

中信建投中证 1000 指数增强型证券投资基金

2024 年年度报告

2024 年 12 月 31 日

基金管理人:中信建投基金管理有限公司

基金托管人:中信银行股份有限公司

报告送出日期:2025 年 03 月 31 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独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2025年03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。安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金出具了标准无保留意见的审计报告，请投资者注意阅读。

本报告期自2024年01月01日起至2024年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	7
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	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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	12
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	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 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 审计报告	14
6.1 审计报告基本信息	14
6.2 审计报告的基本内容	14
§ 7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表	16
7.2 利润表	17
7.3 净资产变动表	18
7.4 报表附注	19
§ 8 投资组合报告	43
8.1 期末基金资产组合情况	43
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
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	45
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	59
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	63
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	63

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	63
8.9 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	63
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	63
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	63
8.12 投资组合报告附注	63
§ 9 基金份额持有人信息	64
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	65
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情况	65
§ 10 开放式基金份额变动	65
§ 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	66
11.4 基金投资策略的改变	66
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	66
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	66
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	70
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	70
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	70
§ 13 备查文件目录	70
13.1 备查文件目录	70
13.2 存放地点	71
13.3 查阅方式	71

§ 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	352,979,840.70 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中信建投中证 1000 指数增强 A	中信建投中证 1000 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	015784	015785
报告期末下属分级基金的份额总额	239,216,150.30 份	113,763,690.40 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	<p>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。</p> <p>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。</p>
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 188 号鸿安国际大厦 6、8 层	北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层
邮政编码		100010	100020
法定代表人		黄凌	方合英

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.cfund108.com
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
注册登记机构	中信建投基金管理有限公司	北京市东城区朝阳门内大街 188 号鸿安国际大厦 6、8 层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2024 年		2023 年		2022 年 06 月 28 日（基金合同生效日）-2022 年 12 月 31 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	中信建投中证 1000 指数增强 A	中信建投中证 1000 指数增强 C	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	31,089,985.36	9,408,114.86	23,850,650.50	3,576,760.27	-26,883,645.59	-11,579,018.28

本期利润	25,400,191.41	8,609,580.40	45,224,669.93	11,992,156.91	-51,682,650.57	-20,622,448.37
加权平均基金份额本期利润	0.0891	0.0557	0.1253	0.0854	-0.0606	-0.0602
本期加权平均净值利润率	9.91%	6.29%	12.55%	8.64%	-6.19%	-6.15%
本期基金份额净值增长率	8.93%	8.50%	1.13%	0.72%	-6.01%	-6.20%
3.1.2 期末数据和指标	2024 年末		2023 年末		2022 年末	
期末可供分配利润	8,475,745.48	2,853,952.00	-15,056,258.69	-9,030,564.81	-43,248,636.58	-15,866,887.35
期末可供分配基金份额利润	0.0354	0.0251	-0.0495	-0.0552	-0.0601	-0.0620
期末基金资产净值	247,691,895.78	116,617,642.40	288,975,212.21	154,476,285.47	676,399,205.56	239,977,257.09
期末基金份额净值	1.0354	1.0251	0.9505	0.9448	0.9399	0.9380
3.1.	2024 年末		2023 年末		2022 年末	

3 累 计期 末指 标						
基金 份额 累计 净值 增长 率	3.54%	2.51%	-4.95%	-5.52%	-6.01%	-6.20%

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 净值表现

阶段	份额净值增 长率①	份额净值增 长率标准差 ②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①－③	②－④
过去三个月	6.42%	2.13%	4.36%	2.28%	2.06%	-0.15%
过去六个月	21.58%	2.03%	20.91%	2.13%	0.67%	-0.10%
过去一年	8.93%	1.97%	1.79%	2.01%	7.14%	-0.04%
自基金合同生 效起至今	3.54%	1.43%	-13.32%	1.49%	16.86%	-0.06%

中信建投中证 1000 指数增强 C 净值表现

阶段	份额净值增 长率①	份额净值增 长率标准差 ②	业绩比较基 准收益率③	业绩比较基 准收益率标 准差④	①－③	②－④
过去三个月	6.32%	2.13%	4.36%	2.28%	1.96%	-0.15%
过去六个月	21.34%	2.03%	20.91%	2.13%	0.43%	-0.10%
过去一年	8.50%	1.97%	1.79%	2.01%	6.71%	-0.04%
自基金合同生 效起至今	2.51%	1.43%	-13.32%	1.49%	15.83%	-0.06%

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12月31日)

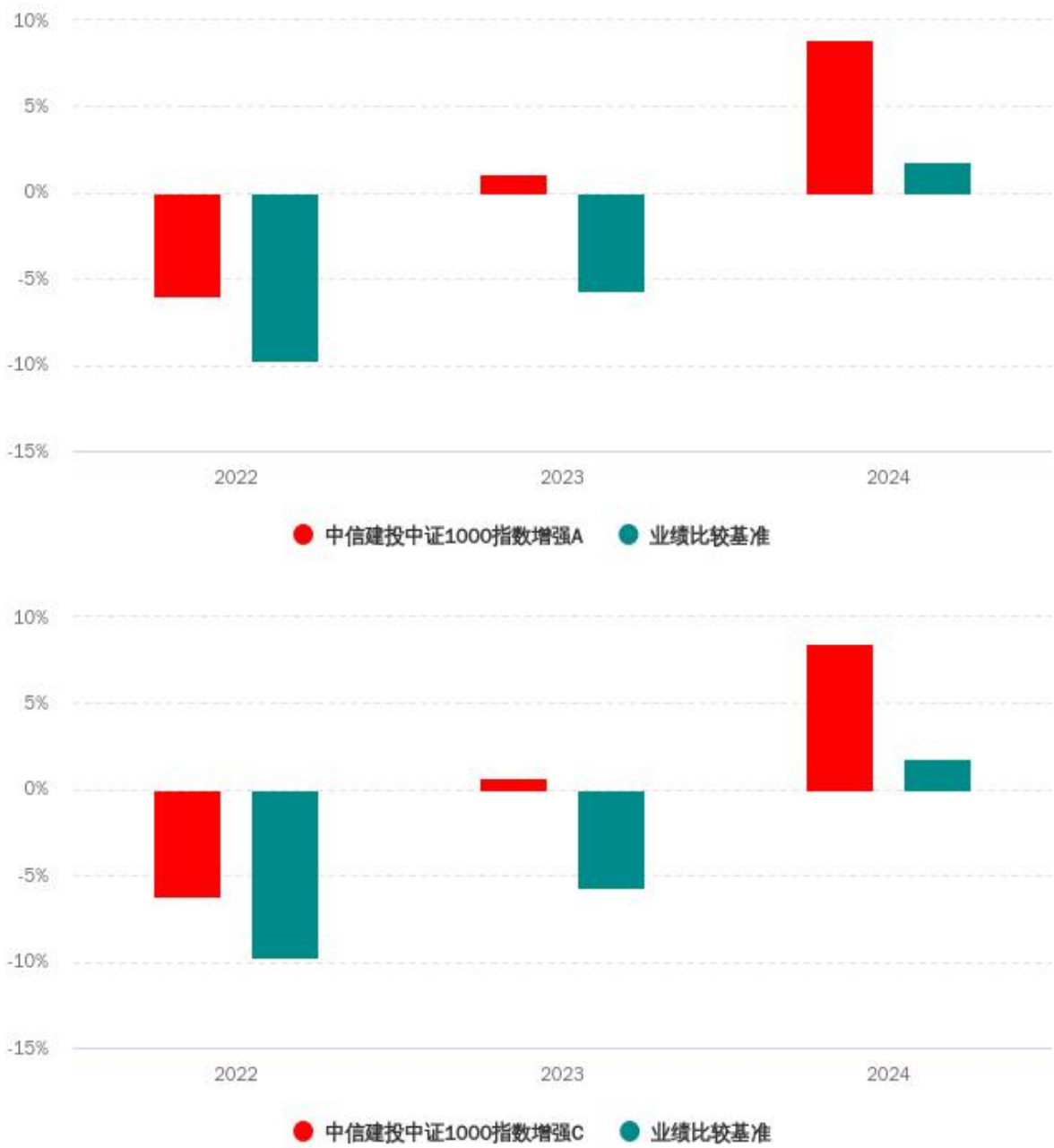


中信建投中证1000指数增强C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2022年06月28日-2024年12月31日)



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



注：基金合同生效当年按实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

§ 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 59 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《中信建投基金管理有限公司公平交易管理办法》。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。公司通过对不同时间窗口下的不同组合间股票和债券的同向交易进行价差分析，交易时机、交易价差和交易数量均可合理解释，未发现不同投资组合之间存在非公平交易的情况。

4.3.3 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

2024 年 A 股市场呈现“高波动、强分化”特征，量化投资领域经历了两轮极端压力测试。2024 年 1 月下旬到 2 月初，量化对冲和指数增强基金都面临了近年来的较大回撤。从空头端看，年初挂钩中证 500 和中证 1000 的雪球产品集中敲入，对股指期货市场造成了抛压，抛售盘扩大股指期货

贴水，基差的大幅震荡增加了量化中性产品的波动，由此导致的对冲成本快速增加，从多头端看，这一时期小市值股票被集中抛售，使得小微盘股票面临了一定的流动性危机，也间接导致了量化基金的超额出现了较大回撤。从公募量化基金的绩效表现看，300 指增、500 指增、1000 指增的平均超额最大回撤和量化对冲产品的平均最大回撤都在 3% 以上。经历此次回撤，我们在一季度末进行了策略迭代，进一步加强了在风险端的控制。

2024 年 9 月 24 日后，市场节奏快速变化、基差升水等因素导致了中性以及指增产品的回撤。一方面，2024 年 9 月下旬起，A 股市场出现快速反弹，四大股指期货亦大幅上涨，基差甚至出现久违的大幅升水情况。由于股指期货快速上涨，不少量化对冲基金的空头头寸出现大幅亏损，需要通过补充现金流或卖出股票来补充保证金，多数基金净值因此出现较大幅度回撤。另一方面，从多头端看，市场快速反弹，指数涨势迅猛，量化模型获取超额收益的难度增加，超额收益出现回撤。我们在此期间尽可能的打满仓位，以应对突发上涨行情。同时补充了爆发力较强的子策略作为超额的补充。

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 1.0354 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 8.93%，同期业绩比较基准收益率为 1.79%；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 1.0251 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 8.50%，同期业绩比较基准收益率为 1.79%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望后市，短期内市场将保持震荡整固。随着两会召开，2025 年 3 月中旬起业绩预告期到来，政策和业绩信号将成为投资者下一阶段的锚点。目前，市场对海外冲击的担忧较大，宏观政策的力度相对温和，因此市场整体保持谨慎态度。后续需要重点关注两会期间的经济目标及政策落实情况，静待政策的进一步发力。此外，业绩披露高峰期的到来将会成为短期投资焦点。中期来看，需求回稳与供给收缩带来的盈利改善与资金流入等中期环境更没有改变，资本市场的改革红利也仍将持续，从全球比较与选择的角度来看，中国资产信心重估的中期趋势预计也将延续。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人结合法律法规和业务发展的需要，进一步修订、完善了公司内部制度；组织多项合规培训，加强员工的风险意识和合规意识；针对投资研究等重点业务，加大检查力度，促进公司业务合法合规、稳健经营；积极参与新产品、新业务的设计，提出合规建议，对基金宣传推介、基金投资交易等方面积极开展各项合规管理工作，有效防范风险，规避违规行为的发生。

本报告期内，本基金管理人所管理的基金整体运作合法合规。本基金管理人将继续以风险控制为核心，坚持基金份额持有人利益优先的原则，提高监察稽核工作的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

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

本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术；建立了估值委员会，由公司分管运营领导任估值委员会主任，委员包括权益投资相关部门、固定收益部、多元资产配置部、研究部、特定资产管理部、稽控合规部、风险管理部、运营管理部门的部门负责人。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。

4.8 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。

4.9 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

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，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2025）审字第 70069507_A38 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	中信建投中证 1000 指数增强型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了中信建投中证 1000 指数增强型证券投资基金的财务报表，包括 2024 年 12 月 31 日的资产负债表，2024 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的中信建投中证 1000 指数增强型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了中信建投中证 1000 指数增强型证券投资基金 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师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，我们独立于中信建投中证 1000 指数增强型证券投资基金，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。</p>
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	<p>中信建投中证 1000 指数增强型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括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。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也</p>

	<p>不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>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。</p> <p>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。</p>
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>管理层负责按照企业会计准则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。</p> <p>在编制财务报表时，管理层负责评估中信建投中证 1000 指数增强型证券投资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，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>治理层负责监督中信建投中证 1000 指数增强型证券投资基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>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。</p> <p>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：</p> <p>（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。</p> <p>（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。</p> <p>（3）评价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。</p> <p>（4）对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，就可能导致对中信建投中证 1000 指数增强型证券投资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中信建投中证 1000 指数增强型证券投资基金不能持续经营。</p>

	<p>(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。</p> <p>我们与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。</p>	
会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	王珊珊	朱燕
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室	
审计报告日期	2025-03-28	

§ 7 年度财务报表

7.1 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 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	7.4.7.1	27,512,201.55	33,020,291.29
结算备付金		437,594.56	4,392,476.96
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	337,931,329.44	404,611,683.50
其中：股票投资		337,931,329.44	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		1,151,154.69	2,775,327.12
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		367,032,280.24	444,799,778.87
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-

交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		0.00	-
应付赎回款		2,170,193.12	715,704.80
应付管理人报酬		322,255.37	372,495.64
应付托管费		32,225.54	37,249.55
应付销售服务费		39,862.90	52,780.28
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	3.63
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	158,205.13	170,047.29
负债合计		2,722,742.06	1,348,281.19
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	352,979,840.70	467,538,321.18
未分配利润	7.4.7.8	11,329,697.48	-24,086,823.50
净资产合计		364,309,538.18	443,451,497.68
负债和净资产总计		367,032,280.24	444,799,778.87

注：报告截止日 2024 年 12 月 31 日，基金份额总额 352,979,840.70 份，其中中信建投中证 1000 指数增强 A 类基金份额净值 1.0354 元，基金份额 239,216,150.30 份；中信建投中证 1000 指数增强 C 类基金份额净值 1.0251 元，基金份额 113,763,690.40 份。

7.2 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
一、营业总收入		39,049,913.45	63,533,569.86
1. 利息收入		172,081.92	242,134.04
其中：存款利息收入	7.4.7.9	172,081.92	242,134.04
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）		44,865,106.93	33,170,526.31
其中：股票投资收益	7.4.7.10	39,410,311.56	27,753,391.00
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	168,454.74	913,722.77

资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.12	-	338,965.65
股利收益	7.4.7.13	5,286,340.63	4,164,446.89
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.14	-6,488,328.41	29,789,416.07
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	501,053.01	331,493.44
减：二、营业总支出		5,040,141.64	6,316,743.02
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	3,935,725.10	5,065,325.28
2. 托管费	7.4.10.2.2	393,572.52	506,532.53
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	547,908.03	561,991.11
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.16	-	-
7. 税金及附加		1.59	1,036.19
8. 其他费用	7.4.7.17	162,934.40	181,857.91
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		34,009,771.81	57,216,826.84
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		34,009,771.81	57,216,826.84
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		34,009,771.81	57,216,826.84

7.3 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 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	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)	-114,558,480.48	35,416,520.98	-79,141,959.50
（一）、综合收益总额	-	34,009,771.81	34,009,771.81
（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）	-114,558,480.48	1,406,749.17	-113,151,731.31
其中：1. 基金申购款	289,329,215.40	-23,454,079.23	265,875,136.17
2. 基金赎回款	-403,887,695.88	24,860,828.40	-379,026,867.48

(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	352,979,840.70	11,329,697.48	364,309,538.18
项 目	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 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	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)	-507,953,665.40	35,028,700.43	-472,924,964.97
(一)、综合收益总额	-	57,216,826.84	57,216,826.84
(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)	-507,953,665.40	-22,188,126.41	-530,141,791.81
其中：1. 基金申购款	288,363,385.22	-3,850,639.27	284,512,745.95
2. 基金赎回款	-796,317,050.62	-18,337,487.14	-814,654,537.76
(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	467,538,321.18	-24,086,823.50	443,451,497.68

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

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

7.4 报表附注

7.4.1 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 \times 95%+中证综合债指数收益率 \times 5%。

7.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本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于 2024 年 12 月 31 日的财务状况以及 2024 年度的经营成果和净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度采用公历年度，即自 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

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

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

（1）金融资产分类

本基金的金融资产于初始确认时根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以摊余成本计量的金融资产；

（2）金融负债分类

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

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

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

划分为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，以及不作为有效套期工具的衍生工具，按照取得时的公允价值作为初始确认金额，相关的交易费用在发生时计入当期损益；

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值，是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。本基金以公允价值计量相关资产或负债，假定出售资产或者转移负债的有序交易在相关资产或负债的主要市场进行；不存在主要市场的，本基金假定该交易在相关资产或负债的最有利市场进行。主要市场（或最有利市场）是本基金在计量日能够进入的交易市场。本基金采用市场参与者在对该资产或负债定价时为实现其经济利益最大化所使用的假设。

在财务报表中以公允价值计量或披露的资产和负债，根据对公允价值计量整体而言具有重要意义的高低层次输入值，确定所属的公允价值层次：第一层次输入值，在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次输入值，除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次输入值，相关资产或负债的不可观察输入值。

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

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

- （1）存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整

的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

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

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

当本基金具有抵销已确认金融资产和金融负债的法定权利，且该种法定权利现在是可执行的，同时本基金计划以净额结算或同时变现该金融资产和清偿该金融负债时，金融资产和金融负债以相互抵销后的金额在资产负债表内列示。除此以外，金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，不予相互抵销。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现收益/（损失）占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现利得/（损失）占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日确认。未实现损益平准金与已实现损益平准金均在“损益平准金”科目中核算，并于期末全额转入“未分配利润/（累计亏损）”。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

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

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

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

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

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

(6) 公允价值变动收益系本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动扣除在适用情况下公允价值变动产生的预估增值税后的净额形成的应计入当期损益的利得或损失；

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

- (1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；
- (2) 能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；
- (3) 能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

(1) 印花税

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

根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

(2) 增值税

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

根据财政部、国家税务总局财税〔2016〕46 号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》的规定，金融机构开展的质押式买入返售金融商品业务及持有政策性金融债券取得的利息收入属于金融同业往来利息收入；

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

根据财政部、国家税务总局财税〔2016〕140 号《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税〔2017〕56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，

自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额；

根据财政部、国家税务总局财税〔2017〕90 号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以利息及利息性质的收入为销售额；

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

（3）企业所得税

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

根据财政部、国家税务总局财税〔2008〕1 号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》的规定，对证券投资基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股权的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

（4）个人所得税

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

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税〔2012〕85 号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2013 年 1 月 1 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限在 1 个月以内（含 1 个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在 1 个月以上至 1 年（含 1 年）的，暂减按 50% 计入应纳税所得额；持股期限超过 1 年的，暂减按 25% 计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20% 的税率计征个人所得税；

根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税〔2015〕101 号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》的规定，自 2015 年 9 月 8 日起，证券投资基金从公开发行和转让市场取得的上市公司股票，持股期限超过 1 年的，股息红利所得暂免征收个人所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	5,326,250.90	3,778,179.64
等于：本金	5,325,185.85	3,777,561.01
加：应计利息	1,065.05	618.63

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	22,185,950.65	29,242,111.65
等于：本金	22,184,258.10	29,238,767.12
加：应计利息	1,692.55	3,344.53
减：坏账准备	-	-
合计	27,512,201.55	33,020,291.29

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2024 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		348,472,676.85	-	337,931,329.44	-10,541,347.41
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		348,472,676.85	-	337,931,329.44	-10,541,347.41
项目		上年度末 2023 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		408,126,631.80	-	404,065,217.86	-4,061,413.94
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	538,000.00	70.70	546,465.64	8,394.94
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	538,000.00	70.70	546,465.64	8,394.94
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		408,664,631.80	70.70	404,611,683.50	-4,053,019.00

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

无余额。

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

无余额。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

7.4.7.5 其他资产

无余额。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	0
应付赎回费	205.13	47.29
应付证券出借违约金	-	0
应付交易费用	-	0
其中：交易所市场	-	0
银行间市场	-	0
应付利息	-	0
预提费用	158,000.00	170,000.00
合计	158,205.13	170,047.29

7.4.7.7 实收基金

中信建投中证 1000 指数增强 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 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	133,862,788.05	133,862,788.05
本期赎回（以“-”号填列）	-198,678,108.65	-198,678,108.65
本期末	239,216,150.30	239,216,150.30

中信建投中证 1000 指数增强 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 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	155,466,427.35	155,466,427.35
本期赎回（以“-”号填列）	-205,209,587.23	-205,209,587.23
本期末	113,763,690.40	113,763,690.40

7.4.7.8 未分配利润

中信建投中证 1000 指数增强 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	-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	31,089,985.36	-5,689,793.95	25,400,191.41
本期基金份额交易产生的变动数	440,836.86	-2,309,024.10	-1,868,187.24
其中：基金申购款	-8,741,755.45	127,680.15	-8,614,075.30
基金赎回款	9,182,592.31	-2,436,704.25	6,745,888.06
本期已分配利润	-	-	-
本期末	24,974,216.73	-16,498,471.25	8,475,745.48

中信建投中证 1000 指数增强 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	-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	9,408,114.86	-798,534.46	8,609,580.40
本期基金份额交易产生的变动数	5,704,415.48	-2,429,479.07	3,274,936.41
其中：基金申购款	-11,503,648.03	-3,336,355.90	-14,840,003.93
基金赎回款	17,208,063.51	906,876.83	18,114,940.34
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,645,520.58	-7,791,568.58	2,853,952.00

7.4.7.9 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	39,188.84	50,839.51
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	86,690.69	105,053.10
结算备付金利息收入	45,117.60	86,239.99
其他	1,084.79	1.44
合计	172,081.92	242,134.04

7.4.7.10 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	4,402,683,226.97	5,664,159,368.96
减：卖出股票成本总额	4,357,786,912.64	5,626,075,637.78
减：交易费用	5,486,002.77	10,330,340.18
买卖股票差价收入	39,410,311.56	27,753,391.00

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
债券投资收益——利息收入	510.10	1,115.96
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	167,944.64	912,606.81
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	168,454.74	913,722.77

7.4.7.11.2 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	786,073.33	4,245,316.74
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	617,500.00	3,331,200.00

减：应计利息总额	596.53	1,311.44
减：交易费用	32.16	198.49
买卖债券差价收入	167,944.64	912,606.81

7.4.7.12 衍生工具收益

7.4.7.12.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.12.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
期货投资	-	338,965.65

7.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	5,286,340.63	4,164,446.89
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	5,286,340.63	4,164,446.89

7.4.7.14 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 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-6,488,328.41	29,789,416.07
——股票投资	-6,479,933.47	29,875,518.10
——债券投资	-8,394.94	-86,102.03
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	-
——权证投资	-	-
3. 其他	-	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-	-
合计	-6,488,328.41	29,789,416.07

7.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	492,941.48	331,493.44
转换费收入	8,111.53	-
合计	501,053.01	331,493.44

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%。

7.4.7.16 信用减值损失

无。

7.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
审计费用	38,000.00	50,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
汇划手续费	4,934.40	11,857.91
合计	162,934.40	181,857.91

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，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中信建投证券股份有限公司	6,089,163,166.39	69.98%	6,332,635,508.18	58.42%

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 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
中信建投证券股份有限公司	413,464.26	52.60%	2,504,570.24	59.00%

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 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中信建投证券股份有限公司	1,817,643.47	66.66%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 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
中信建投证券股份有限公司	2,697,540.48	58.31%	-	-

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

2、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。根据证监会公告〔2024〕3 号《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自 2024 年 7 月 1 日起，针对被动股票型基金，不再通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用。针对其他类型基金，不再通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,935,725.10	5,065,325.28
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,698,024.16	2,310,331.72
应支付基金管理人的净管理费	2,237,700.94	2,754,993.56

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	393,572.52	506,532.53

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%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：
日托管费＝前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中信建投中证 1000 指数增强 A	中信建投中证 1000 指数增强 C	合计
中信银行股份有限公司	-	42,812.45	42,812.45
中信建投基金管理有限公司	-	20,136.99	20,136.99
中信建投证券股份有限公司	-	208,179.68	208,179.68
合计	-	271,129.12	271,129.12

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 12 月 31 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	-	289,822.45	289,822.45
中信银行股份有限公司	-	52,388.39	52,388.39
合计	-	342,210.84	342,210.84

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。

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 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 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 12 月 31 日		上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信银行股份有限公司	5,326,250.90	39,188.84	3,778,179.64	50,839.51
中信建投证券股份有限公司	14,821,840.82	43,019.25	15,077,125.78	51,202.85

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

7.4.10.6 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

本期 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 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：）	总金额

				股/张)	
-	-	-	-	-	-
上年度可比期间 2023 年 01 月 01 日至 2023 年 12 月 31 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： 股/张）	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

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

无。

7.4.12 期末（2024 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

无。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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，将风险控制可在可承受的范围内。

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、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

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

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

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无余额。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无余额。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无余额。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
AAA	-	-

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。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无余额。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无余额。

7.4.13.3 流动性风险

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

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

于本期末，除附注 7.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在一个月以内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他金融负债的合同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。

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时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注 7.4.12（如有）。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

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

额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	27,512,201.55	-	-	-	27,512,201.55
结算备付金	437,594.56	-	-	-	437,594.56
交易性金融资产	-	-	-	337,931,329.44	337,931,329.44
应收申购款	-	-	-	1,151,154.69	1,151,154.69
资产总计	27,949,796.11	-	-	339,082,484.13	367,032,280.24
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,170,193.12	2,170,193.12
应付管理人报酬	-	-	-	322,255.37	322,255.37
应付托管费	-	-	-	32,225.54	32,225.54
应付销售服务费	-	-	-	39,862.90	39,862.90
其他负债	-	-	-	158,205.13	158,205.13
负债总计	-	-	-	2,722,742.06	2,722,742.06
利率敏感度缺口	27,949,796.11	-	-	336,359,742.07	364,309,538.18
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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本期末及上年度末，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金净资产的比例并不重大，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响。

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

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

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

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
----	----------------------	-----------------------

	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	337,931,329.44	92.76	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	337,931,329.44	92.76	404,611,683.50	91.24

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	17,669,893.53	20,697,358.26
	业绩比较基准下降 5%	-17,669,893.53	-20,697,358.26

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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 12 月 31 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	337,931,329.44	402,626,940.36
第二层次	—	1,984,743.14
第三层次	—	—
合计	337,931,329.44	404,611,683.50

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

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

投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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 2024 年 01 月 01 日至 2024 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	-	-	-
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 2023 年 01 月 01 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	-	1,390,510.47	1,390,510.47
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	139,373.81	139,373.81
转出第三层次	-	1,803,010.76	1,803,010.76
当期利得或损失总额	-	273,126.48	273,126.48
其中：计入损益的利得或损失	-	273,126.48	273,126.48
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
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：本报告期不涉及第三层次的交易性金融资产。

于 2023 年度，本基金从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资。

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

7.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2025 年 3 月 28 日经本基金的基金管理人批准。

§ 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	337,931,329.44	92.07
	其中：股票	337,931,329.44	92.07
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	27,949,796.11	7.62
8	其他各项资产	1,151,154.69	0.31
9	合计	367,032,280.24	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	4,703,921.00	1.29
B	采矿业	9,467,726.00	2.60
C	制造业	192,252,540.06	52.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,450,111.00	2.04
E	建筑业	9,309,305.00	2.56
F	批发和零售业	12,806,347.00	3.52
G	交通运输、仓储和邮政业	8,610,191.00	2.36
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	39,089,756.80	10.73
J	金融业	4,569,087.00	1.25
K	房地产业	4,889,704.00	1.34
L	租赁和商务服务业	6,248,138.00	1.72
M	科学研究和技术服务业	6,252,909.00	1.72
N	水利、环境和公共设施管理业	1,740,472.00	0.48
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	145,280.00	0.04
R	文化、体育和娱乐业	6,934,506.00	1.90
S	综合	-	-
	合计	314,469,993.86	86.32

8.2.2 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	263,970.00	0.07
C	制造业	18,484,226.18	5.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	130,416.00	0.04
E	建筑业	133,055.00	0.04
F	批发和零售业	920,488.00	0.25
G	交通运输、仓储和邮政业	137,511.00	0.04
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,091,912.00	0.57
J	金融业	385,794.00	0.11
K	房地产业	134,277.00	0.04
L	租赁和商务服务业	-	-

M	科学研究和技术服务业	387,835.00	0.11
N	水利、环境和公共设施管理业	391,851.40	0.11
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	-	-
S	综合	-	-
	合计	23,461,335.58	6.44

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无余额。

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

8.3.1 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	688372	伟测科技	45,595	2,668,219.40	0.73
2	002061	浙江交科	609,500	2,486,760.00	0.68
3	002100	天康生物	376,000	2,462,800.00	0.68
4	300768	迪普科技	139,000	2,432,500.00	0.67
5	002212	天融信	376,400	2,427,780.00	0.67
6	300415	伊之密	116,500	2,336,990.00	0.64
7	600248	陕建股份	518,500	2,322,880.00	0.64
8	002139	拓邦股份	170,300	2,317,783.00	0.64
9	000415	渤海租赁	614,400	2,316,288.00	0.64
10	600216	浙江医药	145,900	2,313,974.00	0.64
11	002396	星网锐捷	120,200	2,282,598.00	0.63
12	000603	盛达资源	189,400	2,270,906.00	0.62
13	300035	中科电气	151,700	2,267,915.00	0.62
14	600064	南京高科	291,200	2,262,624.00	0.62
15	603118	共进股份	252,060	2,243,334.00	0.62
16	002226	江南化工	404,900	2,194,558.00	0.60
17	600428	中远海特	295,000	2,153,500.00	0.59
18	002091	江苏国泰	291,500	2,133,780.00	0.59
19	300151	昌红科技	125,300	2,130,100.00	0.58
20	605589	圣泉集团	88,800	2,093,904.00	0.57
21	600757	长江传媒	218,500	2,091,045.00	0.57
22	300627	华测导航	48,800	2,039,840.00	0.56
23	002567	唐人神	397,900	2,029,290.00	0.56
24	002967	广电计量	123,700	2,028,680.00	0.56

25	600301	华锡有色	117,800	2,003,778.00	0.55
26	300761	立华股份	102,600	1,996,596.00	0.55
27	300525	博思软件	125,900	1,961,522.00	0.54
28	002020	京新药业	146,500	1,875,200.00	0.51
29	300232	洲明科技	271,800	1,867,266.00	0.51
30	300181	佐力药业	120,600	1,852,416.00	0.51
31	688408	中信博	25,363	1,826,136.00	0.50
32	600827	百联股份	161,100	1,760,823.00	0.48
33	000680	山推股份	178,500	1,731,450.00	0.48
34	603888	新华网	77,500	1,731,350.00	0.48
35	688127	蓝特光学	63,100	1,710,010.00	0.47
36	002906	华阳集团	55,100	1,694,325.00	0.47
37	600728	佳都科技	358,800	1,679,184.00	0.46
38	688596	正帆科技	46,549	1,654,816.95	0.45
39	600266	城建发展	321,900	1,641,690.00	0.45
40	002249	大洋电机	277,000	1,625,990.00	0.45
41	002036	联创电子	169,000	1,588,600.00	0.44
42	002332	仙琚制药	159,400	1,584,436.00	0.43
43	300475	香农芯创	55,000	1,566,950.00	0.43
44	002668	TCL 智家	119,100	1,562,592.00	0.43
45	000528	柳 工	127,600	1,538,856.00	0.42
46	002895	川恒股份	62,100	1,527,660.00	0.42
47	688337	普源精电	38,900	1,517,100.00	0.42
48	000951	中国重汽	89,300	1,516,314.00	0.42
49	601801	皖新传媒	204,300	1,499,562.00	0.41
50	603588	高能环境	286,000	1,498,640.00	0.41
51	300682	朗新集团	122,000	1,488,400.00	0.41
52	601107	四川成渝	282,000	1,474,860.00	0.40
53	002043	兔 宝 宝	123,700	1,469,556.00	0.40
54	600812	华北制药	280,400	1,449,668.00	0.40
55	600138	中青旅	142,200	1,441,908.00	0.40
56	600338	西藏珠峰	134,100	1,430,847.00	0.39
57	600531	豫光金铅	220,800	1,417,536.00	0.39
58	600718	东软集团	130,200	1,402,254.00	0.38
59	300705	九典制药	76,100	1,365,995.00	0.37
60	000049	德赛电池	58,100	1,365,931.00	0.37
61	300702	天宇股份	80,500	1,341,130.00	0.37
62	000065	北方国际	137,000	1,339,860.00	0.37
63	688200	华峰测控	12,815	1,339,167.50	0.37
64	000672	上峰水泥	174,800	1,337,220.00	0.37
65	600552	凯盛科技	116,700	1,331,547.00	0.37
66	301050	雷电微力	25,800	1,330,764.00	0.37
67	601069	西部黄金	115,300	1,320,185.00	0.36

68	300638	广和通	65,400	1,317,810.00	0.36
69	601900	南方传媒	86,400	1,305,504.00	0.36
70	002745	木林森	147,500	1,286,200.00	0.35
71	601222	林洋能源	181,600	1,283,912.00	0.35
72	603612	索通发展	94,500	1,276,695.00	0.35
73	002901	大博医疗	41,200	1,270,608.00	0.35
74	300726	宏达电子	40,500	1,259,550.00	0.35
75	603039	泛微网络	25,700	1,259,300.00	0.35
76	000758	中色股份	253,900	1,254,266.00	0.34
77	000927	中国铁物	472,900	1,243,727.00	0.34
78	688128	中国电研	58,572	1,230,597.72	0.34
79	000928	中钢国际	192,600	1,226,862.00	0.34
80	601137	博威合金	59,600	1,209,880.00	0.33
81	603368	柳药集团	66,300	1,184,118.00	0.33
82	301087	可孚医疗	33,300	1,177,488.00	0.32
83	603609	禾丰股份	136,400	1,175,768.00	0.32
84	600073	光明肉业	165,600	1,149,264.00	0.32
85	300973	立高食品	29,400	1,147,482.00	0.31
86	688131	皓元医药	31,978	1,141,614.60	0.31
87	688409	富创精密	22,124	1,140,934.68	0.31
88	600850	电科数字	47,700	1,140,030.00	0.31
89	688270	臻镭科技	32,520	1,138,200.00	0.31
90	301262	海看股份	45,500	1,131,585.00	0.31
91	002550	千红制药	180,800	1,120,960.00	0.31
92	002004	华邦健康	246,800	1,115,536.00	0.31
93	300674	宇信科技	56,900	1,110,688.00	0.30
94	300777	中简科技	39,000	1,103,310.00	0.30
95	600861	北京人力	56,900	1,101,015.00	0.30
96	600273	嘉化能源	137,700	1,097,469.00	0.30
97	603301	振德医疗	49,900	1,097,301.00	0.30
98	301327	华宝新能	14,200	1,089,282.00	0.30
99	000686	东北证券	137,000	1,087,780.00	0.30
100	605333	沪光股份	33,200	1,083,316.00	0.30
101	600320	振华重工	272,600	1,068,592.00	0.29
102	600595	中孚实业	376,500	1,065,495.00	0.29
103	301031	中熔电气	10,200	1,061,004.00	0.29
104	688568	中科星图	20,600	1,051,218.00	0.29
105	002063	远光软件	181,300	1,044,288.00	0.29
106	300926	博俊科技	47,100	1,036,671.00	0.28
107	601015	陕西黑猫	306,100	1,022,374.00	0.28
108	002145	中核钛白	239,900	1,017,176.00	0.28
109	002626	金达威	67,300	1,016,230.00	0.28
110	600996	贵广网络	118,600	1,014,030.00	0.28

111	002583	海能达	70,900	1,007,489.00	0.28
112	688798	艾为电子	14,400	1,005,408.00	0.28
113	688232	新点软件	34,600	1,003,054.00	0.28
114	300134	大富科技	85,500	1,002,915.00	0.28
115	601083	锦江航运	105,100	1,000,552.00	0.27
116	300079	数码视讯	184,900	1,000,309.00	0.27
117	002891	中宠股份	27,500	981,750.00	0.27
118	002705	新宝股份	65,200	978,000.00	0.27
119	603075	热威股份	51,800	965,034.00	0.26
120	600648	外高桥	80,600	959,946.00	0.26
121	002716	湖南白银	279,400	947,166.00	0.26
122	002545	东方铁塔	134,200	943,426.00	0.26
123	603477	巨星农牧	53,100	942,525.00	0.26
124	688515	裕太微	9,500	940,500.00	0.26
125	688206	概伦电子	49,500	936,045.00	0.26
126	601609	金田股份	158,100	932,790.00	0.26
127	600305	恒顺醋业	116,100	926,478.00	0.25
128	003006	百亚股份	38,600	926,014.00	0.25
129	603337	杰克股份	30,200	919,892.00	0.25
130	688321	微芯生物	49,500	919,710.00	0.25
131	002698	博实股份	53,800	914,600.00	0.25
132	600572	康恩贝	195,300	910,098.00	0.25
133	000682	东方电子	84,900	909,279.00	0.25
134	300398	飞凯材料	56,600	892,016.00	0.24
135	000029	深深房 A	59,000	888,540.00	0.24
136	603355	莱克电气	39,200	887,880.00	0.24
137	002534	西子洁能	79,900	887,689.00	0.24
138	603693	江苏新能	90,100	887,485.00	0.24
139	600618	氯碱化工	90,000	887,400.00	0.24
140	601369	陕鼓动力	102,000	887,400.00	0.24
141	605296	神农集团	32,000	886,400.00	0.24
142	600158	中体产业	107,100	885,717.00	0.24
143	605507	国邦医药	42,500	885,275.00	0.24
144	603638	艾迪精密	52,400	885,036.00	0.24
145	000966	长源电力	186,100	883,975.00	0.24
146	688209	英集芯	50,000	883,500.00	0.24
147	002237	恒邦股份	87,400	882,740.00	0.24
148	000685	中山公用	95,600	882,388.00	0.24
149	002468	申通快递	87,100	882,323.00	0.24
150	002928	华夏航空	113,700	882,312.00	0.24
151	300770	新媒股份	21,800	880,938.00	0.24
152	300482	万孚生物	39,300	880,713.00	0.24
153	601311	骆驼股份	106,100	879,569.00	0.24

154	000048	京基智农	48,800	878,400.00	0.24
155	300827	上能电气	20,000	878,000.00	0.24
156	600420	国药现代	73,500	877,590.00	0.24
157	300579	数字认证	27,900	876,618.00	0.24
158	300685	艾德生物	38,400	875,520.00	0.24
159	600100	同方股份	123,000	874,530.00	0.24
160	300666	江丰电子	12,300	854,235.00	0.23
161	600037	歌华有线	114,300	852,678.00	0.23
162	688019	安集科技	6,100	850,096.00	0.23
163	603162	海通发展	89,900	827,080.00	0.23
164	002649	博彦科技	68,200	826,584.00	0.23
165	600667	太极实业	119,200	824,864.00	0.23
166	603008	喜临门	49,000	821,240.00	0.23
167	600869	远东股份	172,500	819,375.00	0.22
168	600328	中盐化工	102,000	802,740.00	0.22
169	688150	莱特光电	35,300	794,956.00	0.22
170	603995	甬金股份	42,900	784,641.00	0.22
171	688007	光峰科技	52,963	783,322.77	0.22
172	603283	赛腾股份	11,300	781,508.00	0.21
173	603055	台华新材	70,300	778,924.00	0.21
174	688658	悦康药业	53,900	776,699.00	0.21
175	300083	创世纪	117,600	765,576.00	0.21
176	603985	恒润股份	65,000	759,200.00	0.21
177	601886	江河集团	140,200	757,080.00	0.21
178	002859	洁美科技	36,400	755,300.00	0.21
179	002123	梦网科技	69,600	752,376.00	0.21
180	000821	京山轻机	60,200	749,490.00	0.21
181	002291	遥望科技	118,700	748,997.00	0.21
182	300772	运达股份	56,100	742,764.00	0.20
183	301376	致欧科技	36,200	692,144.00	0.19
184	002991	甘源食品	7,400	692,048.00	0.19
185	688739	成大生物	26,800	690,904.00	0.19
186	600894	广日股份	47,300	690,580.00	0.19
187	600478	科力远	166,700	688,471.00	0.19
188	002023	海特高新	67,400	684,110.00	0.19
189	603393	新天然气	22,200	671,994.00	0.18
190	001301	尚太科技	9,800	671,790.00	0.18
191	600664	哈药股份	162,400	670,712.00	0.18
192	002267	陕天然气	79,000	667,550.00	0.18
193	603699	纽威股份	29,600	656,232.00	0.18
194	002461	珠江啤酒	66,300	655,707.00	0.18
195	002204	大连重工	131,500	654,870.00	0.18
196	688612	威迈斯	27,700	652,058.00	0.18

197	603317	天味食品	48,700	649,658.00	0.18
198	601096	宏盛华源	149,100	648,585.00	0.18
199	002088	鲁阳节能	50,700	648,453.00	0.18
200	688336	三生国健	30,200	646,884.00	0.18
201	002053	云南能投	56,700	646,380.00	0.18
202	600366	宁波韵升	87,800	646,208.00	0.18
203	601068	中铝国际	146,500	646,065.00	0.18
204	002948	青岛银行	166,500	646,020.00	0.18
205	600993	马应龙	24,700	644,917.00	0.18
206	600874	创业环保	107,900	644,163.00	0.18
207	600017	日照港	201,300	644,160.00	0.18
208	002399	海普瑞	60,200	643,538.00	0.18
209	000881	中广核技	87,500	641,375.00	0.18
210	600058	五矿发展	89,900	640,088.00	0.18
211	600169	太原重工	256,300	638,187.00	0.18
212	002755	奥赛康	50,200	638,042.00	0.18
213	601778	晶科科技	226,200	637,884.00	0.18
214	601811	新华文轩	40,200	637,170.00	0.17
215	002506	协鑫集成	238,600	637,062.00	0.17
216	603439	贵州三力	49,000	637,000.00	0.17
217	600961	株冶集团	80,900	636,683.00	0.17
218	300113	顺网科技	37,800	635,418.00	0.17
219	301500	飞南资源	35,300	635,400.00	0.17
220	000969	安泰科技	56,900	634,435.00	0.17
221	603766	隆鑫通用	69,700	634,270.00	0.17
222	600640	国脉文化	53,100	634,014.00	0.17
223	300261	雅本化学	92,400	632,940.00	0.17
224	301219	腾远钴业	13,998	632,849.58	0.17
225	603583	捷昌驱动	25,600	632,576.00	0.17
226	688523	航天环宇	31,600	632,000.00	0.17
227	600783	鲁信创投	49,600	628,432.00	0.17
228	603025	大豪科技	41,200	628,300.00	0.17
229	002456	欧菲光	52,400	627,752.00	0.17
230	688076	诺泰生物	12,070	626,674.40	0.17
231	001270	铖昌科技	16,420	625,602.00	0.17
232	002446	盛路通信	95,400	624,870.00	0.17
233	688348	昱能科技	12,800	624,640.00	0.17
234	000917	电广传媒	88,300	624,281.00	0.17
235	300088	长信科技	95,400	623,916.00	0.17
236	603690	至纯科技	24,800	622,728.00	0.17
237	002097	山河智能	82,900	621,750.00	0.17
238	300634	彩讯股份	28,500	621,300.00	0.17
239	300188	国投智能	44,400	612,276.00	0.17

240	688380	中微半导	20,255	605,624.50	0.17
241	300183	东软载波	30,700	594,045.00	0.16
242	300180	华峰超纤	91,000	573,300.00	0.16
243	605599	菜百股份	50,500	573,175.00	0.16
244	603043	广州酒家	33,800	562,094.00	0.15
245	000627	天茂集团	119,700	558,999.00	0.15
246	600729	重庆百货	19,100	558,675.00	0.15
247	002108	沧州明珠	155,400	557,886.00	0.15
248	605123	派克新材	10,300	553,728.00	0.15
249	688183	生益电子	13,934	547,048.84	0.15
250	603171	税友股份	17,900	545,950.00	0.15
251	688066	航天宏图	26,760	545,904.00	0.15
252	603169	兰石重装	99,900	544,455.00	0.15
253	300101	振芯科技	25,100	543,666.00	0.15
254	600643	爱建集团	104,300	539,231.00	0.15
255	300570	太辰光	7,400	537,980.00	0.15
256	600556	天下秀	103,400	537,680.00	0.15
257	301180	万祥科技	34,700	536,809.00	0.15
258	688326	经纬恒润	6,300	529,830.00	0.15
259	301039	中集车辆	57,100	516,755.00	0.14
260	300133	华策影视	71,400	515,508.00	0.14
261	002405	四维图新	51,300	494,532.00	0.14
262	600403	大有能源	167,300	491,862.00	0.14
263	688083	中望软件	5,700	487,749.00	0.13
264	600395	盘江股份	95,800	487,622.00	0.13
265	002539	云图控股	62,100	485,622.00	0.13
266	300737	科顺股份	93,900	476,073.00	0.13
267	603566	普莱柯	37,200	474,672.00	0.13
268	002015	协鑫能科	59,500	461,720.00	0.13
269	002605	姚记科技	17,000	453,220.00	0.12
270	000600	建投能源	79,000	447,140.00	0.12
271	688208	道通科技	11,350	444,466.00	0.12
272	600063	皖维高新	110,700	442,800.00	0.12
273	600120	浙江东方	95,000	442,700.00	0.12
274	600557	康缘药业	31,400	427,668.00	0.12
275	600459	贵研铂业	30,800	422,884.00	0.12
276	000657	中钨高新	45,400	418,134.00	0.11
277	301047	义翘神州	6,700	414,395.00	0.11
278	301015	百洋医药	16,900	409,149.00	0.11
279	300115	长盈精密	23,700	384,888.00	0.11
280	600210	紫江企业	56,200	371,482.00	0.10
281	000422	湖北宜化	28,400	358,408.00	0.10
282	601677	明泰铝业	29,700	357,291.00	0.10

283	002233	塔牌集团	45,700	350,519.00	0.10
284	300352	北信源	65,800	347,424.00	0.10
285	300077	国民技术	14,300	340,912.00	0.09
286	002317	众生药业	27,800	337,770.00	0.09
287	300363	博腾股份	21,300	335,901.00	0.09
288	002428	云南锗业	17,600	332,640.00	0.09
289	603919	金徽酒	16,900	331,240.00	0.09
290	300443	金雷股份	16,600	330,672.00	0.09
291	603100	川仪股份	15,100	325,405.00	0.09
292	600477	杭萧钢构	126,600	325,362.00	0.09
293	002051	中工国际	39,500	322,320.00	0.09
294	688389	普门科技	21,628	322,040.92	0.09
295	603299	苏盐井神	28,500	317,490.00	0.09
296	300315	掌趣科技	55,600	305,800.00	0.08
297	002003	伟星股份	21,000	297,570.00	0.08
298	301268	铭利达	17,900	296,782.00	0.08
299	603383	顶点软件	7,300	273,750.00	0.08
300	000767	晋控电力	108,000	273,240.00	0.08
301	688526	科前生物	18,800	268,652.00	0.07
302	300470	中密控股	7,100	267,670.00	0.07
303	688185	康希诺	4,112	251,037.60	0.07
304	603197	保隆科技	6,500	245,375.00	0.07
305	000902	新洋丰	18,800	245,152.00	0.07
306	600916	中国黄金	28,300	243,946.00	0.07
307	600269	赣粤高速	43,400	243,474.00	0.07
308	688029	南微医学	3,600	243,324.00	0.07
309	600116	三峡水利	34,800	243,252.00	0.07
310	601333	广深铁路	70,800	242,844.00	0.07
311	002701	奥瑞金	42,800	242,676.00	0.07
312	601200	上海环境	29,600	241,832.00	0.07
313	600388	龙净环保	19,100	241,615.00	0.07
314	603279	景津装备	13,500	241,380.00	0.07
315	603733	仙鹤股份	11,700	241,371.00	0.07
316	000791	甘肃能源	40,000	241,200.00	0.07
317	002060	广东建工	65,900	241,194.00	0.07
318	000090	天健集团	58,600	240,846.00	0.07
319	601952	苏垦农发	24,600	240,834.00	0.07
320	603323	苏农银行	45,500	240,695.00	0.07
321	600750	江中药业	10,600	240,620.00	0.07
322	600502	安徽建工	50,300	240,434.00	0.07
323	000875	吉电股份	45,700	240,382.00	0.07
324	600710	苏美达	25,800	239,940.00	0.07
325	601528	瑞丰银行	42,500	239,275.00	0.07

326	002221	东华能源	25,200	239,148.00	0.07
327	601208	东材科技	31,500	237,510.00	0.07
328	601126	四方股份	14,000	237,440.00	0.07
329	002101	广东鸿图	19,700	236,006.00	0.06
330	688100	威胜信息	6,500	235,300.00	0.06
331	300776	帝尔激光	3,700	235,246.00	0.06
332	600559	老白干酒	11,200	235,088.00	0.06
333	688432	有研硅	20,612	232,915.60	0.06
334	002194	武汉凡谷	20,700	232,254.00	0.06
335	688630	芯碁微装	4,000	230,880.00	0.06
336	688088	虹软科技	5,400	208,224.00	0.06
337	000030	富奥股份	39,900	204,687.00	0.06
338	000503	国新健康	18,600	204,228.00	0.06
339	600864	哈投股份	25,300	185,955.00	0.05
340	300166	东方国信	19,700	185,180.00	0.05
341	300379	东方通	12,000	181,080.00	0.05
342	002434	万里扬	29,100	180,420.00	0.05
343	301078	孩子王	15,800	179,804.00	0.05
344	300303	聚飞光电	26,300	179,366.00	0.05
345	002099	海翔药业	34,100	175,956.00	0.05
346	000690	宝新能源	38,100	170,688.00	0.05
347	002270	华明装备	9,600	162,144.00	0.04
348	300393	中来股份	25,400	158,750.00	0.04
349	002612	朗姿股份	9,700	158,692.00	0.04
350	300869	康泰医学	11,200	156,128.00	0.04
351	000597	东北制药	29,200	153,884.00	0.04
352	300068	南都电源	9,500	153,330.00	0.04
353	688262	国芯科技	5,534	153,291.80	0.04
354	002315	焦点科技	3,500	145,880.00	0.04
355	300244	迪安诊断	12,800	145,280.00	0.04
356	002127	南极电商	33,000	145,200.00	0.04
357	300085	银之杰	3,700	141,525.00	0.04
358	688392	骄成超声	3,370	137,496.00	0.04
359	300459	汤姆猫	22,400	128,576.00	0.04
360	688327	云从科技	10,260	124,146.00	0.03
361	600645	中源协和	6,400	123,520.00	0.03
362	002176	江特电机	16,500	122,265.00	0.03
363	002378	章源钨业	18,500	119,695.00	0.03
364	000550	江铃汽车	5,100	119,595.00	0.03
365	300741	华宝股份	6,500	113,035.00	0.03
366	688062	迈威生物	5,500	111,100.00	0.03
367	300458	全志科技	2,700	104,652.00	0.03
368	605111	新洁能	3,000	101,730.00	0.03

369	688177	百奥泰	5,200	100,776.00	0.03
370	688343	云天励飞	2,000	99,200.00	0.03
371	600509	天富能源	15,000	97,050.00	0.03
372	600246	万通发展	13,000	96,850.00	0.03
373	300451	创业慧康	21,600	96,768.00	0.03
374	000848	承德露露	10,700	95,979.00	0.03
375	600480	凌云股份	8,500	91,885.00	0.03
376	301348	蓝箭电子	3,400	87,108.00	0.02
377	603713	密尔克卫	1,700	87,040.00	0.02
378	300672	国科微	1,300	86,775.00	0.02
379	600997	开滦股份	12,800	86,528.00	0.02
380	000089	深圳机场	12,500	86,125.00	0.02
381	600508	上海能源	6,500	85,995.00	0.02
382	301559	中集环科	5,600	85,960.00	0.02
383	601022	宁波远洋	10,700	85,921.00	0.02
384	000930	中粮科技	15,400	85,470.00	0.02
385	301090	华润材料	12,300	85,362.00	0.02
386	601678	滨化股份	22,700	85,352.00	0.02
387	002215	诺普信	7,600	85,348.00	0.02
388	300783	三只松鼠	2,300	84,801.00	0.02
389	300031	宝通科技	4,600	84,272.00	0.02
390	002243	力合科创	10,400	83,824.00	0.02
391	002214	大立科技	7,500	83,625.00	0.02
392	688147	微导纳米	3,100	83,359.00	0.02
393	688110	东芯股份	3,300	82,170.00	0.02
394	300762	上海瀚讯	3,900	82,017.00	0.02
395	300602	飞荣达	4,200	80,724.00	0.02
396	300327	中颖电子	3,200	78,304.00	0.02
397	300593	新雷能	6,800	76,160.00	0.02
398	002402	和而泰	4,200	76,062.00	0.02
399	300655	晶瑞电材	7,900	73,944.00	0.02
400	301339	通行宝	3,600	73,224.00	0.02

8.3.2 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	300750	宁德时代	800	212,800.00	0.06
2	600941	中国移动	1,400	165,424.00	0.05
3	605080	浙江自然	6,500	152,750.00	0.04
4	002634	棒杰股份	39,000	146,640.00	0.04
5	002871	伟隆股份	14,300	138,567.00	0.04

6	001202	炬申股份	9,900	137,511.00	0.04
7	600660	福耀玻璃	2,200	137,280.00	0.04
8	300866	安克创新	1,400	136,696.00	0.04
9	600887	伊利股份	4,500	135,810.00	0.04
10	002884	凌霄泵业	7,400	135,198.00	0.04
11	300888	稳健医疗	3,200	134,656.00	0.04
12	603600	永艺股份	11,300	134,357.00	0.04
13	603656	泰禾智能	7,100	134,332.00	0.04
14	600665	天地源	42,900	134,277.00	0.04
15	688231	隆达股份	9,440	134,236.80	0.04
16	600738	丽尚国潮	27,000	134,190.00	0.04
17	603173	福斯达	5,800	133,690.00	0.04
18	600356	恒丰纸业	17,500	133,525.00	0.04
19	600031	三一重工	8,100	133,488.00	0.04
20	601877	正泰电器	5,700	133,437.00	0.04
21	603079	圣达生物	9,900	133,353.00	0.04
22	301158	德石股份	9,500	133,285.00	0.04
23	603900	莱绅通灵	24,100	133,273.00	0.04
24	688093	世华科技	6,600	133,254.00	0.04
25	600419	天润乳业	14,300	133,133.00	0.04
26	601002	晋亿实业	30,600	133,110.00	0.04
27	688788	科思科技	4,200	133,056.00	0.04
28	603176	汇通集团	29,900	133,055.00	0.04
29	600496	精工钢构	44,000	132,880.00	0.04
30	600758	辽宁能源	38,600	132,784.00	0.04
31	603811	诚意药业	17,200	132,784.00	0.04
32	688379	华光新材	6,500	132,730.00	0.04
33	002278	神开股份	24,900	132,717.00	0.04
34	688291	金橙子	6,900	132,618.00	0.04
35	300774	倍杰特	15,100	132,578.00	0.04
36	688312	燕麦科技	4,300	132,440.00	0.04
37	603558	健盛集团	12,300	132,348.00	0.04
38	603676	卫信康	13,300	132,335.00	0.04
39	688193	仁度生物	3,700	132,275.00	0.04
40	688557	兰剑智能	6,900	132,273.00	0.04
41	001206	依依股份	8,000	132,240.00	0.04
42	003017	大洋生物	7,100	132,202.00	0.04
43	603538	美诺华	10,400	132,184.00	0.04
44	605337	李子园	11,700	132,093.00	0.04
45	603095	越剑智能	6,000	132,060.00	0.04
46	300931	通用电梯	20,100	132,057.00	0.04
47	603810	丰山集团	14,600	131,984.00	0.04
48	001256	炜冈科技	8,300	131,970.00	0.04

49	603201	常润股份	7,800	131,898.00	0.04
50	002671	龙泉股份	29,100	131,823.00	0.04
51	002001	新 和 成	6,000	131,820.00	0.04
52	002483	润邦股份	25,300	131,813.00	0.04
53	605259	绿田机械	8,700	131,805.00	0.04
54	600337	美克家居	71,200	131,720.00	0.04
55	300987	川网传媒	9,300	131,688.00	0.04
56	603115	海星股份	10,200	131,682.00	0.04
57	601177	杭齿前进	15,900	131,652.00	0.04
58	603385	惠达卫浴	20,700	131,652.00	0.04
59	601116	三江购物	12,100	131,648.00	0.04
60	003033	征和工业	4,900	131,565.00	0.04
61	000551	创元科技	11,000	131,560.00	0.04
62	300789	唐源电气	8,800	131,472.00	0.04
63	600261	阳光照明	40,200	131,454.00	0.04
64	603111	康尼机电	21,800	131,454.00	0.04
65	603789	星光农机	17,000	131,410.00	0.04
66	001380	华纬科技	6,000	131,400.00	0.04
67	300433	蓝思科技	6,000	131,400.00	0.04
68	688314	康拓医疗	4,562	131,385.60	0.04
69	002938	鹏鼎控股	3,600	131,328.00	0.04
70	001209	洪兴股份	7,700	131,285.00	0.04
71	301332	德尔玛	13,100	131,262.00	0.04
72	300813	泰林生物	7,600	131,252.00	0.04
73	002105	信隆健康	26,300	131,237.00	0.04
74	603088	宁波精达	14,500	131,225.00	0.04
75	688330	宏力达	5,000	131,200.00	0.04
76	002128	电投能源	6,700	131,186.00	0.04
77	300132	青松股份	26,600	131,138.00	0.04
78	300986	志特新材	10,800	131,112.00	0.04
79	600731	湖南海利	23,000	131,100.00	0.04
80	603628	清源股份	10,500	131,040.00	0.04
81	001230	劲旅环境	7,900	130,982.00	0.04
82	603926	铁流股份	14,800	130,980.00	0.04
83	001268	联合精密	7,500	130,950.00	0.04
84	603158	腾龙股份	16,200	130,896.00	0.04
85	002028	思源电气	1,800	130,860.00	0.04
86	300804	广康生化	5,800	130,848.00	0.04
87	688081	兴图新科	8,311	130,815.14	0.04
88	002980	华盛昌	5,100	130,815.00	0.04
89	600563	法拉电子	1,100	130,812.00	0.04
90	600295	鄂尔多斯	13,400	130,784.00	0.04
91	688056	莱伯泰科	4,482	130,695.12	0.04

92	688616	西力科技	12,578	130,685.42	0.04
93	000026	飞亚达	12,600	130,662.00	0.04
94	300018	中元股份	19,300	130,661.00	0.04
95	300523	辰安科技	6,600	130,614.00	0.04
96	301107	瑜欣电子	5,100	130,611.00	0.04
97	688070	纵横股份	3,700	130,610.00	0.04
98	002825	纳尔股份	16,700	130,594.00	0.04
99	301192	泰祥股份	7,500	130,575.00	0.04
100	003018	金富科技	14,100	130,566.00	0.04
101	002912	中新赛克	5,100	130,509.00	0.04
102	001316	润贝航科	4,500	130,500.00	0.04
103	300771	智莱科技	12,400	130,448.00	0.04
104	000537	中绿电	14,300	130,416.00	0.04
105	301503	智迪科技	3,800	130,416.00	0.04
106	300800	力合科技	12,500	130,375.00	0.04
107	688328	深科达	8,700	130,326.00	0.04
108	603586	金麒麟	9,000	130,230.00	0.04
109	300016	北陆药业	21,000	130,200.00	0.04
110	301307	美利信	6,400	130,112.00	0.04
111	300326	凯利泰	20,000	130,000.00	0.04
112	301022	海泰科	6,400	129,920.00	0.04
113	301258	富士莱	5,500	129,910.00	0.04
114	300988	津荣天宇	7,200	129,888.00	0.04
115	301125	腾亚精工	11,700	129,870.00	0.04
116	300515	三德科技	10,900	129,819.00	0.04
117	688509	正元地信	32,700	129,819.00	0.04
118	603618	杭电股份	23,900	129,777.00	0.04
119	002600	领益智造	16,200	129,600.00	0.04
120	301042	安联锐视	3,600	129,564.00	0.04
121	301028	东亚机械	12,000	129,480.00	0.04
122	688265	南模生物	5,600	129,472.00	0.04
123	300371	汇中股份	13,500	129,465.00	0.04
124	300743	天地数码	8,500	129,455.00	0.04
125	603577	汇金通	16,200	129,438.00	0.04
126	300207	欣旺达	5,800	129,398.00	0.04
127	300845	捷安高科	10,100	129,381.00	0.04
128	002961	瑞达期货	9,000	129,330.00	0.04
129	688659	元琛科技	19,155	129,296.25	0.04
130	002517	恺英网络	9,500	129,295.00	0.04
131	300645	正元智慧	8,800	129,272.00	0.04
132	002547	春兴精工	31,600	129,244.00	0.04
133	300950	德固特	8,000	129,200.00	0.04
134	688772	珠海冠宇	8,034	129,186.72	0.04

135	688683	莱尔科技	6,500	129,090.00	0.04
136	688273	麦澜德	5,518	128,955.66	0.04
137	688125	安达智能	3,300	128,931.00	0.04
138	688681	科汇股份	11,968	128,895.36	0.04
139	002845	同兴达	8,500	128,860.00	0.04
140	688533	上声电子	3,700	128,834.00	0.04
141	300710	万隆光电	7,200	128,592.00	0.04
142	688013	天臣医疗	7,300	128,553.00	0.04
143	002423	中粮资本	9,600	128,544.00	0.04
144	300564	筑博设计	10,400	128,544.00	0.04
145	301112	信邦智能	5,500	128,535.00	0.04
146	300292	吴通控股	26,500	128,525.00	0.04
147	301099	雅创电子	3,100	128,495.00	0.04
148	688080	映翰通	3,900	128,388.00	0.04
149	300907	康平科技	6,100	128,344.00	0.04
150	688511	天微电子	8,241	128,312.37	0.04
151	688466	金科环境	9,468	128,291.40	0.04
152	300870	欧陆通	1,200	128,136.00	0.04
153	002802	洪汇新材	10,800	127,980.00	0.04
154	001207	联科科技	6,600	127,974.00	0.04
155	601555	东吴证券	16,400	127,920.00	0.04
156	300571	平治信息	5,100	127,908.00	0.04
157	603680	今创集团	15,400	127,820.00	0.04
158	688225	亚信安全	7,000	127,470.00	0.03
159	600183	生益科技	5,300	127,465.00	0.03
160	603933	睿能科技	8,200	127,428.00	0.03
161	603258	电魂网络	6,400	127,296.00	0.03
162	301379	天山电子	6,300	127,260.00	0.03
163	300578	会畅通讯	6,600	127,050.00	0.03
164	688296	和达科技	11,300	126,786.00	0.03
165	688233	神工股份	5,400	126,630.00	0.03
166	688015	交控科技	6,378	126,475.74	0.03
167	688071	华依科技	4,656	125,479.20	0.03
168	000586	汇源通信	13,200	125,400.00	0.03
169	688307	中润光学	5,200	124,800.00	0.03
170	603386	骏亚科技	11,200	124,544.00	0.03
171	605499	东鹏饮料	500	124,260.00	0.03
172	688588	凌志软件	9,000	124,200.00	0.03
173	688122	西部超导	2,900	124,178.00	0.03
174	688082	盛美上海	1,235	123,500.00	0.03
175	688578	艾力斯	2,032	121,716.80	0.03
176	688228	开普云	2,700	120,312.00	0.03
177	601616	广电电气	27,300	119,847.00	0.03

178	002371	北方华创	300	117,300.00	0.03
179	301618	长联科技	1,200	101,280.00	0.03

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	688127	蓝特光学	15,692,346.50	3.54
2	300113	顺网科技	15,498,199.00	3.49
3	002123	梦网科技	15,380,071.00	3.47
4	600718	东软集团	14,924,587.00	3.37
5	002928	华夏航空	14,817,335.02	3.34
6	603368	柳药集团	14,211,940.60	3.20
7	603583	捷昌驱动	13,393,613.93	3.02
8	000415	渤海租赁	12,967,217.00	2.92
9	600577	精达股份	12,615,148.48	2.84
10	688798	艾为电子	12,565,541.68	2.83
11	002745	木林森	12,400,355.22	2.80
12	002837	英维克	12,162,706.50	2.74
13	002068	黑猫股份	12,135,091.00	2.74
14	601137	博威合金	12,079,044.00	2.72
15	300687	赛意信息	12,066,878.00	2.72
16	300035	中科电气	12,044,184.00	2.72
17	600556	天下秀	11,955,763.00	2.70
18	000923	河钢资源	11,953,697.65	2.70
19	688596	正帆科技	11,914,839.79	2.69
20	002705	新宝股份	11,648,903.00	2.63
21	002212	天融信	11,622,606.00	2.62
22	600480	凌云股份	11,581,355.20	2.61
23	601222	林洋能源	11,386,418.00	2.57
24	300679	电连技术	11,374,180.00	2.56
25	600216	浙江医药	11,350,771.00	2.56
26	300638	广和通	11,345,540.40	2.56
27	603766	隆鑫通用	11,231,622.00	2.53
28	601677	明泰铝业	11,027,389.00	2.49
29	000951	中国重汽	11,014,526.00	2.48
30	002906	华阳集团	10,996,407.00	2.48
31	002139	拓邦股份	10,975,511.00	2.48
32	002351	漫步者	10,963,476.00	2.47
33	300768	迪普科技	10,908,541.00	2.46
34	688578	艾力斯	10,662,706.57	2.40
35	688018	乐鑫科技	10,508,544.53	2.37

36	300783	三只松鼠	10,498,064.00	2.37
37	600273	嘉化能源	10,495,104.00	2.37
38	000690	宝新能源	10,481,179.00	2.36
39	300170	汉得信息	10,478,282.00	2.36
40	688007	光峰科技	10,445,159.46	2.36
41	688278	特宝生物	10,372,888.59	2.34
42	600552	凯盛科技	10,363,150.65	2.34
43	301219	腾远钴业	10,160,336.52	2.29
44	002859	洁美科技	10,120,639.00	2.28
45	600158	中体产业	10,087,776.80	2.27
46	002635	安洁科技	10,078,782.00	2.27
47	000035	中国天楹	10,035,987.94	2.26
48	002226	江南化工	9,997,565.60	2.25
49	600502	安徽建工	9,930,256.00	2.24
50	603236	移远通信	9,895,764.20	2.23
51	002245	蔚蓝锂芯	9,817,265.00	2.21
52	002274	华昌化工	9,754,926.00	2.20
53	002891	中宠股份	9,725,326.00	2.19
54	300451	创业慧康	9,665,501.16	2.18
55	600409	三友化工	9,663,001.04	2.18
56	000928	中钢国际	9,640,014.00	2.17
57	300627	华测导航	9,626,566.00	2.17
58	601333	广深铁路	9,582,160.00	2.16
59	002145	中核钛白	9,491,596.00	2.14
60	600312	平高电气	9,469,353.54	2.14
61	688372	伟测科技	9,428,726.16	2.13
62	002291	遥望科技	9,347,781.00	2.11
63	600320	振华重工	9,284,535.00	2.09
64	002402	和而泰	9,278,250.00	2.09
65	002215	诺普信	9,142,955.00	2.06
66	601101	昊华能源	9,085,875.00	2.05
67	300226	上海钢联	9,074,075.00	2.05
68	600623	华谊集团	9,064,730.00	2.04
69	688208	道通科技	9,056,957.17	2.04
70	300369	绿盟科技	8,998,672.22	2.03
71	600266	城建发展	8,960,953.40	2.02
72	300476	胜宏科技	8,958,768.80	2.02
73	301050	雷电微力	8,955,066.40	2.02
74	603995	甬金股份	8,895,823.00	2.01
75	603588	高能环境	8,871,279.68	2.00

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	300113	顺网科技	16,122,814.00	3.64
2	600577	精达股份	15,231,786.60	3.43
3	603766	隆鑫通用	15,227,560.27	3.43
4	600480	凌云股份	15,226,241.80	3.43
5	688127	蓝特光学	14,998,407.21	3.38
6	601137	博威合金	14,873,114.00	3.35
7	300638	广和通	14,832,549.36	3.34
8	603583	捷昌驱动	14,790,147.91	3.34
9	600718	东软集团	14,318,606.00	3.23
10	000923	河钢资源	14,161,012.00	3.19
11	002928	华夏航空	14,036,230.72	3.17
12	002123	梦网科技	13,903,838.00	3.14
13	002745	木林森	13,548,055.00	3.06
14	688018	乐鑫科技	13,485,706.78	3.04
15	603368	柳药集团	13,325,798.55	3.01
16	300687	赛意信息	13,055,865.00	2.94
17	600312	平高电气	13,019,493.91	2.94
18	603236	移远通信	12,920,626.40	2.91
19	002837	英维克	12,896,824.35	2.91
20	002402	和而泰	12,845,191.00	2.90
21	300679	电连技术	12,817,701.56	2.89
22	300226	上海钢联	12,817,505.00	2.89
23	688798	艾为电子	12,797,556.74	2.89
24	000928	中钢国际	12,763,594.23	2.88
25	688578	艾力斯	12,729,047.14	2.87
26	601333	广深铁路	12,682,861.00	2.86
27	601222	林洋能源	12,682,000.35	2.86
28	000415	渤海租赁	12,557,867.00	2.83
29	000951	中国重汽	12,416,196.00	2.80
30	002068	黑猫股份	12,236,888.98	2.76
31	601918	新集能源	12,117,147.00	2.73
32	002351	漫步者	11,692,220.00	2.64
33	300170	汉得信息	11,634,607.18	2.62
34	601677	明泰铝业	11,492,145.01	2.59
35	300783	三只松鼠	11,443,121.71	2.58
36	600556	天下秀	11,411,670.00	2.57
37	688596	正帆科技	11,329,124.47	2.55
38	300476	胜宏科技	11,251,631.00	2.54
39	688278	特宝生物	11,249,739.95	2.54
40	600502	安徽建工	11,236,323.00	2.53
41	002705	新宝股份	11,235,697.00	2.53

42	600158	中体产业	11,104,249.11	2.50
43	000426	兴业银锡	10,906,085.00	2.46
44	300303	聚飞光电	10,873,574.00	2.45
45	301219	腾远钴业	10,863,036.80	2.45
46	300319	麦捷科技	10,623,225.50	2.40
47	600409	三友化工	10,518,327.00	2.37
48	002274	华昌化工	10,502,601.00	2.37
49	002245	蔚蓝锂芯	10,449,886.00	2.36
50	002891	中宠股份	10,391,196.00	2.34
51	000035	中国天楹	10,387,584.96	2.34
52	600623	华谊集团	10,379,107.00	2.34
53	600125	铁龙物流	10,306,338.00	2.32
54	688208	道通科技	10,220,591.92	2.30
55	603328	依顿电子	10,162,779.45	2.29
56	301301	川宁生物	10,083,927.00	2.27
57	300035	中科电气	10,030,127.00	2.26
58	002635	安洁科技	10,024,026.00	2.26
59	603920	世运电路	10,015,950.16	2.26
60	000690	宝新能源	9,945,470.00	2.24
61	002612	朗姿股份	9,811,340.35	2.21
62	301078	孩子王	9,792,213.00	2.21
63	000543	皖能电力	9,719,780.00	2.19
64	002906	华阳集团	9,713,905.00	2.19
65	002212	天融信	9,685,379.00	2.18
66	002467	二六三	9,649,801.00	2.18
67	600216	浙江医药	9,638,960.00	2.17
68	688007	光峰科技	9,622,116.75	2.17
69	002859	洁美科技	9,616,781.00	2.17
70	002174	游族网络	9,557,199.45	2.16
71	002215	诺普信	9,485,313.00	2.14
72	600586	金晶科技	9,410,635.19	2.12
73	603439	贵州三力	9,350,592.00	2.11
74	600273	嘉化能源	9,342,601.00	2.11
75	002139	拓邦股份	9,324,750.00	2.10
76	605376	博迁新材	9,258,230.00	2.09
77	000727	冠捷科技	9,220,011.00	2.08
78	600531	豫光金铅	9,183,714.00	2.07
79	002993	奥海科技	9,174,791.20	2.07
80	600986	浙文互联	9,114,817.00	2.06
81	002283	天润工业	9,030,802.00	2.04
82	300857	协创数据	9,008,922.00	2.03
83	300768	迪普科技	9,007,305.68	2.03
84	002416	爱施德	8,989,161.00	2.03

85	601101	昊华能源	8,986,016.20	2.03
86	600575	淮河能源	8,955,048.00	2.02
87	603995	甬金股份	8,946,033.00	2.02
88	600552	凯盛科技	8,925,788.00	2.01
89	300409	道氏技术	8,883,898.00	2.00
90	600266	城建发展	8,871,222.12	2.00

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

买入股票成本（成交）总额	4,298,132,957.69
卖出股票收入（成交）总额	4,402,683,226.97

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无余额。

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

无余额。

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

无余额。

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

无余额。

8.9 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。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

无。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

无。

8.12 投资组合报告附注

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

报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体中，陕西建工集团股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到宝鸡市陈仓区城市管理执法局、杭州市拱墅区人力资源和社会保障局、青岛市崂山区住房和城乡建设局、北京市石景山区消防救援支队、东莞市住房和城乡建设局的处罚。

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。

8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

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	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,151,154.69
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,151,154.69

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无余额。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 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。

8.12.5.2 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。

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
中信建投 中证 1000 指 数增强 A	20,436	11,705.62	27,889,902.62	11.6589%	211,326,247.68	88.3411%
中信建投 中证 1000 指 数增强 C	6,789	16,757.06	12,380,195.99	10.8824%	101,383,494.41	89.1176%
合计	27,032	13,057.85	40,270,098.61	11.4086%	312,709,742.09	88.5914%

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。

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	中信建投中证 1000 指数增强 A	142,543.50	0.0596%
	中信建投中证 1000 指数增强 C	267,879.91	0.2355%
	合计	410,423.41	0.1163%

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

§ 10 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	133,862,788.05	155,466,427.35
减：本报告期基金总赎回份额	198,678,108.65	205,209,587.23
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以 “-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	239,216,150.30	113,763,690.40

§ 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，本基金未召开基金份额持有人大会。

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

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。

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，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内为本基金提供审计服务的会计师事务所由普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）更换为安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）。报告期内本基金应支付审计机构安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用 38,000.00 元整，其已提供审计服务的连续年限为 1 年。

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

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。

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。

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	
中信建投证券	4	6,089,163,166.39	69.98%	1,817,643.47	66.66%	—
方正证券	2	2,396,468,134.88	27.54%	863,757.81	31.68%	—
信达证券	2	215,184,883.39	2.47%	45,162.24	1.66%	—

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

2、本报告期内，本基金办理证券投资委托的证券公司未发生变更。

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

（1）选择证券公司参与证券交易的标准

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

（2）选择证券公司参与证券交易的程序

基金管理人指定专人负责参与证券交易的证券公司的准入评估，并根据评估结果完成与证券公司的协议签订及交易佣金费率的确定等工作。

基金管理人建立了“证券研究报告质量评分机制”“证券综合研究服务评分体系”等，每季度组织公募投研部门完成对已合作证券公司的研究服务打分评价，评价结果是确定/调整证券公司股票交易

成交金额及佣金比例限制的参考。

4、中国证监会《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》自 2024 年 7 月 1 日起实施，本基金管理人披露的《中信建投基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度）》报告期为 2024 年 7 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日，本基金产品年度报告报告期为 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 12 月 31 日，2024 年上半年度仍遵照适用中国证监会原《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》以及本基金管理人原《中信建投基金管理有限公司公募基金交易单元管理办法》的相关规定。

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		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
中信建投证券	413,464.26	52.60%	-	-	-	-	-	-
方正证券	344,822.42	43.87%	-	-	-	-	-	-
信达证券	27,786.65	3.53%	-	-	-	-	-	-

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	规定网站、规定报刊	2024-02-28

	旗下基金相关销售业务的公告		
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 季度报告提示性公告	规定报刊	2024-04-22
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
13	中信建投基金管理有限公司旗下部分基金 2024 年第 2 季度报告提示性公告	规定报刊	2024-07-19
14	中信建投中证 1000 指数增强型证券投资基金 2024 年第 2 季度报告	规定网站	2024-07-19
15	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分基金的销售机构由北京中植基金销售有限公司变更为华源证券股份有限公司的公告	规定网站、规定报刊	2024-08-20
16	中信建投基金管理有限公司旗下部分基金 2024 年中期报告提示性公告	规定报刊	2024-08-30
17	中信建投中证 1000 指数增强型	规定网站	2024-08-30

	证券投资基金 2024 年中期报告		
18	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加国贸期货有限公司为代销机构并开通定期定额投资业务及开展费率优惠的公告	规定网站、规定报刊	2024-10-25
19	中信建投基金管理有限公司旗下部分基金 2024 年第 3 季度报告提示性公告	规定报刊	2024-10-25
20	中信建投中证 1000 指数增强型证券投资基金 2024 年第 3 季度报告	规定网站	2024-10-25
21	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分证券投资基金改聘会计师事务所的公告	规定网站、规定报刊	2024-10-26
22	中信建投基金管理有限公司关于公司及子公司办公地址变更的公告	规定网站、规定报刊	2024-12-30
23	中信建投基金管理有限公司直销中心办公地址及传真号码变更的公告	规定网站、规定报刊	2024-12-30

§ 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

本报告期内，无影响投资者决策的其他重要信息。

§ 13 备查文件目录

13.1 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。

13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

13.3 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

二〇二五年三月三十一日