部门组织投研条线相关人员进行打分；专项研究服务占10%权重，由系统跟踪股票涨跌幅后生成得分。
2、根据以上标准进行考察后，基金管理人确定券商，与被选择的券商签订委托协议，并报中国证监会备案及通知基金托管人。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
方正证券（券商柜	342,613.40	44.40%	-	-	-	-	-	-

台)								
信达 证券 (券商 柜台)	27,786.65	3.60%	-	-	-	-	-	-
中信 建投 证券	401,314.87	52.00%	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中信建投基金管理有限公司旗下部分基金2023年第4季度报告提示性公告	规定报刊	2024-01-22
2	中信建投中证1000指数增强型证券投资基金2023年第4季度报告	规定网站	2024-01-22
3	中信建投基金管理有限公司关于终止和合期货有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	规定网站、规定报刊	2024-02-28
4	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金在中国农业银行股份有限公司开通基金转换业务的公告	规定网站、规定报刊	2024-03-21
5	中信建投基金管理有限公司旗下部分基金2023年年度报告提示性公告	规定报刊	2024-03-29
6	中信建投中证1000指数增强型证券投资基金2023年年度报告	规定网站	2024-03-29
7	中信建投基金管理有限公司旗下全部基金2024年第1季	规定报刊	2024-04-22

	度报告提示性公告		
8	中信建投中证1000指数增强型证券投资基金2024年第1季度报告	规定网站	2024-04-22
9	中信建投基金管理有限公司关于暂停海银基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	规定网站、规定报刊	2024-06-07
10	中信建投中证1000指数增强型证券投资基金招募说明书（更新）	规定网站	2024-06-28
11	中信建投中证1000指数增强型证券投资基金(A类份额)基金产品资料概要更新	规定网站	2024-06-28
12	中信建投中证1000指数增强型证券投资基金(C类份额)基金产品资料概要更新	规定网站	2024-06-28

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本报告期内，未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，无影响投资者决策的其他重要信息。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金注册的文件；
- 2、《中信建投中证1000指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《中信建投中证1000指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 4、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；

6、基金托管人业务资格批件、营业执照。

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

12.3 查阅方式

投资者可以在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

中信建投基金管理有限公司
二〇二四年八月三十日