

# 中信建投中证 1000 指数增强型证券投资基金

## 2023 年年度报告

2023 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

送出日期:2024 年 03 月 29 日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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2024年3月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

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

本报告期自2023年1月1日起至12月31日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	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、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
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	15
§6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	15
§7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	20
7.3 净资产变动表	21
7.4 报表附注	24
§8 投资组合报告	57
8.1 期末基金资产组合情况	57
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	57
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	59
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	78
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	79
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	80
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	80
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	80
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	80
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	80

8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	81
8.12	投资组合报告附注 .....	81
§9	基金份额持有人信息 .....	82
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	82
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	82
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 .....	83
§10	开放式基金份额变动 .....	83
§11	重大事件揭示 .....	83
11.1	基金份额持有人大会决议 .....	83
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 .....	84
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	84
11.4	基金投资策略的改变 .....	84
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	84
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 .....	84
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	84
11.8	其他重大事件 .....	86
§12	影响投资者决策的其他重要信息 .....	90
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 .....	91
12.2	影响投资者决策的其他重要信息 .....	91
§13	备查文件目录 .....	91
13.1	备查文件目录 .....	91
13.2	存放地点 .....	91
13.3	查阅方式 .....	91

## §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	467,538,321.18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	304,031,470.90份	163,506,850.28份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	<p>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。</p>
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	<p>中证1000指数收益率×95%+中证综合债指数收益</p>

	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
	联系电话	010-59100208
	电子邮箱	zhuweibj@csc.com.cn
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、19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	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	中国上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场二座普华永道中心11楼
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、19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	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
本期已实现收益	23,850,650.50	3,576,760.27	-26,883,645.59	-11,579,018.28
本期利润	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	0.1253	0.0854	-0.0606	-0.0602
本期加权平均净值利润率	12.55%	8.64%	-6.19%	-6.15%
本期基金份额净值增长率	1.13%	0.72%	-6.01%	-6.20%
3.1.2 期末数据和指标	2023年末		2022年末	
期末可供分配利润	-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	-0.0495	-0.0552	-0.0601	-0.0620
期末基金资产净值	288,975,212.21	154,476,285.47	676,399,205.56	239,977,257.09
期末基金份额净值	0.9505	0.9448	0.9399	0.9380
3.1.3 累计期末指标	2023年末		2022年末	
基金份额累计净值增长率	-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

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-2.23%	0.95%	-2.92%	0.98%	0.69%	-0.03%
过去六个月	-7.66%	0.95%	-10.20%	0.95%	2.54%	0.00%
过去一年	1.13%	0.88%	-5.70%	0.90%	6.83%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-4.95%	0.92%	-14.85%	1.02%	9.90%	-0.10%

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
过去三个月	-2.34%	0.95%	-2.92%	0.98%	0.58%	-0.03%
过去六个月	-7.84%	0.95%	-10.20%	0.95%	2.36%	0.00%
过去一年	0.72%	0.88%	-5.70%	0.90%	6.42%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-5.52%	0.92%	-14.85%	1.02%	9.33%	-0.10%

#### 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



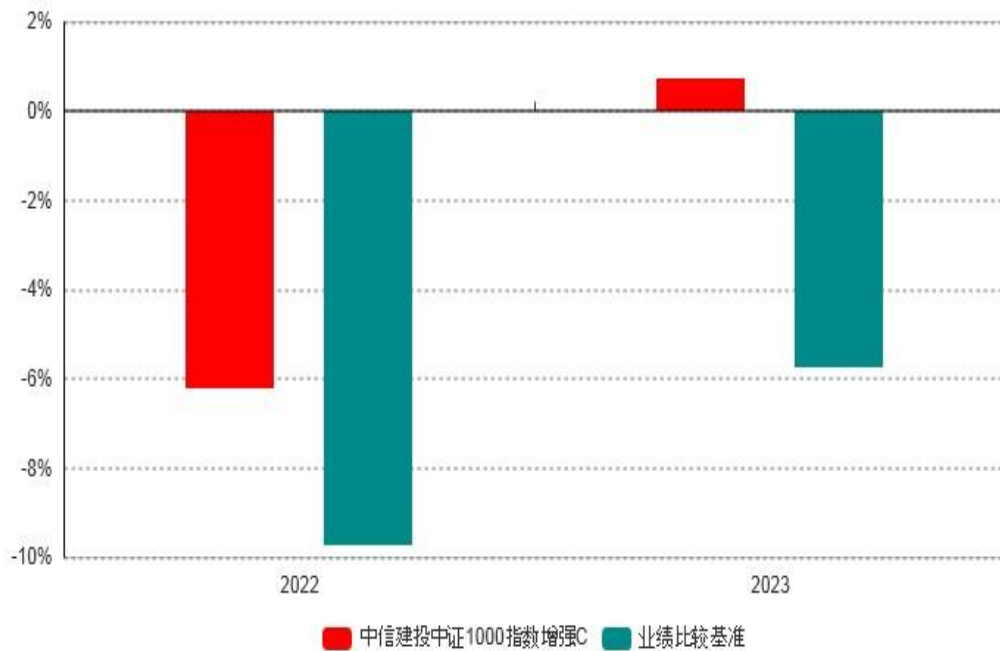
中信建投中证1000指数增强A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2022年06月28日-2023年12月31日)



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-2023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54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	-	8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

					<p>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基金经理。</p>
--	--	--	--	--	--

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

2023年，中国资产的整体表现不尽如人意。A股、港股在年初曾开启一波强劲的震荡反弹行情，但是二季度以后，两大市场的指数整体重心下移，上证指数年末仍在3000点下方徘徊。从宏观经济看，受外部环境复杂性、严峻性、不确定性上升的影响，2023年以来的复苏节奏有所扰动。由于市场筹码结构、投资者认知偏差等因素影响，权益市场四季度情绪仍较为悲观，赚钱效应较差。四季度末市场资金面明显改善。目前市场总体估值处于冰点，作为大类资产的权益资产，综合性价比不断提升。

### 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0.9505元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为1.13%，同期业绩比较基准收益率为-5.70%；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0.9448元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为0.72%，同期业绩比较基准收益率为-5.70%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2024年A股的企业盈利和股票供求关系会好于2023年，中美关系稳定，外部的流动性环境对A股有利。这些因素综合在一起来看，A股现在具备配置价值。从估值上看，权益市场风险溢价在2023年四季度更接近历史极值水平，从性价比看权益对债券的相对优势也在进一步扩大；从政策面看，我们相信防风险最好的路径是发展，且经过一年的观察评估和筹划准备，预计未来将有更多实质性稳增长新政策落地，新老措施效果也有望逐渐体现。

## 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、研究部、特定资产管理部、稽控合规部、风险管理部、运营管理部的部门负责人。本基金管理人使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在0.25%以上的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策和执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

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

#### 4.8 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

本基金本报告期内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2023年的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，中信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2023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	普华永道中天审字(2024)第22899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	(一) 我们审计的内容 我们审计了中信建投中证1000指数增强型证券投资基金(以下简称“中信建投中证1000指数增强

	<p>基金”)的财务报表,包括2023年12月31日的资产负债表,2023年度的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二) 我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了中信建投中证1000指数增强基金2023年12月31日的财务状况以及2023年度的经营成果和净资产变动情况。</p>
<p>形成审计意见的基础</p>	<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。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> <p>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指数增强基金,并履行了职业道德方面的其他责任。?</p>
<p>强调事项</p>	<p>无</p>
<p>其他事项</p>	<p>无</p>
<p>其他信息</p>	<p>无</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>中信建投中证1000指数增强基金的基金管理人中信建投基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,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,基金管理人管理层负责评估中信建投中证1000指数增强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</p>



	<p>用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算中信建投中证1000指数增强基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督中信建投中证1000指数增强基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<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>(一) 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>(二) 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>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对中信建投中证1000指数增强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</p>

	<p>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指数增强基金不能持续经营。</p> <p>(五) 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>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	叶尔甸	张碧佳
会计师事务所的地址	中国上海市黄浦区湖滨路202号领展企业广场二座普华永道中心11楼	
审计报告日期	2024-03-27	

## §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：2023年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
<b>资产：</b>			
货币资金	7.4.7.1	33,020,291.29	65,664,430.38
结算备付金		4,392,476.96	30,574,141.46
存出保证金		-	-
交易性金融资产	7.4.7.2	404,611,683.50	823,166,910.33
其中：股票投资		404,065,217.86	822,699,182.13
基金投资		-	-

债券投资		546,465.64	467,728.20
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		2,775,327.12	182,355.32
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		444,799,778.87	919,587,837.49
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年12月31日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		715,704.80	2,089,297.73
应付管理人报酬		372,495.64	814,667.96
应付托管费		37,249.55	81,466.84
应付销售服务费		52,780.28	85,923.14
应付投资顾问费		-	-
应交税费		3.63	7.51
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.5	170,047.29	140,011.66
负债合计		1,348,281.19	3,211,374.84

<b>净资产：</b>			
实收基金	7.4.7.6	467,538,321.18	975,491,986.58
未分配利润	7.4.7.7	-24,086,823.50	-59,115,523.93
净资产合计		443,451,497.68	916,376,462.65
负债和净资产总计		444,799,778.87	919,587,837.49

注：报告截止日2023年12月31日，基金份额总额467,538,321.18份，其中A类基金份额净值0.9505元，基金份额304,031,470.90份；C类基金份额净值0.9448元，基金份额163,506,850.28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：2023年01月01日至2023年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年01月01日至2 023年12月31日	上年度可比期间 2022年06月28日(基 金合同生效日)至2 022年12月31日
<b>一、营业总收入</b>		63,533,569.86	-64,911,792.72
1.利息收入		242,134.04	1,252,504.81
其中：存款利息收入	7.4.7.8	242,134.04	1,252,504.81
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）		33,170,526.31	-32,824,105.60
其中：股票投资收益	7.4.7.9	27,753,391.00	-34,269,273.16
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.10	913,722.77	88,088.69
资产支持证券投资		-	-

收益			
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.11	338,965.65	-
股利收益	7.4.7.12	4,164,446.89	1,357,078.87
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.13	29,789,416.07	-33,842,435.07
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.14	331,493.44	502,243.14
<b>减：二、营业总支出</b>		6,316,743.02	7,393,306.22
1.管理人报酬	7.4.10.2.1	5,065,325.28	5,966,601.22
2.托管费	7.4.10.2.2	506,532.53	596,660.22
3.销售服务费	7.4.10.2.3	561,991.11	684,360.62
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	7.4.7.15	-	-
7.税金及附加		1,036.19	0.88
8.其他费用	7.4.7.16	181,857.91	145,683.28
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		57,216,826.84	-72,305,098.94
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		57,216,826.84	-72,305,098.94
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-	-
<b>六、综合收益总额</b>		57,216,826.84	-72,305,098.94

### 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：2023年01月01日至2023年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 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）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-
四、本期期末净资产	467,538,321.18	-24,086,823.50	443,451,497.68
项目	上年度可比期间		

	2022年06月28日（基金合同生效日）至2022年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-
二、本期期初净资产	1,294,152,423.35	-	1,294,152,423.35
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-318,660,436.77	-59,115,523.93	-377,775,960.70
（一）、综合收益总额	-	-72,305,098.94	-72,305,098.94
（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）	-318,660,436.77	13,189,575.01	-305,470,861.76
其中：1.基金申购款	18,781,109.80	-738,178.16	18,042,931.64
2.基金赎回款	-337,441,546.57	13,927,753.17	-323,513,793.40
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-
四、本期期末净资产	975,491,986.58	-59,115,523.93	916,376,462.65

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其他股票、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%。

本财务报表由本基金的基金管理人中信建投基金管理有限公司于2024年3月27日批准报出。

#### 7.4.2 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7.4.4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。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2023年度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2023年12月31日的财务状况以及2023年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。比较财务报表的实际编制期间为2022年6月28日（基金合同生效日）至2022年12月31日。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

###### (1) 金融资产

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

#### 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：

##### 以摊余成本计量：

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

##### 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。

#### 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。

#### 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

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。

#### 7.4.4.5 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。

#### 7.4.4.6 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。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金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。

#### 7.4.4.8 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)。

#### 7.4.4.9 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。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费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。

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一基金份额类别内的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

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

#### 7.4.4.13 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。

## 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

本基金本报告期未发生会计估计变更。

### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

## 7.4.6 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。

## 7.4.7 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
活期存款	3,778,179.64	6,495,598.72
等于：本金	3,777,561.01	6,493,235.65
加：应计利息	618.63	2,363.07
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	29,242,111.65	59,168,831.66
等于：本金	29,238,767.12	59,163,607.17
加：应计利息	3,344.53	5,224.49
减：坏账准备	-	-
合计	33,020,291.29	65,664,430.38

#### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	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   交易所市场	538,000.00	70.70	546,465.64	8,394.94



券	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
项目		上年度末 2022年12月31日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		856,636,114.17	-	822,699,182.13	-33,936,932.04
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	373,000.00	231.23	467,728.20	94,496.97
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	373,000.00	231.23	467,728.20	94,496.97
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		857,009,114.17	231.23	823,166,910.33	-33,842,435.07

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

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 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	47.29	11.66
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	170,000.00	140,000.00
合计	170,047.29	140,011.66

#### 7.4.7.6 实收基金

##### 7.4.7.6.1 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 2023年01月01日至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	719,647,842.14	719,647,842.14
本期申购	112,593,951.78	112,593,951.78
本期赎回（以“-”号填列）	-528,210,323.02	-528,210,323.02
本期末	304,031,470.90	304,031,470.90

##### 7.4.7.6.2 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 2023年01月01日至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	255,844,144.44	255,844,144.44
本期申购	175,769,433.44	175,769,433.44
本期赎回（以“-”号填列）	-268,106,727.60	-268,106,727.60

本期末	163,506,850.28	163,506,850.28
-----	----------------	----------------

#### 7.4.7.7 未分配利润

##### 7.4.7.7.1 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	-22,333,668.75	-20,914,967.83	-43,248,636.58
本期期初	-22,333,668.75	-20,914,967.83	-43,248,636.58
本期利润	23,850,650.50	21,374,019.43	45,224,669.93
本期基金份额交易产生的变动数	-8,073,587.24	-8,958,704.80	-17,032,292.04
其中：基金申购款	1,727,857.55	-3,454,226.95	-1,726,369.40
基金赎回款	-9,801,444.79	-5,504,477.85	-15,305,922.64
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-6,556,605.49	-8,499,653.20	-15,056,258.69

##### 7.4.7.7.2 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	-8,438,971.40	-7,427,915.95	-15,866,887.35
本期期初	-8,438,971.40	-7,427,915.95	-15,866,887.35
本期利润	3,576,760.27	8,415,396.64	11,992,156.91
本期基金份额交易产生的变动数	395,201.37	-5,551,035.74	-5,155,834.37
其中：基金申购款	2,847,548.91	-4,971,818.78	-2,124,269.87
基金赎回款	-2,452,347.54	-579,216.96	-3,031,564.50
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-4,467,009.76	-4,563,555.05	-9,030,564.81

#### 7.4.7.8 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2 023年12月31日	上年度可比期间 2022年06月28日（基金合同生效 日）至2022年12月31日
活期存款利息收入	50,839.51	431,985.07
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	105,053.10	246,378.28
结算备付金利息收入	86,239.99	574,141.46
其他	1.44	-
合计	242,134.04	1,252,504.81

#### 7.4.7.9 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2 023年12月31日	上年度可比期间 2022年06月28日（基金合同生效 日）至2022年12月31日
卖出股票成交总额	5,664,159,368.96	6,349,239,140.43
减：卖出股票成本总额	5,626,075,637.78	6,370,257,080.30
减：交易费用	10,330,340.18	13,251,333.29
买卖股票差价收入	27,753,391.00	-34,269,273.16

#### 7.4.7.10 债券投资收益

##### 7.4.7.10.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2 023年12月31日	上年度可比期间 2022年06月28日（基金合同生效 日）至2022年12月31日
债券投资收益——利息收入	1,115.96	289.10
债券投资收益——买卖债券 （债转股及债券到期兑付）	912,606.81	87,799.59

差价收入		
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	913,722.77	88,088.69

#### 7.4.7.10.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023 年12月31日	上年度可比期间 2022年06月28日（基金合同生效日） 至2022年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	4,245,316.74	356,972.16
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	3,331,200.00	269,100.00
减：应计利息总额	1,311.44	66.68
减：交易费用	198.49	5.89
买卖债券差价收入	912,606.81	87,799.59

#### 7.4.7.11 衍生工具收益

##### 7.4.7.11.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

##### 7.4.7.11.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2 023年12月31日	上年度可比期间 2022年06月28日（基金合同生效 日）至2022年12月31日
期货投资	338,965.65	-

### 7.4.7.12 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至 2023年12月31日	上年度可比期间 2022年06月28日(基金合同生效 日)至2022年12月31日
股票投资产生的股利收益	4,164,446.89	1,357,078.87
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	4,164,446.89	1,357,078.87

### 7.4.7.13 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年01月01日至20 23年12月31日	上年度可比期间 2022年06月28日(基金合同生效日) 至2022年12月31日
1.交易性金融资产	29,789,416.07	-33,842,435.07
——股票投资	29,875,518.10	-33,936,932.04
——债券投资	-86,102.03	94,496.97
——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	29,789,416.07	-33,842,435.07

### 7.4.7.14 其他收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2023年01月01日至2023年12月31日	2022年06月28日（基金合同生效日）至2022年12月31日
基金赎回费收入	331,493.44	502,243.14
合计	331,493.44	502,243.14

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%。

#### 7.4.7.15 信用减值损失

无。

#### 7.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年06月28日（基金合同生效日）至2022年12月31日
审计费用	50,000.00	80,000.00
信息披露费	120,000.00	60,000.00
证券出借违约金	-	-
汇划手续费	11,857.91	4,483.28
账户维护费	-	1,200.00
合计	181,857.91	145,683.28

#### 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：元达信资本管理（北京）有限公司于2023年7月更名为中信建投利信资本管理（北京）有限公司。

#### 7.4.10 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。

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年06月28日（基金合同生效日） 至2022年12月31日	
	成交金额	占当期 股票成 交总额 的比例	成交金额	占当期 股票成 交总额 的比例
中信建投 证券股份 有限公司	6,332,635,508.18	58.42%	8,933,094,027.62	65.88%

###### 7.4.10.1.2 权证交易

无。

###### 7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年06月28日（基金合同生效日） 至2022年12月31日	
	成交金额	占当期 债券成	成交金额	占当期 债券成



		交总额的 比例		交总额的 比例
中信建投 证券股份 有限公司	2,504,570.24	59.00%	263,111.82	73.71%

#### 7.4.10.1.4 债券回购交易

无。

#### 7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年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%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2022年06月28日（基金合同生效日）至2022年12月31日			
	当期佣金	占当期 佣金总 量的比 例	期末应付佣金余额	占期末应 付佣金总 额的比例
中信建投 证券股份 有限公司	3,784,115.23	65.65%	-	-

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。

### 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 2023年01月01日 至2023年12月31 日	上年度可比期间 2022年06月28日（基金合同 生效日）至2022年12月31 日
当期发生的基金应支付的管理费	5,065,325.28	5,966,601.22
其中：应支付销售机构的客户维护费	2,310,331.72	2,755,871.54
应支付基金管理人的净管理费	2,754,993.56	3,210,729.68

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 2023年01月01日 至2023年12月31 日	上年度可比期间 2022年06月28日（基金合同生 效日）至2022年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	506,532.53	596,660.22

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 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	0.00	289,822.45	289,822.4

证券股份 有限公司			5
中信银行 股份有限 公司	0.00	52,388.39	52,388.39
合计	0.00	342,210.84	342,210.84
获得销售 服务费的 各关联方 名称	上年度可比期间 2022年06月28日（基金合同生效日）至2022年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中信建投中证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	473,098.31	473,098.31
中信银行 股份有限 公司	0.00	42,990.72	42,990.72
合计	0.00	516,089.03	516,089.03

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 2023年01月01日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年06月28日（基金合同生效日） 至2022年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信银行股份有限公司	3,778,179.64	50,839.51	6,495,598.72	431,985.07
中信建投证券股份有限公司	15,077,125.78	51,202.85	30,769,421.98	85,798.17

注：本基金的银行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。

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 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：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
上年度可比期间					

2022年06月28日（基金合同生效日）至2022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：张/股）	总金额
中信建投证券股份有限公司	301308	江波龙	网下配售	8,181	455,436.27
中信建投证券股份有限公司	688203	海正生材	网下配售	5,761	96,093.48
中信建投证券股份有限公司	688381	帝奥微	网下配售	7,362	306,848.16
中信建投证券股份有限公司	001300	三柏硕	网下配售	763	8,522.71
中信建投证券股份有限公司	001338	永顺泰	网下配售	1,649	11,246.18
中信建投证券股份有限公司	603130	云中马	网下配售	480	9,465.60
中信建投证券股份有限公司	301311	昆船智能	网下配售	8,320	115,481.60
中信建投证券股份有限公司	688143	长盈通	网下配售	1,938	69,128.46
中信建投证券股份有限公司	688172	燕东微	网下配售	29,088	639,354.24

#### 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--固定净值型货币市场基金之外的基金

无。

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

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

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
113069	博23转债	2023-12-22	1-6个月（含）	新债未上市	100.00	100.00	5,040	504,000.00	504,033.14	-

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
000801	四川九州	2023-12-21	重大事项	7.70	2024-01-05	8.47	192,300	1,520,232.00	1,480,710.00	-

#### 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及结算券商中信建投证券股份有限公司、方正证券股份有限公司和信达证券股份有限公司的证券账户，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。

#### 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 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
AAA	-	-
AAA以下	546,465.64	467,728.20
未评级	-	-
合计	546,465.64	467,728.20

注：以上按长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

#### 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2023年12月31日，除附注7.4.12.3中列示的卖出回购金融资产款余额将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，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。

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注7.4.12。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2023年12月31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2023年12月31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。

#### 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。

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。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年1 2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	37,412,768.25	504,033.14	42,432.50	406,840,544.98	444,799,778.87

中信建投中证1000指数增强型证券投资基金2023年年度报告

计					
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
上年度末 2022年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	65,664,430.38	-	-	-	65,664,430.38
结算备付金	30,574,141.46	-	-	-	30,574,141.46
交易性金融资产	-	124,243.97	343,484.23	822,699,182.13	823,166,910.33
应收申购款	-	-	-	182,355.32	182,355.32
资产总计	96,238,571.84	124,243.97	343,484.23	822,881,537.45	919,587,837.49

计					
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,089,297.73	2,089,297.73
应付管理人报酬	-	-	-	814,667.96	814,667.96
应付托管费	-	-	-	81,466.84	81,466.84
应付销售服务费	-	-	-	85,923.14	85,923.14
应交税费	-	-	-	7.51	7.51
其他负债	-	-	-	140,011.66	140,011.66
负债总计	-	-	-	3,211,374.84	3,211,374.84
利率敏感度缺口	96,238,571.84	124,243.97	343,484.23	819,670,162.61	916,376,462.65

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2023年12月31日，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为0.12%（2022年12月31日：0.05%），因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响（2022年12月31日：同）。

#### 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。

#### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	404,065,217.86	91.12	822,699,182.13	89.78
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	467,728.20	0.05
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	404,611,683.50	91.24	823,166,910.33	89.83

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币元)	
		本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
	业绩比较基准上升5%	20,697,358.26	22,461,379.56
	业绩比较基准下降5%	-20,697,358.26	-22,461,379.56

#### 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 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	402,626,940.36	821,390,536.46
第二层次	1,984,743.14	385,863.40
第三层次	-	1,390,510.47
合计	404,611,683.50	823,166,910.33

###### 7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于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。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023年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	-	-	-
项目	上年度可比期间 2022年06月28日（基金合同生效日）至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	1,729,662.94	1,729,662.94

转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-339,152.47	-339,152.47
其中：计入损益的利得或损失	-	-339,152.47	-339,152.47
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,390,510.47	1,390,510.47
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	-	-366,620.79	-366,620.79

注：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（2022年度同）。

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。

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

单位：人民币元

项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
交易性金融资产-股票投资	1,390,510.47	亚式期权	预期波动率	21.27%~24.756%	负相关

#### 7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2023年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2022年12月31日：同)。

#### 7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融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。

#### 7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。



## §8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	404,065,217.86	90.84
	其中：股票	404,065,217.86	90.84
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	546,465.64	0.12
	其中：债券	546,465.64	0.12
	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	37,412,768.25	8.41
8	其他各项资产	2,775,327.12	0.62
9	合计	444,799,778.87	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	633,995.00	0.14
B	采矿业	13,901,955.00	3.13
C	制造业	250,808,822.82	56.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	7,285,531.00	1.64
E	建筑业	9,808,263.00	2.21

F	批发和零售业	8,666,507.00	1.95
G	交通运输、仓储和邮政业	9,672,376.00	2.18
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	46,329,990.16	10.45
J	金融业	6,606,351.00	1.49
K	房地产业	6,324,414.00	1.43
L	租赁和商务服务业	6,000,525.20	1.35
M	科学研究和技术服务业	3,085,701.54	0.70
N	水利、环境和公共设施管理业	1,009,130.00	0.23
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	2,194,902.00	0.49
R	文化、体育和娱乐业	9,307,093.00	2.10
S	综合	-	-
	合计	381,635,556.72	86.06

### 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	134,464.00	0.03
C	制造业	17,276,135.20	3.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	93,296.00	0.02
E	建筑业	94,806.00	0.02
F	批发和零售业	176,892.00	0.04
G	交通运输、仓储和邮政业	280,965.00	0.06
H	住宿和餐饮业	203,320.00	0.05

I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,087,776.94	0.47
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	227,637.00	0.05
M	科学研究和技术服务业	545,844.00	0.12
N	水利、环境和公共设施管理业	357,284.00	0.08
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	91,945.00	0.02
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	761,854.00	0.17
S	综合	97,442.00	0.02
	合计	22,429,661.14	5.06

### 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	300638	广和通	289,000	5,499,670.00	1.24
2	601918	新集能源	789,900	4,162,773.00	0.94
3	600312	平高电气	319,800	4,058,262.00	0.92
4	300226	上海钢联	138,900	3,957,261.00	0.89
5	000928	中钢国际	656,800	3,829,144.00	0.86
6	000543	皖能电力	595,600	3,728,456.00	0.84
7	600531	豫光金铅	614,700	3,718,935.00	0.84

8	600480	凌云股份	405,201	3,691,381.11	0.83
9	002283	天润工业	629,900	3,684,915.00	0.83
10	688033	天宜上佳	217,200	3,670,680.00	0.83
11	603920	世运电路	196,400	3,590,192.00	0.81
12	603766	隆鑫通用	681,400	3,516,024.00	0.79
13	601801	皖新传媒	504,100	3,503,495.00	0.79
14	603197	保隆科技	61,000	3,440,400.00	0.78
15	000426	兴业银锡	378,200	3,434,056.00	0.77
16	600391	航发科技	178,000	3,403,360.00	0.77
17	600572	康恩贝	667,400	3,370,370.00	0.76
18	002612	朗姿股份	174,219	3,350,231.37	0.76
19	301301	川宁生物	395,000	3,318,000.00	0.75
20	603567	珍宝岛	267,000	3,246,720.00	0.73
21	301207	华兰疫苗	114,500	3,183,100.00	0.72
22	603063	禾望电气	127,300	3,182,500.00	0.72
23	603300	华铁应急	486,700	3,114,880.00	0.70
24	300303	聚飞光电	519,700	3,081,821.00	0.69
25	002011	盾安环境	221,200	3,041,500.00	0.69
26	002402	和而泰	210,100	3,002,329.00	0.68
27	601333	广深铁路	1,146,600	2,969,694.00	0.67
28	000811	冰轮环境	213,000	2,890,410.00	0.65
29	301015	百洋医药	80,500	2,886,730.00	0.65
30	002984	森麒麟	98,600	2,844,610.00	0.64
31	300109	新开源	150,600	2,716,824.00	0.61
32	601137	博威合金	173,500	2,694,455.00	0.61
33	300687	赛意信息	122,300	2,663,694.00	0.60
34	000951	中国重汽	195,900	2,617,224.00	0.59
35	002913	奥士康	84,700	2,596,055.00	0.59
36	603008	喜临门	150,600	2,561,706.00	0.58
37	601222	林洋能源	397,800	2,541,942.00	0.57
38	603236	移远通信	46,800	2,515,500.00	0.57

39	600761	安徽合力	137,600	2,505,696.00	0.57
40	002745	木林森	281,700	2,439,522.00	0.55
41	600850	电科数字	111,200	2,418,600.00	0.55
42	603881	数据港	122,000	2,418,040.00	0.55
43	600363	联创光电	67,800	2,305,200.00	0.52
44	000923	河钢资源	135,800	2,281,440.00	0.51
45	603027	千禾味业	140,200	2,267,034.00	0.51
46	600248	陕建股份	547,300	2,200,146.00	0.50
47	600577	精达股份	528,800	2,189,232.00	0.49
48	300602	飞荣达	119,400	2,157,558.00	0.49
49	300319	麦捷科技	221,000	2,130,440.00	0.48
50	603439	贵州三力	109,700	2,071,136.00	0.47
51	300476	胜宏科技	112,100	2,068,245.00	0.47
52	688711	宏微科技	49,833	2,067,571.17	0.47
53	002130	沃尔核材	271,500	2,049,825.00	0.46
54	600158	中体产业	260,800	2,029,024.00	0.46
55	002987	京北方	108,600	2,017,788.00	0.46
56	603505	金石资源	73,100	1,984,665.00	0.45
57	688018	乐鑫科技	18,960	1,951,932.00	0.44
58	002436	兴森科技	130,800	1,926,684.00	0.43
59	300130	新国都	79,300	1,919,060.00	0.43
60	688578	艾力斯	45,852	1,910,194.32	0.43
61	002421	达实智能	590,900	1,902,698.00	0.43
62	300679	电连技术	45,600	1,892,400.00	0.43
63	600125	铁龙物流	307,100	1,857,955.00	0.42
64	300039	上海凯宝	275,500	1,832,075.00	0.41
65	600266	城建发展	376,000	1,819,840.00	0.41
66	002335	科华数据	65,100	1,801,968.00	0.41
67	600586	金晶科技	267,000	1,783,560.00	0.40
68	002276	万马股份	174,500	1,783,390.00	0.40
69	600138	中青旅	164,000	1,741,680.00	0.39

70	002891	中宠股份	64,800	1,707,480.00	0.39
71	601375	中原证券	445,200	1,705,116.00	0.38
72	600420	国药现代	173,800	1,701,502.00	0.38
73	688235	百济神州	12,200	1,696,288.00	0.38
74	300747	锐科激光	71,000	1,670,630.00	0.38
75	002085	万丰奥威	336,000	1,659,840.00	0.37
76	000821	京山轻机	101,800	1,617,602.00	0.36
77	002212	天融信	163,900	1,602,942.00	0.36
78	300166	东方国信	170,400	1,601,760.00	0.36
79	000006	深振业A	343,000	1,574,370.00	0.36
80	002488	金固股份	211,900	1,521,442.00	0.34
81	603919	金徽酒	61,600	1,516,592.00	0.34
82	002467	二六三	325,800	1,511,712.00	0.34
83	605090	九丰能源	53,400	1,491,462.00	0.34
84	000801	四川九洲	192,300	1,480,710.00	0.33
85	002815	崇达技术	153,200	1,467,656.00	0.33
86	601890	亚星锚链	146,200	1,447,380.00	0.33
87	002324	普利特	109,800	1,443,870.00	0.33
88	603936	博敏电子	137,900	1,439,676.00	0.32
89	601606	长城军工	117,100	1,426,278.00	0.32
90	600623	华谊集团	217,400	1,400,056.00	0.32
91	002351	漫步者	78,900	1,394,163.00	0.31
92	000813	德展健康	425,100	1,390,077.00	0.31
93	000921	海信家电	67,700	1,381,080.00	0.31
94	000030	富奥股份	255,200	1,362,768.00	0.31
95	002126	银轮股份	72,600	1,355,442.00	0.31
96	300525	博思软件	89,600	1,336,832.00	0.30
97	600502	安徽建工	287,100	1,335,015.00	0.30
98	002428	云南锗业	107,500	1,325,475.00	0.30
99	301050	雷电微力	22,600	1,316,676.00	0.30
100	603989	艾华集团	60,800	1,308,416.00	0.30

101	301239	普瑞眼科	15,100	1,298,600.00	0.29
102	002201	正威新材	175,900	1,271,757.00	0.29
103	603328	依顿电子	155,100	1,264,065.00	0.29
104	301078	孩子王	151,100	1,240,531.00	0.28
105	000528	柳工	180,800	1,218,592.00	0.27
106	601567	三星医疗	59,000	1,209,500.00	0.27
107	601921	浙版传媒	157,300	1,201,772.00	0.27
108	300663	科蓝软件	84,800	1,199,072.00	0.27
109	002918	蒙娜丽莎	86,100	1,165,794.00	0.26
110	603466	风语筑	80,700	1,160,466.00	0.26
111	603093	南华期货	96,600	1,159,200.00	0.26
112	600751	海航科技	440,900	1,155,158.00	0.26
113	300773	拉卡拉	71,300	1,143,652.00	0.26
114	688007	光峰科技	41,600	1,076,608.00	0.24
115	002993	奥海科技	28,000	1,066,800.00	0.24
116	600201	生物股份	97,900	1,054,383.00	0.24
117	688088	虹软科技	25,500	1,046,520.00	0.24
118	603583	捷昌驱动	51,900	1,039,557.00	0.23
119	688368	晶丰明源	9,600	1,036,224.00	0.23
120	688083	中望软件	10,360	1,031,234.40	0.23
121	601019	山东出版	109,900	1,030,862.00	0.23
122	603279	景津装备	46,500	1,028,115.00	0.23
123	002484	江海股份	64,000	1,027,840.00	0.23
124	603713	密尔克卫	19,200	1,021,632.00	0.23
125	688596	正帆科技	25,605	1,014,726.15	0.23
126	600072	中船科技	54,300	1,006,722.00	0.23
127	603297	永新光学	10,000	993,500.00	0.22
128	688356	键凯科技	9,300	989,520.00	0.22
129	688439	振华风光	11,000	980,210.00	0.22
130	002516	旷达科技	196,000	966,280.00	0.22
131	300377	赢时胜	121,500	942,840.00	0.21

132	300613	富瀚微	22,100	937,924.00	0.21
133	000650	仁和药业	141,100	935,493.00	0.21
134	000686	东北证券	131,400	932,940.00	0.21
135	601952	苏垦农发	88,400	905,216.00	0.20
136	002174	游族网络	78,800	903,048.00	0.20
137	001337	四川黄金	32,500	897,975.00	0.20
138	000902	新洋丰	78,300	891,837.00	0.20
139	600285	羚锐制药	51,900	888,009.00	0.20
140	000627	天茂集团	310,600	882,104.00	0.20
141	300348	长亮科技	85,300	879,443.00	0.20
142	603995	甬金股份	44,900	863,427.00	0.19
143	603871	嘉友国际	54,100	858,026.00	0.19
144	300618	寒锐钴业	30,300	857,187.00	0.19
145	603979	金诚信	22,600	853,376.00	0.19
146	002233	塔牌集团	119,600	846,768.00	0.19
147	600037	歌华有线	109,100	843,343.00	0.19
148	601677	明泰铝业	73,900	838,026.00	0.19
149	002979	雷赛智能	38,800	836,140.00	0.19
150	002416	爱施德	90,000	836,100.00	0.19
151	300627	华测导航	26,900	834,438.00	0.19
152	688131	皓元医药	15,908	828,170.48	0.19
153	688023	安恒信息	7,200	798,408.00	0.18
154	002091	江苏国泰	101,100	791,613.00	0.18
155	601702	华峰铝业	43,500	780,825.00	0.18
156	002434	万里扬	104,400	777,780.00	0.18
157	600986	浙文互联	141,900	774,774.00	0.17
158	002158	汉钟精机	34,400	765,744.00	0.17
159	600225	卓朗科技	201,100	764,180.00	0.17
160	000597	东北制药	142,600	762,910.00	0.17
161	301325	曼恩斯特	9,778	758,186.12	0.17
162	002390	信邦制药	166,700	740,148.00	0.17



163	600409	三友化工	133,700	734,013.00	0.17
164	600821	金开新能	118,600	725,832.00	0.16
165	688366	昊海生科	6,700	725,543.00	0.16
166	603801	志邦家居	43,200	724,464.00	0.16
167	002705	新宝股份	49,600	722,672.00	0.16
168	605168	三人行	11,295	715,651.20	0.16
169	688066	航天宏图	16,848	711,659.52	0.16
170	600446	金证股份	61,300	709,241.00	0.16
171	688322	奥比中光	18,800	706,504.00	0.16
172	600718	东软集团	75,500	698,375.00	0.16
173	300735	光弘科技	29,100	685,014.00	0.15
174	688278	特宝生物	13,000	680,550.00	0.15
175	000035	中国天楹	135,700	670,358.00	0.15
176	688232	新点软件	18,100	655,220.00	0.15
177	603229	奥翔药业	49,500	653,895.00	0.15
178	605376	博迁新材	22,800	642,960.00	0.14
179	688568	中科星图	13,000	637,780.00	0.14
180	600313	农发种业	85,100	633,995.00	0.14
181	688133	泰坦科技	13,600	630,360.00	0.14
182	603298	杭叉集团	25,000	622,000.00	0.14
183	600575	淮河能源	255,800	616,478.00	0.14
184	600639	浦东金桥	60,900	615,699.00	0.14
185	300358	楚天科技	57,300	613,110.00	0.14
186	688608	恒玄科技	3,900	601,653.00	0.14
187	688027	国盾量子	4,700	601,130.00	0.14
188	003012	东鹏控股	71,600	590,700.00	0.13
189	603105	芯能科技	51,000	590,580.00	0.13
190	600587	新华医疗	22,600	582,854.00	0.13
191	001269	欧晶科技	10,740	574,053.00	0.13
192	000065	北方国际	50,800	569,976.00	0.13
193	601028	玉龙股份	53,000	567,630.00	0.13

194	603530	神马电力	26,900	557,906.00	0.13
195	603368	柳药集团	29,400	556,248.00	0.13
196	603556	海兴电力	18,900	548,667.00	0.12
197	300768	迪普科技	36,900	545,382.00	0.12
198	002991	甘源食品	7,600	543,096.00	0.12
199	002243	力合科创	67,800	539,010.00	0.12
200	688127	蓝特光学	23,058	537,020.82	0.12
201	300143	盈康生命	49,600	527,248.00	0.12
202	603396	金辰股份	9,400	513,710.00	0.12
203	688173	希荻微	29,200	513,628.00	0.12
204	600110	诺德股份	90,900	512,676.00	0.12
205	600017	日照港	184,200	506,550.00	0.11
206	600645	中源协和	24,800	502,696.00	0.11
207	300113	顺网科技	35,900	502,600.00	0.11
208	688106	金宏气体	20,800	501,072.00	0.11
209	002254	泰和新材	33,100	495,176.00	0.11
210	688798	艾为电子	7,116	491,217.48	0.11
211	300726	宏达电子	16,200	489,078.00	0.11
212	603100	川仪股份	17,200	476,784.00	0.11
213	300428	立中集团	22,500	475,200.00	0.11
214	603678	火炬电子	17,700	468,519.00	0.11
215	603876	鼎胜新材	37,300	467,369.00	0.11
216	300002	神州泰岳	52,800	467,280.00	0.11
217	601163	三角轮胎	32,100	462,561.00	0.10
218	688499	利元亨	12,146	462,519.68	0.10
219	688686	奥普特	4,100	459,200.00	0.10
220	002706	良信股份	52,000	459,160.00	0.10
221	002645	华宏科技	40,600	458,780.00	0.10
221	002051	中工国际	56,500	458,780.00	0.10
223	600320	振华重工	137,700	457,164.00	0.10
224	002453	华软科技	40,300	455,390.00	0.10

225	688508	芯朋微	9,200	452,732.00	0.10
226	600993	马应龙	18,700	452,166.00	0.10
227	000517	荣安地产	183,700	450,065.00	0.10
228	301219	腾远钴业	11,400	448,818.00	0.10
229	300856	科思股份	7,200	448,056.00	0.10
230	300036	超图软件	21,400	447,260.00	0.10
231	002171	楚江新材	59,600	445,808.00	0.10
232	301200	大族数控	11,800	445,686.00	0.10
233	002096	易普力	42,987	445,345.32	0.10
234	300666	江丰电子	7,600	445,208.00	0.10
235	603699	纽威股份	32,100	444,906.00	0.10
236	300634	彩讯股份	21,700	444,199.00	0.10
237	000990	诚志股份	54,100	444,161.00	0.10
238	002832	比音勒芬	14,000	443,800.00	0.10
239	688202	美迪西	6,487	443,581.06	0.10
240	600996	贵广网络	49,500	443,520.00	0.10
241	000791	甘肃能源	79,600	443,372.00	0.10
242	002318	久立特材	22,300	443,324.00	0.10
243	600688	上海石化	155,000	443,300.00	0.10
244	002204	大连重工	96,900	442,833.00	0.10
245	300457	赢合科技	24,000	442,560.00	0.10
246	002274	华昌化工	58,600	442,430.00	0.10
247	002498	汉缆股份	110,600	442,400.00	0.10
248	600195	中牧股份	37,300	442,378.00	0.10
249	600206	有研新材	35,700	442,323.00	0.10
250	000969	安泰科技	49,200	442,308.00	0.10
251	600169	太原重工	187,300	442,028.00	0.10
252	601860	紫金银行	174,700	441,991.00	0.10
253	002237	恒邦股份	41,000	441,980.00	0.10
254	002777	久远银海	17,600	441,936.00	0.10
255	603306	华懋科技	16,300	441,893.00	0.10

256	002332	仙琚制药	34,600	441,842.00	0.10
257	600510	黑牡丹	78,200	441,830.00	0.10
258	002649	博彦科技	36,000	441,720.00	0.10
259	600578	京能电力	149,200	441,632.00	0.10
260	300910	瑞丰新材	9,600	441,024.00	0.10
261	002249	大洋电机	88,700	440,839.00	0.10
262	002320	海峡股份	75,600	440,748.00	0.10
263	300702	天宇股份	20,300	440,713.00	0.10
264	601718	际华集团	155,000	440,200.00	0.10
265	600217	中再资环	100,500	440,190.00	0.10
266	603323	苏农银行	105,800	440,128.00	0.10
267	300725	药石科技	11,200	439,824.00	0.10
268	301291	明阳电气	15,500	439,580.00	0.10
269	603690	至纯科技	17,100	439,470.00	0.10
270	300653	正海生物	15,100	438,202.00	0.10
271	600556	天下秀	73,800	436,158.00	0.10
272	688268	华特气体	6,468	435,813.84	0.10
273	002928	华夏航空	60,700	433,398.00	0.10
274	300685	艾德生物	19,700	433,006.00	0.10
275	000061	农产品	66,200	428,314.00	0.10
276	002961	瑞达期货	28,700	427,630.00	0.10
277	002851	麦格米特	17,300	425,580.00	0.10
278	600389	江山股份	24,400	424,560.00	0.10
279	001322	箭牌家居	35,500	421,030.00	0.09
280	688262	国芯科技	14,236	417,684.24	0.09
281	603171	税友股份	11,700	413,946.00	0.09
282	603187	海容冷链	27,300	413,868.00	0.09
283	002544	普天科技	20,300	412,496.00	0.09
284	688575	亚辉龙	17,900	409,373.00	0.09
285	000090	天健集团	88,800	408,480.00	0.09
286	600675	中华企业	128,800	405,720.00	0.09

287	600717	天津港	98,600	405,246.00	0.09
288	002396	星网锐捷	22,200	401,154.00	0.09
289	603599	广信股份	27,100	392,950.00	0.09
290	601208	东材科技	31,600	391,208.00	0.09
291	688696	极米科技	3,461	391,023.78	0.09
292	002215	诺普信	45,700	377,482.00	0.09
293	001338	永顺泰	30,900	372,654.00	0.08
294	688389	普门科技	16,508	371,595.08	0.08
295	605222	起帆电缆	19,200	370,176.00	0.08
296	300777	中简科技	12,400	369,892.00	0.08
297	002746	仙坛股份	52,500	369,600.00	0.08
298	300755	华致酒行	20,200	369,458.00	0.08
299	002219	新里程	121,800	369,054.00	0.08
300	600933	爱柯迪	16,500	362,010.00	0.08
301	002258	利尔化学	30,100	360,297.00	0.08
302	301080	百普赛斯	6,100	359,534.00	0.08
303	002541	鸿路钢构	16,500	358,545.00	0.08
304	688339	亿华通	7,742	354,119.08	0.08
305	600098	广州发展	65,900	353,883.00	0.08
306	301087	可孚医疗	9,300	352,470.00	0.08
307	000913	钱江摩托	27,500	342,925.00	0.08
308	601126	四方股份	24,200	342,672.00	0.08
309	603588	高能环境	51,800	338,772.00	0.08
310	603718	海利生物	31,600	338,436.00	0.08
311	688739	成大生物	10,400	338,104.00	0.08
312	301180	万祥科技	18,600	336,474.00	0.08
313	600120	浙江东方	93,200	334,588.00	0.08
314	600835	上海机电	28,000	332,360.00	0.07
315	603032	德新科技	16,240	329,672.00	0.07
316	300497	富祥药业	35,200	329,472.00	0.07
317	688239	航宇科技	6,800	324,836.00	0.07

318	002182	宝武镁业	16,500	324,390.00	0.07
319	002859	洁美科技	13,000	324,350.00	0.07
320	000555	神州信息	28,600	322,894.00	0.07
321	601311	骆驼股份	40,200	322,002.00	0.07
322	002959	小熊电器	6,200	321,966.00	0.07
323	301047	义翘神州	3,900	321,360.00	0.07
324	300973	立高食品	6,600	320,430.00	0.07
325	600888	新疆众和	43,200	312,768.00	0.07
326	600252	中恒集团	123,300	309,483.00	0.07
327	000582	北部湾港	40,400	303,404.00	0.07
328	001696	宗申动力	45,600	302,328.00	0.07
329	688206	概伦电子	13,800	300,840.00	0.07
330	600216	浙江医药	28,000	300,440.00	0.07
331	688298	东方生物	8,400	300,384.00	0.07
332	603666	亿嘉和	9,500	298,205.00	0.07
333	600267	海正药业	31,700	296,712.00	0.07
334	300294	博雅生物	8,800	296,384.00	0.07
335	000901	航天科技	31,100	289,852.00	0.07
336	601678	滨化股份	68,600	288,806.00	0.07
337	600971	恒源煤电	25,800	287,670.00	0.06
338	300183	东软载波	18,800	283,692.00	0.06
339	601519	大智慧	38,300	282,654.00	0.06
340	300696	爱乐达	16,200	282,042.00	0.06
341	300323	华灿光电	38,300	280,356.00	0.06
342	300894	火星人	17,100	277,704.00	0.06
343	600459	贵研铂业	19,300	277,148.00	0.06
344	603730	岱美股份	18,900	273,861.00	0.06
345	600458	时代新材	29,700	273,537.00	0.06
346	603179	新泉股份	5,300	268,763.00	0.06
347	601369	陕鼓动力	33,400	266,532.00	0.06
348	600869	远东股份	60,600	266,034.00	0.06

349	600710	苏美达	37,100	263,039.00	0.06
350	603565	中谷物流	31,500	259,245.00	0.06
351	002004	华邦健康	54,900	255,834.00	0.06
352	002063	远光软件	41,200	254,616.00	0.06
353	300171	东富龙	14,100	253,659.00	0.06
354	600872	中炬高新	9,000	252,900.00	0.06
355	600649	城投控股	68,300	252,710.00	0.06
356	300027	华谊兄弟	92,900	248,972.00	0.06
357	002724	海洋王	29,300	240,846.00	0.05
358	688617	惠泰医疗	600	233,100.00	0.05
359	601811	新华文轩	9,700	132,502.00	0.03
360	002773	康弘药业	6,900	127,236.00	0.03
361	600483	福能股份	12,200	100,894.00	0.02
362	002837	英维克	3,600	98,928.00	0.02
363	002737	葵花药业	3,800	98,724.00	0.02
364	002782	可立克	6,300	88,515.00	0.02
365	605338	巴比食品	4,100	88,068.00	0.02
366	688408	中信博	134	9,614.50	0.00

### 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	600519	贵州茅台	200	345,200.00	0.08
2	000566	海南海药	62,800	283,856.00	0.06
3	002905	金逸影视	20,700	226,872.00	0.05
4	002919	名臣健康	8,800	225,632.00	0.05
5	600754	锦江酒店	6,800	203,320.00	0.05
6	603111	康尼机电	36,400	202,748.00	0.05
7	002687	乔治白	37,500	199,875.00	0.05

8	603067	振华股份	19,200	195,648.00	0.04
9	688219	会通股份	17,578	192,830.66	0.04
10	603859	能科科技	5,100	192,423.00	0.04
11	300743	天地数码	13,600	188,768.00	0.04
12	301160	翔楼新材	4,400	185,812.00	0.04
13	603611	诺力股份	9,800	185,514.00	0.04
14	688589	力合微	4,600	183,586.00	0.04
15	600558	大西洋	45,100	183,557.00	0.04
16	688049	炬芯科技	4,681	178,205.67	0.04
17	300708	聚灿光电	15,000	169,200.00	0.04
18	688208	道通科技	6,921	164,373.75	0.04
19	688484	南芯科技	4,120	164,182.00	0.04
20	603602	纵横通信	11,000	162,140.00	0.04
21	002588	史丹利	25,200	160,776.00	0.04
22	000888	峨眉山A	17,700	158,061.00	0.04
23	600262	北方股份	8,100	155,925.00	0.04
24	000997	新大陆	7,900	154,919.00	0.03
25	002296	辉煌科技	18,400	151,800.00	0.03
26	603444	吉比特	600	147,072.00	0.03
27	002449	国星光电	15,200	143,944.00	0.03
28	688626	翔宇医疗	2,638	140,579.02	0.03
29	300882	万胜智能	5,700	138,852.00	0.03
30	600826	兰生股份	15,600	137,904.00	0.03
31	301043	绿岛风	4,200	137,466.00	0.03
32	300084	海默科技	17,600	134,464.00	0.03
33	301257	普蕊斯	2,100	133,350.00	0.03
34	603112	华翔股份	10,900	132,435.00	0.03
35	002035	华帝股份	21,100	131,031.00	0.03
36	603365	水星家纺	9,100	130,858.00	0.03
37	688768	容知日新	3,548	130,601.88	0.03
38	688510	航亚科技	7,300	128,626.00	0.03



39	300102	乾照光电	17,500	128,625.00	0.03
40	600757	长江传媒	17,200	128,140.00	0.03
41	603516	淳中科技	5,700	128,079.00	0.03
42	000612	焦作万方	22,200	127,650.00	0.03
43	688489	三未信安	2,700	126,954.00	0.03
44	300566	激智科技	6,700	125,156.00	0.03
45	000887	中鼎股份	10,100	124,937.00	0.03
46	003000	劲仔食品	10,100	123,422.00	0.03
47	688571	杭华股份	16,400	122,672.00	0.03
48	605167	利柏特	12,900	122,421.00	0.03
49	603683	晶华新材	10,700	120,482.00	0.03
50	603228	景旺电子	5,300	119,568.00	0.03
51	688620	安凯微	10,112	119,523.84	0.03
52	001207	联科科技	7,000	119,350.00	0.03
53	002753	永东股份	14,400	118,800.00	0.03
54	688080	映翰通	2,900	117,682.00	0.03
55	688138	清溢光电	5,200	117,624.00	0.03
56	001229	魅视科技	3,300	117,480.00	0.03
57	300535	达威股份	6,700	117,317.00	0.03
58	600066	宇通客车	8,800	116,600.00	0.03
59	300695	兆丰股份	2,200	116,512.00	0.03
60	603283	赛腾股份	1,600	116,096.00	0.03
61	002783	凯龙股份	10,000	115,900.00	0.03
62	300441	鲍斯股份	16,800	115,752.00	0.03
63	600887	伊利股份	4,300	115,025.00	0.03
64	301323	新莱福	3,100	114,669.00	0.03
65	000338	潍柴动力	8,400	114,660.00	0.03
66	603221	爱丽家居	11,500	114,310.00	0.03
67	688689	银河微电	4,100	114,267.00	0.03
68	000920	沃顿科技	11,500	114,195.00	0.03
69	002410	广联达	6,600	113,124.00	0.03

70	300843	胜蓝股份	4,900	112,602.00	0.03
71	603076	乐惠国际	4,200	112,560.00	0.03
71	300001	特锐德	5,600	112,560.00	0.03
73	603507	振江股份	4,300	111,413.00	0.03
74	002558	巨人网络	10,000	111,400.00	0.03
75	688569	铁科轨道	4,000	110,440.00	0.02
76	002165	红宝丽	26,100	110,403.00	0.02
77	300845	捷安高科	6,100	110,227.00	0.02
78	688566	吉贝尔	3,500	109,865.00	0.02
79	002641	公元股份	21,800	109,654.00	0.02
80	300902	国安达	3,100	109,275.00	0.02
81	300752	隆利科技	6,000	109,020.00	0.02
82	603096	新经典	5,500	108,240.00	0.02
83	601956	东贝集团	18,100	108,057.00	0.02
84	300243	瑞丰高材	11,000	107,470.00	0.02
85	002393	力生制药	4,100	107,010.00	0.02
86	002922	伊戈尔	7,200	106,920.00	0.02
87	001330	博纳影业	14,800	106,560.00	0.02
88	300870	欧陆通	2,400	106,248.00	0.02
89	002083	孚日股份	21,000	105,840.00	0.02
90	688171	纬德信息	4,700	105,750.00	0.02
91	301122	采纳股份	3,100	104,966.00	0.02
92	603136	天目湖	5,700	104,709.00	0.02
93	688687	凯因科技	2,996	104,440.56	0.02
94	688669	聚石化学	5,560	104,194.40	0.02
95	002981	朝阳科技	3,000	104,160.00	0.02
96	300791	仙乐健康	3,000	103,980.00	0.02
97	002381	双箭股份	13,700	103,846.00	0.02
98	002572	索菲亚	6,500	103,675.00	0.02
99	605288	凯迪股份	2,200	103,664.00	0.02
100	301026	浩通科技	3,400	103,530.00	0.02

101	600737	中粮糖业	12,500	103,000.00	0.02
102	300514	友讯达	6,300	102,690.00	0.02
102	300251	光线传媒	12,600	102,690.00	0.02
104	300415	伊之密	5,800	102,254.00	0.02
105	300992	泰福泵业	4,700	101,426.00	0.02
106	688223	晶科能源	11,400	101,004.00	0.02
107	002841	视源股份	2,200	100,672.00	0.02
108	300389	艾比森	5,800	100,572.00	0.02
109	300145	中金环境	33,300	100,566.00	0.02
110	603050	科林电气	5,600	100,520.00	0.02
111	002827	高争民爆	6,000	100,500.00	0.02
112	301170	锡南科技	3,300	100,419.00	0.02
113	605007	五洲特纸	6,700	98,557.00	0.02
114	603039	泛微网络	2,100	98,490.00	0.02
115	688332	中科蓝讯	1,300	98,046.00	0.02
116	002970	锐明技术	3,200	97,952.00	0.02
117	603167	渤海轮渡	11,000	97,680.00	0.02
118	301096	百诚医药	1,500	97,650.00	0.02
119	002899	英派斯	5,900	97,645.00	0.02
120	002469	三维化学	16,100	97,566.00	0.02
121	300866	安克创新	1,100	97,460.00	0.02
122	000009	中国宝安	8,300	97,442.00	0.02
123	002452	长高电新	13,700	97,270.00	0.02
124	300851	交大思诺	3,100	96,627.00	0.02
125	000651	格力电器	3,000	96,510.00	0.02
126	300194	福安药业	21,900	95,922.00	0.02
127	688616	西力科技	7,000	95,480.00	0.02
128	600699	均胜电子	5,300	95,188.00	0.02
129	300908	仲景食品	2,300	94,921.00	0.02
130	301373	凌玮科技	3,200	94,880.00	0.02
131	601789	宁波建工	22,900	94,806.00	0.02

132	603319	湘油泵	5,400	94,716.00	0.02
133	301127	天源环保	8,600	94,514.00	0.02
134	688593	新相微	6,400	94,208.00	0.02
135	301503	智迪科技	2,800	94,192.00	0.02
136	001380	华纬科技	2,700	94,068.00	0.02
137	603029	天鹄股份	4,600	93,840.00	0.02
138	002998	优彩资源	11,800	93,810.00	0.02
139	603758	秦安股份	8,200	93,808.00	0.02
140	300900	广联航空	3,800	93,784.00	0.02
141	002357	富临运业	12,400	93,620.00	0.02
142	600535	天士力	5,500	93,610.00	0.02
143	603080	新疆火炬	5,600	93,296.00	0.02
144	002835	同为股份	5,200	93,288.00	0.02
145	600062	华润双鹤	5,000	93,000.00	0.02
146	605116	奥锐特	3,600	92,952.00	0.02
147	002850	科达利	1,100	92,906.00	0.02
148	300645	正元智慧	5,100	92,769.00	0.02
149	688310	迈得医疗	3,100	92,690.00	0.02
150	603788	宁波高发	6,200	92,566.00	0.02
151	603326	我乐家居	9,800	92,414.00	0.02
152	300440	运达科技	12,400	92,380.00	0.02
153	600488	津药药业	18,800	92,120.00	0.02
154	600455	博通股份	3,700	91,945.00	0.02
155	605066	天正电气	10,000	91,800.00	0.02
156	300543	朗科智能	8,400	91,728.00	0.02
157	003041	真爱美家	5,500	91,575.00	0.02
158	301277	新天地	4,400	91,564.00	0.02
159	300562	乐心医疗	8,000	91,280.00	0.02
160	603886	元祖股份	5,000	91,150.00	0.02
161	300963	中洲特材	6,900	90,528.00	0.02
162	600664	哈药股份	27,000	90,450.00	0.02

163	300550	和仁科技	6,000	89,940.00	0.02
164	300280	紫天科技	2,100	89,733.00	0.02
165	301070	开勒股份	2,000	89,720.00	0.02
166	600368	五洲交通	22,700	89,665.00	0.02
167	603233	大参林	3,600	89,640.00	0.02
168	002983	芯瑞达	2,900	89,494.00	0.02
169	600977	中国电影	7,300	89,352.00	0.02
170	002611	东方精工	18,000	89,280.00	0.02
171	688531	日联科技	882	89,152.56	0.02
172	002791	坚朗五金	2,200	89,078.00	0.02
173	301149	隆华新材	7,200	89,064.00	0.02
174	300749	顶固集创	9,600	88,992.00	0.02
175	600959	江苏有线	28,100	88,234.00	0.02
176	603897	长城科技	4,300	88,064.00	0.02
177	688588	凌志软件	7,400	88,060.00	0.02
178	605377	华旺科技	4,600	87,814.00	0.02
179	000404	长虹华意	14,900	87,761.00	0.02
180	300729	乐歌股份	4,900	87,759.00	0.02
181	688651	盛邦安全	1,862	87,625.72	0.02
182	603617	君禾股份	9,500	87,400.00	0.02
183	300622	博士眼镜	4,400	87,252.00	0.02
184	002443	金洲管道	12,700	86,995.00	0.02
185	300985	致远新能	2,300	86,733.00	0.02
186	688592	司南导航	1,666	86,465.40	0.02
187	300739	明阳电路	5,600	85,736.00	0.02
188	688581	安杰思	686	85,619.66	0.02
189	600637	东方明珠	11,300	84,976.00	0.02
190	603833	欧派家居	1,200	83,532.00	0.02
191	301456	盘古智能	2,700	83,160.00	0.02
192	688561	奇安信	2,058	82,505.22	0.02
193	688218	江苏北人	4,116	81,784.92	0.02

194	688003	天准科技	2,156	80,893.12	0.02
195	688661	和林微纳	1,764	80,826.48	0.02
196	688663	新风光	82	2,299.28	0.00

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000928	中钢国际	24,499,646.50	2.67
2	600933	爱柯迪	21,674,826.00	2.37
3	300226	上海钢联	21,431,494.20	2.34
4	688033	天宜上佳	20,589,056.90	2.25
5	601222	林洋能源	18,331,423.00	2.00
6	300856	科思股份	18,283,017.50	2.00
7	000921	海信家电	17,822,398.00	1.94
8	601137	博威合金	17,535,857.00	1.91
9	000811	冰轮环境	17,448,132.60	1.90
10	300130	新国都	17,311,568.40	1.89
11	600363	联创光电	17,110,663.41	1.87
12	603368	柳药集团	17,010,545.24	1.86
13	603197	保隆科技	16,785,107.46	1.83
14	603920	世运电路	16,346,046.00	1.78
15	002727	一心堂	15,810,254.00	1.73
16	603027	千禾味业	15,705,236.00	1.71
17	300910	瑞丰新材	15,601,118.30	1.70
18	002130	沃尔核材	15,335,045.00	1.67
19	600312	平高电气	15,263,556.21	1.67
20	002446	盛路通信	14,881,605.00	1.62

### 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	600933	爱柯迪	21,825,806.00	2.38
2	000811	冰轮环境	21,725,822.55	2.37
3	300856	科思股份	21,094,063.00	2.30
4	000928	中钢国际	21,005,588.00	2.29
5	300910	瑞丰新材	20,261,289.30	2.21
6	601137	博威合金	19,300,473.00	2.11
7	300226	上海钢联	18,826,302.68	2.05
8	603920	世运电路	18,653,170.86	2.04
9	300130	新国都	18,636,940.78	2.03
10	000913	钱江摩托	18,615,414.70	2.03
11	688033	天宜上佳	18,385,996.25	2.01
12	002697	红旗连锁	18,126,998.45	1.98
13	603876	鼎胜新材	18,036,604.40	1.97
14	000921	海信家电	17,742,249.39	1.94
15	002698	博实股份	17,636,934.00	1.92
16	603368	柳药集团	17,445,046.20	1.90
17	301039	中集车辆	17,428,067.73	1.90
18	603305	旭升集团	17,383,252.70	1.90
19	300633	开立医疗	17,215,711.00	1.88
20	688037	芯源微	17,122,081.20	1.87

#### 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	5,177,566,155.41
卖出股票收入（成交）总额	5,664,159,368.96

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	546,465.64	0.12
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	546,465.64	0.12

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113069	博23转债	5,040	504,033.14	0.11
2	118038	金宏转债	340	42,432.50	0.01

#### 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

本基金根据风险管理的原则，以套期保值为目的，在风险可控的前提下，综合考虑股指期货不同合约之间的价差关系、流动性等因素，在各股指期货合约之间进行动态配置和临近到期合约的展期操作，以提升组合收益和套期保值的效果。



### 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 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，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	2,775,327.12
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,775,327.12

### 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	26,243	11,585.24	9,697,809.57	3.1897%	294,333,661.33	96.8103%
中信建投中证1000指数增强C	15,450	10,582.97	54,262,579.93	33.1867%	109,244,270.35	66.8133%
合计	41,458	11,277.40	63,960,389.50	13.6802%	403,577,931.68	86.3198%

### 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	258,923.49	0.0852%
	中信建投中证1000	7,051.45	0.0043%

	指数增强C		
	合计	265,974.94	0.0569%

### 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	719,647,842.14	255,844,144.44
本报告期基金总申购份额	112,593,951.78	175,769,433.44
减：本报告期基金总赎回份额	528,210,323.02	268,106,727.60
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	304,031,470.90	163,506,850.28

### §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，高翔先生于2023年1月12日离任基金管理人副总经理、首席信息官，王欢女士于2023年3月31日起担任基金管理人财务负责人，张欣宇先生于2023年7月20日起担任基金管理人首席信息官；

本报告期内，基金管理人因第三届董事会任期届满，第四届董事会成员调整变动，基金管理人的董事在2023年3月的最近12个月内变更超过百分之五十。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

## 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、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

报告期内应支付普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用50,000.00元整，该审计机构自2022年6月28日（基金转型日）起为本基金提供审计服务。

## 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员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	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	

	量					
方正证券 (券商柜台)	2	2,817,318,461.64	25.99%	1,200,037.95	25.94%	-
信达证券 (券商柜台)	2	1,689,980,406.20	15.59%	728,967.05	15.76%	-
中信建投证券	4	6,332,635,508.18	58.42%	2,697,540.48	58.31%	-

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。

### 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	成交金额	占当期债	成交金额	占当期权	成交金额	占当期基

		券成交总额的比例		券回购成交总额的比例		证成交总额的比例		金成交总额的比例
方正证券（券商柜台）	956,166.56	22.52%	-	-	-	-	-	-
信达证券(券商柜台)	784,579.94	18.48%	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	2,504,570.24	59.00%	-	-	-	-	-	-

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中信建投基金管理有限公司高级管理人员变更公告	规定网站、规定报刊	2023-01-13
2	中信建投基金管理有限公司旗下部分基金2022年第4季度报告提示性公告	规定报刊	2023-01-20
3	中信建投中证1000指数增强型证券投资基金2022年第4季度报告	规定网站	2023-01-20
4	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分基金投资关联方承销证券的公告	规定网站、规定报刊	2023-01-21
5	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分基金投资关联方承销证券的公告	规定网站、规定报刊	2023-02-03
6	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加深圳众禄基金销售股份有限公司为代销机构并开通定期定额投资业务及开展费率优惠的公告	规定网站、规定报刊	2023-02-22

7	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分基金投资关联方承销证券的公告	规定网站、规定报刊	2023-02-25
8	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	2023-03-28
9	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加中信百信银行股份有限公司为代销机构并开通定期定额投资业务及开展费率优惠的公告	规定网站、规定报刊	2023-03-29
10	中信建投基金管理有限公司董事变更公告	规定网站、规定报刊	2023-03-30
11	中信建投基金管理有限公司旗下部分基金2022年年度报告提示性公告	规定报刊	2023-03-31
12	中信建投中证1000指数增强型证券投资基金2022年年度报告	规定网站	2023-03-31
13	中信建投基金管理有限公司高级管理人员变更公告	规定网站、规定报刊	2023-04-01
14	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金在中信建投证券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	2023-04-13
15	中信建投基金管理有限公司旗下部分基金2023年第1季度报告提示性公告	规定报刊	2023-04-21
16	中信建投中证1000指数增强型证券投资基金2023年第1季度报告	规定网站	2023-04-21
17	关于中信建投基金管理有限公司	规定网站、规定报刊	2023-04-25

	公司旗下部分基金在中信银行股份有限公司开通基金转换业务的公告		
18	中信建投基金管理有限公司关于提请投资者完善税收居民身份信息的公告	规定网站	2023-05-10
19	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加安信证券股份有限公司为代销机构并开通定期定额投资业务及开展费率优惠的公告	规定网站、规定报刊	2023-05-15
20	关于调整中信建投基金管理有限公司旗下部分基金在北京雪球基金销售有限公司最低申购金额、最低赎回份额及最低持有份额限制的公告	规定网站、规定报刊	2023-05-19
21	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加玄元保险代理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	2023-05-23
22	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加平安证券股份有限公司为代销机构并开通定期定额投资业务及开展费率优惠的公告	规定网站、规定报刊	2023-06-05
23	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加上海华夏财富投资管理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	2023-06-06
24	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金在中信建	规定网站、规定报刊	2023-06-16



	投证券股份有限公司开通基金转换业务的公告		
25	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加和合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	2023-07-17
26	中信建投基金管理有限公司旗下全部基金2023年第2季度报告提示性公告	规定报刊	2023-07-21
27	中信建投中证1000指数增强型证券投资基金2023年第2季度报告	规定网站	2023-07-21
28	中信建投基金管理有限公司高级管理人员变更公告	规定网站、规定报刊	2023-07-21
29	关于调整中信建投基金管理有限公司旗下部分基金在珠海盈米基金销售有限公司最低申购金额、最低赎回份额及最低持有份额限制的公告	规定网站、规定报刊	2023-07-25
30	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加东莞证券股份有限公司为代销机构并开通定期定额投资业务及开展费率优惠的公告	规定网站、规定报刊	2023-07-27
31	中信建投基金管理有限公司关于增加注册资本的公告	规定网站	2023-07-28
32	中信建投基金管理有限公司关于子公司名称及法定代表人变更的公告	规定网站	2023-07-28
33	中信建投基金管理有限公司旗下全部基金2023年中期报告提示性公告	规定报刊	2023-08-31

34	中信建投中证1000指数增强型证券投资基金2023年中期报告	规定网站	2023-08-31
35	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加奕丰基金销售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	2023-09-22
36	中信建投基金管理有限公司旗下部分基金2023年第3季度报告提示性公告	规定报刊	2023-10-25
37	中信建投中证1000指数增强型证券投资基金2023年第3季度报告	规定网站	2023-10-25
38	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	2023-11-24
39	中信建投中证1000指数增强型证券投资基金基金产品资料概要更新	规定网站	2023-11-24
40	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加上海中欧财富基金销售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	2023-12-07
41	关于调整中信建投基金管理有限公司旗下部分基金在北京新浪仓石基金销售有限公司最低申购金额、最低赎回份额及最低持有份额限制的公告	规定网站、规定报刊	2023-12-15

## §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

二〇二四年三月二十九日