

招商中证 1000 增强策略交易型开放式 指数证券投资基金 2024 年中期报告

2024 年 06 月 30 日

基金管理人：招商基金管理有限公司

基金托管人：广发证券股份有限公司

送出日期：2024 年 8 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2024 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	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 主要财务指标和基金净值表现.....	5
3.1 主要会计数据和财务指标.....	5
3.2 基金净值表现	6
§4 管理人报告.....	6
4.1 基金管理人及基金经理情况	6
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	8
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	8
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	9
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	9
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	10
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	10
4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明.....	10
§5 托管人报告.....	11
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	11
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	11
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	11
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	11
6.1 资产负债表.....	11
6.2 利润表.....	13
6.3 净资产变动表	14
6.4 报表附注	16
§7 投资组合报告	36
7.1 期末基金资产组合情况	36
7.2 期末按行业分类的股票投资组合	36
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细.....	37
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	46
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	47
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	48
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	48
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	48
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	48
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	48

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	48
7.12 投资组合报告附注.....	48
§8 基金份额持有人信息.....	50
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	50
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	50
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	50
8.4 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.....	51
§9 开放式基金份额变动.....	51
§10 重大事件揭示.....	51
10.1 基金份额持有人大会决议.....	51
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	51
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	51
10.4 基金投资策略的改变.....	51
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	51
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	52
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	52
10.8 其他重大事件.....	52
§11 备查文件目录.....	54
11.1 备查文件目录.....	54
11.2 存放地点.....	54
11.3 查阅方式.....	54

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	招商中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	招商中证 1000 增强策略 ETF
场内简称	1000ETF 增强
基金主代码	159680
交易代码	159680
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2022 年 11 月 18 日
基金管理人	招商基金管理有限公司
基金托管人	广发证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	234,438,087.00 份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2022 年 11 月 30 日

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金通过科学的投资方法与严格的投资纪律约束，力争控制本基金份额净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.35%，年化跟踪误差不超过 6.5%，同时力求实现超越标的指数的业绩表现，谋求基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采用指数增强策略，在标的指数成份券权重的基础上对行业配置及个股权重等进行主动调整，力争在控制跟踪误差的基础上获取超越标的指数的投资收益。本基金其他主要投资策略包括：股票投资策略、债券投资策略、衍生品投资策略、资产支持证券投资策略、存托凭证投资策略、参与融资及转融通证券出借业务策略。
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益及预期风险水平高于债券型基金与货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	招商基金管理有限公司	广发证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	潘西里
	联系电话	0755-83196666
	电子邮箱	cmf@cmfchina.com
客户服务电话	400-887-9555	95575
传真	0755-83196475	020-87553363-6847
注册地址	深圳市福田区深南大道	广东省广州市黄埔区中新广州

	7088 号	知识城腾飞一街 2 号 618 室
办公地址	深圳市福田区深南大道 7088 号	广州市天河区马场路 26 号广发 证券大厦 34 楼
邮政编码	518040	510627
法定代表人	王小青	林传辉

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街 17 号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2024 年 1 月 1 日 - 2024 年 6 月 30 日)
本期已实现收益	-23,195,847.78
本期利润	-27,316,558.88
加权平均基金份额本期利润	-0.1056
本期加权平均净值利润率	-11.44%
本期基金份额净值增长率	-10.35%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
期末可供分配利润	-27,438,221.59
期末可供分配基金份额利润	-0.1170
期末基金资产净值	206,999,865.41
期末基金份额净值	0.8830
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2024 年 6 月 30 日)
基金份额累计净值增长率	-11.70%

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

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

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

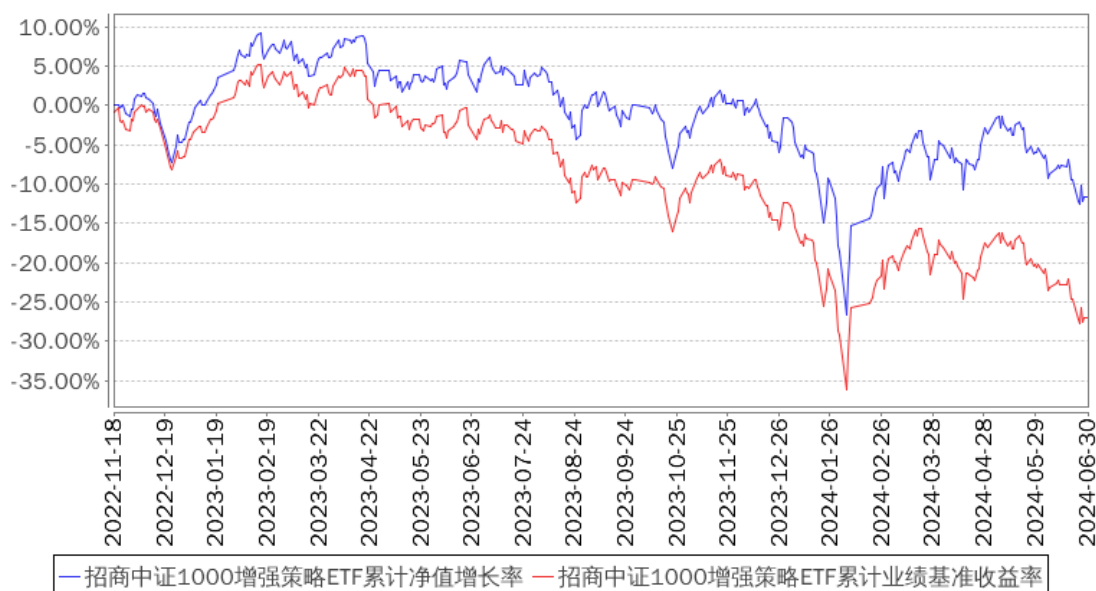
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-6.60%	1.34%	-8.58%	1.43%	1.98%	-0.09%
过去三个月	-5.19%	1.41%	-10.02%	1.49%	4.83%	-0.08%
过去六个月	-10.35%	1.91%	-16.84%	1.97%	6.49%	-0.06%
过去一年	-16.14%	1.51%	-25.84%	1.55%	9.70%	-0.04%
自基金合同生效起至今	-11.70%	1.30%	-27.08%	1.34%	15.38%	-0.04%

3.2.2 自基金合同生效/自基金转型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

招商中证1000增强策略ETF累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



§ 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

招商基金管理有限公司于 2002 年 12 月 27 日经中国证监会【2002】100 号文批准设立。目前，公司注册资本为人民币 13.1 亿元，招商银行股份有限公司持有公司全部股权的 55%，招商证券股份有限公司持有公司全部股权的 45%。

招商基金管理有限公司拥有公开募集证券投资基金管理、基金销售、全国社会保障基金境内委托管理、企业年金和职业年金基金投资管理、合格境内机构投资者、特定客户资产管理、保险资金投资管理、基本养老保险基金投资管理、公募基金投资顾问业务试点资格。

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		
王平	本基金基金经理	2022 年 11 月 18 日	-	18	男，管理学硕士，FRM。2006 年加入招商基金管理有限公司，曾任投资风险管理部助理数量分析师、风险管理部数量分析师、高级风控经理，主要负责公司投资风险管理、金融工程研究等工作，曾任招商深证 100 指数证券投资基金、上证消费 80 交易型开放式指数证券投资基金、招商上证消费 80 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、深证电子信息传媒产业(TMT)50 交易型开放式指数证券投资基金、招商深证电子信息传媒产业(TMT)50 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、招商中证大宗商品股票指数证券投资基金（LOF）、招商央视财经 50 指数证券投资基金、招商中证煤炭等权指数分级证券投资基金、招商中证银行指数分级证券投资基金、招商国证生物医药指数分级证券投资基金、招商中证白酒指数分级证券投资基金、招商稳荣定期开放灵活配置混合型证券投资基金、招商财经大数据策略股票型证券投资基金、招商盛合灵活配置混合型证券投资基金、招商中证 500 指数增强型证券投资基金、招商沪深 300 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、招商中证银行 AH 价格优选交易型开放式指数证券投资基金、招商中证银行 AH 价格优选交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金基金经理，现任量化投资部总监兼招商量化精选股票型发起式证券投资基金、招商沪深 300 指数增强型证券投资基金、招商中证 1000

					指数增强型证券投资基金、招商中证红利交易型开放式指数证券投资基金、招商中证 500 等权重指数增强型证券投资基金、招商中证光伏产业指数型证券投资基金、招商中证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金、招商中证 800 指数增强型证券投资基金、招商中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、招商中证 2000 指数增强型证券投资基金、招商成长量化选股股票型证券投资基金基金经理。
蔡振	本基金基金经理	2022 年 11 月 18 日	-	9	男，硕士。2014 年 7 月加入招商基金管理有限公司量化投资部，曾任 ETF 专员、研究员，主要从事量化投资策略的研究，曾任招商安福 1 年定期开放债券型发起式证券投资基金基金经理，现任招商安阳债券型证券投资基金、招商安盈债券型证券投资基金、招商中证 1000 指数增强型证券投资基金、招商安嘉债券型证券投资基金、招商中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金、招商安凯债券型证券投资基金、招商兴福灵活配置混合型证券投资基金、招商盛合灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

注：1、本基金首任基金经理的任职日期为本基金合同生效日，后任基金经理的任职日期以及历任基金经理的离任日期为公司相关会议作出决定的公告（生效）日期；

2、证券从业年限计算标准遵从中国证监会《证券基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》中关于证券从业人员范围的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

基金管理人声明：在本报告期内，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》等有关法律法规及其各项实施准则的规定以及本基金的基金合同等基金法律文件的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的前提下，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。基金的投资范围以及投资运作符合有关法律法规及基金合同的规定。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

基金管理人已建立较完善的研究方法和投资决策流程，确保各投资组合享有公平的投资决策机会。基金管理人建立了所有组合适用的投资对象备选库，制定明确的备选库建立、维护程序。基金管理人拥有健全的投资授权制度，明确投资决策委员会、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限划分，投资组合经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作需要经过严格的审批程序。基金管理人的相关研究成果向内部所有投资组合开放，在投资研究层面不存在各投资组合间不公平的问题。

基金管理人按照法规要求，对连续四个季度期间内、不同时间窗下（如日内、3 日内、5 日内）公司管理的不同投资组合间的同向交易的交易价差进行分析，相关投资组合经理也对分析中发现的价格差异次数占比超过正常范围的情况进行了合理性解释。报告期内，公司旗下投资组合同向交易价差分析中未发现异常情形。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

基金管理人严格控制不同投资组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易。确因投资组合的投资策略或流动性等需要而发生的同日反向交易，基金管理人要求相关投资组合经理提供决策依据，并留存记录备查，完全按照有关指数的构成比例进行投资的组合等除外。

本报告期内，本基金各项交易均严格按照相关法律法规、基金合同的有关要求执行，公司所有投资组合参与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的 5% 的交易共有 6 次，为旗下指数及量化组合因投资策略需要而发生反向交易。报告期内未发现有可能导致不公平交易和利益输送的重大异常交易行为。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

上半年中证 1000 指数下跌 16.84%，本基金期间下跌 10.35%，虽然具有一定的超额收益，但也承受了较大的损失。从市场资金偏好看，主要还是以盈利能力较强的高股息资产作为避险资产。我们在组合管理中对公司的盈利能力和整体的估值水平同时给予了一定的权重，因而超额收益中有较大部分源于上半年的市场偏好。上半年市场大小盘风格波动极为剧烈，给超额收益带来了一定的扰动，组合在市值风格上的暴露相对较小，因而总体超额收益相对较为平稳。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

报告期内，本基金份额净值增长率为-10.35%，同期业绩基准增长率为-16.84%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们认为投资者对市场的预期过于悲观，市场充斥的信息也比较多，但大部分投资者忽视了一点，所有可以预见的下行风险都不是风险，因为它们已经定价在当前资产价格里了，只有不可预见的下行风险才是真正的风险。我们认为当前的价格反映得更多是可预见的下行风险，对不可预见的上行波动则明显定价不足，因而我们依旧看好权益市场可能的反弹机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金的估值业务严格按照相关的法律法规、基金合同以及《招商基金管理有限公司基金估值委员会管理办法》进行。基金核算部负责日常的基金资产的估值业务，执行基金估值政策。另外，公司设立由投资和研究部门、风险管理部、基金核算部、法律合规部负责人和基金经理代表组成的估值委员会。公司估值委员会的相关成员均具备相应的专业胜任能力和相关工作经历。公司估值委员会主要负责制定、修订和完善基金估值政策和程序，定期评价现有估值政策和程序的适用性及对估值程序执行情况进行监督。

投资和研究部门以及基金核算部共同负责关注相关投资品种的动态，评判基金持有的投资品种是否处于不活跃的交易状态或者最近交易日后经济环境发生了重大变化或证券发行机构发生了影响证券价格的重大事件，从而确定估值日需要进行估值测算或者调整的投资品种；投资和研究部门定期审核公允价值的确认和计量；研究部提出合理的数量分析模型对需要进行估值测算或者调整的投资品种进行公允价值定价与计量并定期对估值政策和程序进行评价，以保证其持续适用；基金核算部定期审核估值政策和程序的一致性，并负责与托管行沟通估值调整事项；风险管理部负责估值委员会工作流程中的风险控制；法律合规部负责日常的基金估值调整结果的事后复核监督工作；法律合规部与基金核算部共同负责估值调整事项的信息披露工作。

基金经理代表向估值委员会提供估值参考信息，参与估值政策讨论；对需采用特别估值程序的证券，基金及时启动特别估值程序，由公司估值委员会集体讨论议定特别估值方案，咨询会计事务所的专业意见，并与托管行沟通后由基金核算部具体执行。

本基金管理人参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。截止报告期末本基金管理人已与中央国债登记结算有限责任公司、中证指数有限公司签署服务协议，由其按约定提供相关债券品种、流通受限股票的估值参考数据。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配。

4.8 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

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

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对本基金的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金托管业务管理办法》等相关法律法规的规定和基金合同、托管协议的约定勤勉履行基金托管人职责，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

本报告期内，基金管理人在本基金各重要方面的运作符合基金合同、托管协议的约定，本基金托管人未发现本基金在投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支及利润分配等方面存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本基金托管人依法对基金管理人编制和披露的本基金 2024 年中期报告中的财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：招商中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	1,473,444.85	1,847,048.60
结算备付金		1,247,720.20	1,194,675.02
存出保证金		506,006.76	698,432.09
交易性金融资产	6.4.7.2	204,388,560.46	262,949,167.05
其中：股票投资		204,388,560.46	262,949,167.05

基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	1,160,850.14
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		207,615,732.27	267,850,172.90
负债和净资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		2,346.50	1,063,462.77
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		86,956.34	110,255.33
应付托管费		17,391.29	22,051.07
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	509,172.73	307,128.96
负债合计		615,866.86	1,502,898.13
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	234,438,087.00	270,438,087.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	-27,438,221.59	-4,090,812.23
净资产合计		206,999,865.41	266,347,274.77
负债和净资产总计		207,615,732.27	267,850,172.90

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额净值 0.8830 元，基金份额总额 234,438,087.00 份。

6.2 利润表

会计主体：招商中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
一、营业总收入		-26,522,774.19	53,636,440.81
1.利息收入		40,686.10	68,416.43
其中：存款利息收入	6.4.7.9	40,686.10	68,416.43
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）		-22,460,818.42	29,690,961.23
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-24,822,464.25	27,167,322.80
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	150,592.33
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	2,361,645.83	2,373,046.10
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-4,120,711.10	23,453,661.37
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	18,069.23	423,401.78
减：二、营业总支出		793,784.69	1,067,006.69
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	595,139.90	822,651.44

其中：暂估管理人报酬		-	-
2.托管费	6.4.10.2.2	119,027.97	164,530.29
3.销售服务费		-	-
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7.税金及附加		-	0.60
8.其他费用	6.4.7.19	79,616.82	79,824.36
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-27,316,558.88	52,569,434.12
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-27,316,558.88	52,569,434.12
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-27,316,558.88	52,569,434.12

注：根据最新《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〉》中的利润表格式的要求：上年度可比期间“证券出借利息收入”项目的“本期”金额列示于本期“其他利息收入”项目的“上年度可比期间”金额中。

6.3 净资产变动表

会计主体：招商中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	270,438,087.00	-	-4,090,812.23	266,347,274.77
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	270,438,087.00	-	-4,090,812.23	266,347,274.77
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-36,000,000.00	-	-23,347,409.36	-59,347,409.36
（一）、综合收益总额	-	-	-27,316,558.88	-27,316,558.88

(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)	-36,000,000.00	-	3,969,149.52	-32,030,850.48
其中: 1.基金申购款	225,000,000.00	-	-15,045,821.43	209,954,178.57
2.基金赎回款	-261,000,000.00	-	19,014,970.95	-241,985,029.05
(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	234,438,087.00	-	-27,438,221.59	206,999,865.41
项目	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	564,438,087.00	-	-23,934,270.84	540,503,816.16
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	564,438,087.00	-	-23,934,270.84	540,503,816.16
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-279,000,000.00	-	39,034,354.61	-239,965,645.39
(一)、综合收益总额	-	-	52,569,434.12	52,569,434.12
(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)	-279,000,000.00	-	-13,535,079.51	-292,535,079.51
其中: 1.基金申购款	315,000,000.00	-	16,159,049.30	331,159,049.30
2.基金赎回款	-594,000,000.00	-	-29,694,128.81	-623,694,128.81
(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	285,438,087.00	-	15,100,083.77	300,538,170.77

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 6.1 至 6.4 财务报表由下列负责人签署：

____徐勇____ ____欧志明____ ____何剑萍____
基金管理人负责人 主管会计工作负责人 会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

招商中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)系由基金管理人招商基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《招商中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》及其他有关法律法规的规定,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]2603 号文准予公开募集注册。本基金为交易型开放式基金,存续期限为不定期。本基金首次设立募集基金份额为 1,464,438,087.00 份,经德勤华永会计师事务所(特殊普通合伙)验证,并出具了编号为德师报(验)字(22)第 00547 号验资报告。《招商中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)于 2022 年 11 月 18 日正式生效。本基金的基金管理人为招商基金管理有限公司,基金托管人为广发证券股份有限公司(以下简称“广发证券”)。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、基金合同及截至报告期末最新公告的基金招募说明书的有关规定,本基金主要投资于标的指数成份券(含存托凭证,下同)和备选成份券(含存托凭证,下同)。为更好地实现基金的投资目标,本基金可能会少量投资于国内依法发行上市的非标的指数成份券(包括主板、创业板及其他中国证监会允许基金投资的股票和存托凭证)、债券(包括国内依法发行和上市交易的国债、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、次级债券、政府支持机构债券、政府支持债券、地方政府债券、可转换债券(含可分离交易可转债)、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、货币市场工具、同业存单、债券回购、资产支持证券、银行存款、股指期货、国债期货、股票期权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的相关规定)。本基金可以根据有关法律法规和基金合同的约定参与融资和转融通证券出借业务。基金的投资组合比例为:本基金所持有的股票、存托凭证资产占基金资产的比例不低于 80%,其中投资于标的指数成份券及其备选成份券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国债期货合约、股指期货合约和股票期权合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金,其中,现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。股指期货、国债期货、股票期权及其

他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种或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，可以将其纳入投资范围或调整上述投资品种的投资比例。

本基金的业绩比较基准：中证 1000 指数收益率。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则—基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、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”）、中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定编制，同时在具体会计核算和信息披露方面也参考了中国证券投资基金业协会发布的若干基金行业实务操作。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表的编制符合企业会计准则和中国证监会发布的关于基金行业实务操作的有关规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2024 年 6 月 30 日的财务状况以及自 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本报告期所采用的会计政策，会计估计与最近一期年度报告相一致。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期间未发生重大会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期间未发生重大会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期内无需要说明的重大会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2008]1号《财政部、国家税务总局关于企业所得税若干优惠政策的通知》、2008年9月18日《上海、深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、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》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统

挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[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]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》、财税[2023]39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》及其他相关税务法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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、债券免征增值税；2018 年 1 月 1 日起，公开募集证券投资基金管理人运营公开募集证券投资基金过程中发生的资管产品运营业务，以基金管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照 3%的征收率缴纳增值税。

(2) 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，暂不计缴企业所得税。

(3) 对基金取得的股票股息红利所得，由上市公司代扣代缴个人所得税；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，股息红利所得暂免征收个人所得税。上述所得统一适用 20%的税率计征个人所得税。

(4) 对于基金从事 A 股买卖，出让方按 0.10%的税率缴纳证券(股票)交易印花税，对受让方不再缴纳印花税；自 2023 年 8 月 28 日起，出让方减按 0.05%的税率缴纳证券(股票)交易印花税。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	1,473,444.85
等于：本金	1,472,851.51
加：应计利息	593.34
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	1,473,444.85

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	220,143,065.05	-	204,388,560.46	-15,754,504.59
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	220,143,065.05	-	204,388,560.46	-15,754,504.59

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

本基金本报告期末无衍生金融工具。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末无各项买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末无其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
----	---------------------

应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	409,555.91
其中：交易所市场	409,555.91
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	99,616.82
合计	509,172.73

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	270,438,087.00	270,438,087.00
本期申购	225,000,000.00	225,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-261,000,000.00	-261,000,000.00
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期末	234,438,087.00	234,438,087.00

注：本期申购含红利再投、转换入份（金）额，本期赎回含转换出份（金）额。

6.4.7.8 未分配利润

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	14,021,165.54	-18,111,977.77	-4,090,812.23
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	14,021,165.54	-18,111,977.77	-4,090,812.23
本期利润	-23,195,847.78	-4,120,711.10	-27,316,558.88
本期基金份额交易产生的变动数	-777,658.79	4,746,808.31	3,969,149.52
其中：基金申购款	-5,210,945.01	-9,834,876.42	-15,045,821.43
基金赎回款	4,433,286.22	14,581,684.73	19,014,970.95
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-9,952,341.03	-17,485,880.56	-27,438,221.59

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	27,132.83
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-

结算备付金利息收入	9,065.94
其他	4,487.33
合计	40,686.10

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-16,536,563.16
股票投资收益——赎回差价收入	-8,285,901.09
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-24,822,464.25

6.4.7.10.2 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 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	836,726,348.28
减：卖出股票成本总额	852,017,969.77
减：交易费用	1,244,941.67
买卖股票差价收入	-16,536,563.16

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
赎回基金份额对价总额	241,985,029.05
减：现金支付赎回款总额	92,673,168.05
减：赎回股票成本总额	157,597,762.09
减：交易费用	-
赎回差价收入	-8,285,901.09

6.4.7.10.4 股票投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无股票申购差价收入。

6.4.7.10.5 股票投资收益——证券出借差价收入

本基金本报告期内无证券出借差价收入。

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期内无债券投资收益。

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期内无买卖债券差价收入。

6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无债券赎回差价收入。

6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无债券申购差价收入。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

6.4.7.12.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

本基金本报告期内无买卖资产支持证券差价收入。

6.4.7.12.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券赎回差价收入。

6.4.7.12.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无资产支持证券申购差价收入。

6.4.7.13 贵金属投资收益

6.4.7.13.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

6.4.7.13.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

本基金本报告期内无买卖贵金属差价收入。

6.4.7.13.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期内无贵金属赎回差价收入。

6.4.7.13.4 贵金属投资收益——申购差价收入

本基金本报告期内无贵金属申购差价收入。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期内无衍生工具买卖权证差价收入。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期内无衍生工具其他投资收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	2,361,645.83
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	2,361,645.83

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
1.交易性金融资产	-4,120,711.10
——股票投资	-4,120,711.10
——债券投资	-
——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	-4,120,711.10

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	-
替代损益	18,069.23
合计	18,069.23

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	10,000.00
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
其他	9,944.48

合计	79,616.82
----	-----------

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报告批准报出日，本基金无需要披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
招商基金管理有限公司	基金管理人
广发证券股份有限公司	基金托管人
招商证券股份有限公司(以下简称“招商证券”)	基金管理人的股东

注：基金的主要关联方包含基金管理人、基金管理人的股东及子公司、基金托管人等。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
广发证券	1,665,484,168.37	100.00%	1,866,710,693.20	100.00%

6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
广发证券	-	-	743,127.19	100.00%

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券	719,752.54	100.00%	409,555.91	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券	741,327.24	100.00%	288,186.10	100.00%

注：1、本报告期内，本基金与关联方交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立；

2、本报告期内，基金对该类交易的佣金的计算方式是按合同约定的佣金率计算。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研究成果和市场信息等证券综合服务，并不收取额外对价。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	595,139.90	822,651.44
其中：应支付销售机构的客户维护费	105,387.62	146,674.20
应支付基金管理人的净管理费	489,752.28	675,977.24
应支付投资顾问的投资顾问费	-	-

注：支付基金管理人的基金管理人报酬按前一日基金资产净值×0.50%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：

日基金管理人报酬=前一日基金资产净值×0.50%÷当年天数

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托	119,027.97	164,530.29

管费		
----	--	--

注：支付基金托管人的基金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：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.10\% \div \text{当年天数}$$

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方进行银行间同业市场的债券（含回购）交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况。

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

本基金本报告期内及上年度可比期间无与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用自有资金投资本基金的情况

本报告期内及上年度可比期间基金管理人无运用自有资金投资本基金的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
广发证券股份有限公司	1,182,057.00	0.50%	4,026,094.00	1.49%
招商证券股份有限公司	10,609,258.00	4.53%	9,340,678.00	3.45%

注：表格中的比例为四舍五入的结果。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入

广发证券-活期	1,473,444.85	27,132.83	4,897,875.34	33,387.19
---------	--------------	-----------	--------------	-----------

注：本基金的托管人为广发证券股份有限公司，银行存款存放在具有基金托管资格的银行，按银行约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

单位：人民币元

本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
招商证券	688692	达梦数据	新股获配	837	72,785.52
上年度可比期间 2023 年 1 月 1 日至 2023 年 6 月 30 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
广发证券	301376	致欧科技	新股获配	3,284	80,983.44
广发证券	301357	北方长龙	新股获配	1,805	90,250.00
招商证券	301305	朗坤环境	新股获配	4,430	111,857.50
招商证券	301428	世纪恒通	新股获配	2,289	60,315.15

注：本表已包含托管人的关联方承销期内承销的证券。

6.4.11 利润分配情况

6.4.11.1 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期内未进行利润分配。

6.4.12 期末（2024 年 06 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
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：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001359	平安电工	2024 年 3 月 19 日	6 个月	新股流通受限	17.39	20.60	165	2,869.35	3,399.00	-
001379	腾达科技	2024 年 1 月 11 日	6 个月	新股流通受限	16.98	13.48	208	3,531.84	2,803.84	-
001387	雪祺电气	2024 年 1 月 4 日	6 个月	新股流通受限	15.38	15.25	173	2,045.54	2,638.25	-
001389	广合科技	2024 年	6 个月	新股流通	17.43	34.56	209	3,642.87	7,223.04	-

		3月26日		受限						
301392	汇成真空	2024年5月28日	6个月	新股流通受限	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-
301502	华阳智能	2024年1月26日	6个月	新股流通受限	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-
301536	星辰科技	2024年3月20日	6个月	新股流通受限	16.16	32.27	448	7,239.68	14,456.96	-
301538	骏鼎达	2024年3月13日	6个月	新股流通受限	55.82	91.24	149	5,972.74	13,594.76	-
301539	宏鑫科技	2024年4月3日	6个月	新股流通受限	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	-
301565	中仑新材	2024年6月13日	6个月	新股流通受限	11.88	18.98	519	6,165.72	9,850.62	-
301566	达利凯普	2023年12月22日	6个月	新股流通受限	8.90	16.97	576	5,126.40	9,774.72	-
301580	爱迪特	2024年6月19日	6个月	新股流通受限	44.95	65.93	138	6,203.10	9,098.34	-
301587	中瑞股份	2024年3月27日	6个月	新股流通受限	21.73	25.26	306	6,649.38	7,729.56	-
301588	美新科技	2024年3月6日	6个月	新股流通受限	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-
301589	诺瓦星云	2024年2月1日	6个月	新股流通受限	126.89	188.01	497	35,021.64	93,440.97	-
301591	肯特股份	2024年2月20日	6个月	新股流通受限	19.43	36.98	219	4,255.17	8,098.62	-
603082	北自科技	2024年1月23日	6个月	新股流通受限	21.28	29.49	107	2,276.96	3,155.43	-
603285	键邦股份	2024年6月28日	1个月内(含)	新股流通受限	18.65	18.65	1,023	19,078.95	19,078.95	-

603285	键邦股份	2024 年 6 月 28 日	6 个月	新股流通 受限	18.65	18.65	114	2,126.10	2,126.10	-
603312	西典新能	2024 年 1 月 4 日	6 个月	新股流通 受限	29.02	25.36	100	2,902.00	2,536.00	-
603325	博隆技术	2024 年 1 月 3 日	6 个月	新股流通 受限	72.46	68.06	43	3,115.78	2,926.58	-
603341	龙旗科技	2024 年 2 月 23 日	6 个月	新股流通 受限	26.00	37.49	125	3,250.00	4,686.25	-
603344	星德胜	2024 年 3 月 13 日	6 个月	新股流通 受限	19.18	22.66	139	2,666.02	3,149.74	-
603350	安乃达	2024 年 6 月 26 日	1 个月 内(含)	新股流通 受限	20.56	20.56	945	19,429.20	19,429.20	-
603350	安乃达	2024 年 6 月 26 日	6 个月	新股流通 受限	20.56	20.56	106	2,179.36	2,179.36	-
603375	盛景微	2024 年 1 月 17 日	6 个月	新股流通 受限	38.18	38.90	71	2,710.78	2,761.90	-
603381	永臻股份	2024 年 6 月 19 日	6 个月	新股流通 受限	23.35	25.13	98	2,288.30	2,462.74	-
688530	欧莱新材	2024 年 4 月 29 日	6 个月	新股流通 受限	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-
688584	上海合晶	2024 年 2 月 1 日	6 个月	新股流通 受限	22.66	15.89	374	8,474.84	5,942.86	-
688691	灿芯股份	2024 年 4 月 2 日	6 个月	新股流通 受限	19.86	42.51	247	4,905.42	10,499.97	-
688692	达梦数据	2024 年 6 月 4 日	6 个月	新股流通 受限	86.96	174.93	84	7,304.64	14,694.12	-
688695	中创股份	2024 年 3 月 6 日	6 个月	新股流通 受限	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-
688709	成都华微	2024 年 1 月 31	6 个月	新股流通 受限	15.69	18.79	478	7,499.82	8,981.62	-

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
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

注：对于在流通受限期内发生送股的股票，上表列示的数量为原受限股票数量与送股数量的加总。

6.4.12.2 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
300630	普利制药	2024年5月6日	重大事项停牌	12.35	2024年7月8日	9.88	71,800	1,043,152.82	886,730.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因银行间市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

本基金为股票型基金，本基金的运作涉及的金融工具主要包括股票投资、债券投资等。与这些金融工具有关的风险，以及本基金的基金管理人管理这些风险所采取的风险管理政策如下所述。

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的基金管理人从事风险管理的目标是提升本基金风险调整后收益水平，保证本基金的基金资产安全，维护基金份额持有人利益。基于该风险管理目标，本基金的基金管理人风险管理的基本策略是识别和分析本基金运作时本基金面临各种类型的风险，确定适当的风险容忍度，并及时可靠地对各种风险进行监督，将风险控制在限定的范围之内。本基金目前面临的主要风险包括：市场风险、信用风险和流动性风险。

本基金的基金管理人建立了以全面、独立、互相制约以及定性和定量相结合为原则的, 监事会、董事会及下设风险控制委员会、督察长、风险管理委员会、法律合规部和风险管理部等多层次的风险管理组织架构体系。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指金融工具的一方到期无法履行约定义务致使本基金遭受损失的风险。本基金的信用风险主要存在于银行存款、结算备付金、存出保证金、债券投资、资产支持证券投资及其他。

本基金的银行存款存放于本基金的基金托管人, 与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在证券交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算, 因此违约风险发生的可能性很小; 本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并采用券款对付交割方式, 以控制相应的信用风险。

对于与债券投资、资产支持证券投资等投资品种相关的信用风险, 本基金的基金管理人通过对投资品种的信用等级评估来选择适当的投资对象, 并限制单个投资品种的持有比例来管理信用风险。附注 6.4.13.2.1 至 6.4.13.2.6 列示了本基金所持有的债券投资及资产支持证券投资的信用评级, 该信用评级不包括本基金所持有的国债、央行票据、政策性金融债。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按短期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的债券投资。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的资产支持证券投资。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末无按长期信用评级列示的同业存单投资。

6.4.13.3 流动性风险

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金流动性风险来源于基金约定开放日兑付赎回资金的流动性风险，以及因部分投资品种交易不活跃而出现的变现风险以及因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理价格变现投资的风险。本基金所持有的金融资产主要在证券交易所和银行间同业市场交易。除附注 6.4.12 所披露的流通受限不能自由转让的基金资产外，本基金未持有其他有重大流动性风险的投资品种。除卖出回购金融资产外，本基金所持有的金融负债的合同约定到期日均为一年以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人在基金合同约定巨额赎回条款，设计了非常情况下赎回资金的处理模式，控制因开放模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

日常流动性风险管理中，本基金的基金管理人每日监控和预测本基金的流动性指标，通过对投资品种的流动性指标来持续地评估、选择、跟踪和控制基金投资的流动性风险。同时，本基金通过预留一定的现金头寸，并且在需要时可通过卖出回购金融资产方式融入短期资金，以缓解流动性风险。

本基金按合同约定申购赎回可采用一篮子股票的形式或现金替代方式，流动性风险相对较低。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指利率敏感性金融工具的公允价值及将来现金流受市场利率变动而发生波动的风险。本基金的基金管理人日常通过对利率水平的预测、分析收益率曲线及优化利率重新定价日组合等方法对上述利率风险进行管理。

下表统计了本基金面临的利率风险敞口。表中所示为本基金资产及交易形成负债的公允价值，并按照合同约定的重新定价日或到期日孰早者进行了分类。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024 年 6 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	1,473,444.85	-	-	-	1,473,444.85
结算备付金	1,247,720.20	-	-	-	1,247,720.20
存出保证金	506,006.76	-	-	-	506,006.76

交易性金融资产	-	-	-	204,388,560.46	204,388,560.46
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	-	-
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	3,227,171.81	-	-	204,388,560.46	207,615,732.27
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	86,956.34	86,956.34
应付托管费	-	-	-	17,391.29	17,391.29
应付清算款	-	-	-	2,346.50	2,346.50
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-
应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	509,172.73	509,172.73
负债总计	-	-	-	615,866.86	615,866.86
利率敏感度缺口	3,227,171.81	-	-	203,772,693.60	206,999,865.41
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	1,847,048.60	-	-	-	1,847,048.60
结算备付金	1,194,675.02	-	-	-	1,194,675.02
存出保证金	698,432.09	-	-	-	698,432.09
交易性金融资产	-	-	-	262,949,167.05	262,949,167.05
衍生金融资产	-	-	-	-	-
买入返售金融资产	-	-	-	-	-
债权投资	-	-	-	-	-
应收股利	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-
应收清算款	-	-	-	1,160,850.14	1,160,850.14
其他资产	-	-	-	-	-
资产总计	3,740,155.71	-	-	264,110,017.19	267,850,172.90
负债					
应付赎回款	-	-	-	-	-
应付管理人报酬	-	-	-	110,255.33	110,255.33
应付托管费	-	-	-	22,051.07	22,051.07
应付清算款	-	-	-	1,063,462.77	1,063,462.77
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-

应付销售服务费	-	-	-	-	-
应付投资顾问费	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
应交税费	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	307,128.96	307,128.96
负债总计	-	-	-	1,502,898.13	1,502,898.13
利率敏感度缺口	3,740,155.71	-	-	262,607,119.06	266,347,274.77

注：上表按金融资产或金融负债的重新定价日或到期日孰早者进行分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金本报告期末及上年度末无利率风险的敏感性分析。

6.4.13.4.2 其他价格风险

其他价格风险是指交易性金融资产的公允价值受市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动发生波动的风险，该风险可能与特定投资品种相关，也有可能与整体投资品种相关。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债券和股票，所有市场价格因素引起的金融资产公允价值变动均直接反映在当期损益中。本基金在构建资产配置和基金资产投资组合的基础上，通过建立事前和事后跟踪误差的方式，对基金资产的市场价格风险进行管理。

6.4.13.4.2.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	204,388,560.46	98.74	262,949,167.05	98.72
交易性金融资产-基金投资	-	-	-	-
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	204,388,560.46	98.74	262,949,167.05	98.72

6.4.13.4.2.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	1.若对市场价格敏感的权益性投资的市场价格上升或下降 5%	
	2.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 6 月 30 日）	上年度末（2023 年 12 月 31 日）
1. 权益性投资的市场价格上升 5%	10,219,428.02	13,147,458.35
2. 权益性投资的市场价格下降 5%	-10,219,428.02	-13,147,458.35

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	203,176,743.91	262,234,905.00
第二层次	929,543.61	-
第三层次	282,272.94	714,262.05
合计	204,388,560.46	262,949,167.05

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括应收款项、卖出回购金融资产和其他金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

本基金本报告期内无需要说明有助于理解和分析会计报表的其他事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	204,388,560.46	98.45
	其中：股票	204,388,560.46	98.45
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	2,721,165.05	1.31
8	其他各项资产	506,006.76	0.24
9	合计	207,615,732.27	100.00

注：此处的股票投资项含可退替代款估值增值。

7.2 期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	80,538.00	0.04
B	采矿业	9,475,367.00	4.58
C	制造业	112,214,714.06	54.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,833,925.64	3.30
E	建筑业	1,971,680.00	0.95
F	批发和零售业	7,996,330.00	3.86
G	交通运输、仓储和邮政业	6,057,576.00	2.93
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	14,457,407.76	6.98
J	金融业	4,506,379.65	2.18
K	房地产业	4,065,600.00	1.96
L	租赁和商务服务业	1,930,792.00	0.93

M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	569,268.00	0.28
R	文化、体育和娱乐业	1,567,589.00	0.76
S	综合	-	-
	合计	171,727,167.11	82.96

7.2.2 期末积极投资按行业分类境内股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	504,596.00	0.24
B	采矿业	470,337.00	0.23
C	制造业	24,453,566.96	11.81
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	133,760.00	0.06
E	建筑业	1,129,435.00	0.55
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,057,557.39	0.99
J	金融业	329,708.00	0.16
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	203,502.00	0.10
M	科学研究和技术服务业	1,673,965.00	0.81
N	水利、环境和公共设施管理业	35,606.00	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	1,669,360.00	0.81
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	32,661,393.35	15.78

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

7.3.1 报告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	001309	德明利	25,300	2,185,920.00	1.06
2	300679	电连技术	54,300	2,184,489.00	1.06
3	688208	道通科技	90,232	2,178,200.48	1.05
4	300857	协创数据	37,900	2,160,300.00	1.04
5	300379	东方通	261,600	2,113,728.00	1.02
6	300049	福瑞股份	41,300	2,079,042.00	1.00
7	002215	诺普信	276,200	2,057,690.00	0.99
8	002646	天佑德酒	196,100	2,006,103.00	0.97
9	300841	康华生物	39,600	2,005,344.00	0.97
10	002315	焦点科技	73,800	1,989,648.00	0.96
11	002773	康弘药业	84,000	1,818,600.00	0.88
12	600210	紫江企业	333,844	1,776,050.08	0.86
13	600750	江中药业	75,600	1,747,116.00	0.84
14	603025	大豪科技	123,520	1,707,046.40	0.82
15	601975	招商南油	474,700	1,704,173.00	0.82
16	600211	西藏药业	52,230	1,701,653.40	0.82
17	003039	顺控发展	135,700	1,700,321.00	0.82
18	601038	一拖股份	107,500	1,699,575.00	0.82
19	603919	金徽酒	92,600	1,682,542.00	0.81
20	002745	木林森	200,900	1,619,254.00	0.78
21	002635	安洁科技	101,500	1,567,160.00	0.76
22	002978	安宁股份	56,100	1,562,946.00	0.76
23	600971	恒源煤电	130,500	1,558,170.00	0.75
24	002237	恒邦股份	131,500	1,513,565.00	0.73
25	600711	盛屯矿业	411,300	1,509,471.00	0.73
26	002612	朗姿股份	107,900	1,491,178.00	0.72
27	002320	海峡股份	287,900	1,485,564.00	0.72
28	603995	甬金股份	84,700	1,483,944.00	0.72
29	600420	国药现代	138,700	1,481,316.00	0.72
30	301015	百洋医药	62,300	1,465,919.00	0.71
31	600649	城投控股	441,100	1,464,452.00	0.71
32	002416	爱施德	163,000	1,442,550.00	0.70
33	300415	伊之密	68,300	1,419,274.00	0.69
34	000049	德赛电池	58,400	1,369,480.00	0.66
35	603983	丸美股份	49,500	1,362,735.00	0.66
36	600285	羚锐制药	54,000	1,307,340.00	0.63
37	603489	八方股份	48,300	1,303,134.00	0.63
38	002191	劲嘉股份	360,700	1,302,127.00	0.63
39	601860	紫金银行	518,700	1,296,750.00	0.63
40	002351	漫步者	97,400	1,280,810.00	0.62
41	300303	聚飞光电	258,100	1,254,366.00	0.61

42	300034	钢研高纳	78,500	1,247,365.00	0.60
43	000690	宝新能源	240,900	1,228,590.00	0.59
44	603299	苏盐井神	129,300	1,228,350.00	0.59
45	000034	神州数码	53,600	1,226,904.00	0.59
46	300226	上海钢联	71,900	1,217,986.00	0.59
47	301262	海看股份	54,000	1,217,700.00	0.59
48	300705	九典制药	45,240	1,209,717.60	0.58
49	300850	新强联	80,100	1,203,102.00	0.58
50	601595	上海电影	60,800	1,202,624.00	0.58
51	600761	安徽合力	55,400	1,198,856.00	0.58
52	603323	苏农银行	249,000	1,197,690.00	0.58
53	600273	嘉化能源	167,500	1,195,950.00	0.58
54	603612	索通发展	93,700	1,195,612.00	0.58
55	688232	新点软件	60,601	1,195,051.72	0.58
56	000567	海德股份	212,965	1,194,733.65	0.58
57	002267	陕天然气	156,700	1,184,652.00	0.57
58	603013	亚普股份	87,900	1,184,013.00	0.57
59	000429	粤高速 A	113,600	1,182,576.00	0.57
60	600123	兰花科创	132,100	1,182,295.00	0.57
61	301327	华宝新能	20,600	1,180,380.00	0.57
62	603071	物产环能	94,200	1,180,326.00	0.57
63	002550	千红制药	218,900	1,179,871.00	0.57
64	001338	永顺泰	120,200	1,177,960.00	0.57
65	002283	天润工业	274,000	1,175,460.00	0.57
66	688776	国光电气	21,170	1,172,818.00	0.57
67	000915	华特达因	38,700	1,167,192.00	0.56
68	000718	苏宁环球	691,500	1,161,720.00	0.56
69	002737	葵花药业	49,600	1,159,648.00	0.56
70	300741	华宝股份	75,900	1,156,716.00	0.56
71	000923	河钢资源	67,100	1,155,462.00	0.56
72	002088	鲁阳节能	94,700	1,144,923.00	0.55
73	300229	拓尔思	83,300	1,118,719.00	0.54
74	002004	华邦健康	293,600	1,115,680.00	0.54
75	002249	大洋电机	219,600	1,038,708.00	0.50
76	002053	云南能投	84,300	1,019,187.00	0.49
77	001337	四川黄金	43,900	1,018,919.00	0.49
78	002139	拓邦股份	95,100	1,009,962.00	0.49
79	002990	盛视科技	48,700	980,331.00	0.47
80	002123	梦网科技	138,500	973,655.00	0.47
81	600480	凌云股份	93,500	919,105.00	0.44
82	600007	中国国贸	41,500	911,340.00	0.44
83	000600	建投能源	143,500	904,050.00	0.44
84	601311	骆驼股份	112,700	903,854.00	0.44

85	601918	新集能源	92,200	898,950.00	0.43
86	002498	汉缆股份	273,000	898,170.00	0.43
87	600458	时代新材	88,400	892,840.00	0.43
88	603985	恒润股份	74,800	890,120.00	0.43
89	002402	和而泰	82,600	884,646.00	0.43
90	300369	绿盟科技	171,700	877,387.00	0.42
91	605333	沪光股份	31,400	874,490.00	0.42
92	000550	江铃汽车	40,000	868,400.00	0.42
93	300428	立中集团	46,600	866,294.00	0.42
94	688278	特宝生物	16,146	864,618.30	0.42
95	600966	博汇纸业	178,700	854,186.00	0.41
96	688033	天宜上佳	139,102	834,612.00	0.40
97	002036	联创电子	120,000	810,000.00	0.39
98	002274	华昌化工	97,000	719,740.00	0.35
99	002697	红旗连锁	151,300	700,519.00	0.34
100	603713	密尔克卫	12,800	685,056.00	0.33
101	000012	南玻 A	130,700	658,728.00	0.32
102	600710	苏美达	79,900	651,185.00	0.31
103	300130	新国都	38,780	645,299.20	0.31
104	601677	明泰铝业	55,700	643,892.00	0.31
105	600667	太极实业	112,400	641,804.00	0.31
106	002020	京新药业	57,700	604,119.00	0.29
107	300482	万孚生物	24,600	600,240.00	0.29
108	601126	四方股份	31,100	597,742.00	0.29
109	600718	东软集团	71,300	589,651.00	0.28
110	300113	顺网科技	57,000	583,680.00	0.28
111	000951	中国重汽	40,500	579,960.00	0.28
112	600596	新安股份	75,900	576,840.00	0.28
113	600446	金证股份	58,000	575,940.00	0.28
114	300143	盈康生命	75,600	569,268.00	0.28
115	600507	方大特钢	151,800	567,732.00	0.27
116	000821	京山轻机	49,800	564,234.00	0.27
117	300735	光弘科技	26,100	563,760.00	0.27
118	600557	康缘药业	35,800	562,060.00	0.27
119	688239	航宇科技	16,043	558,296.40	0.27
120	300772	运达股份	58,000	556,800.00	0.27
121	300693	盛弘股份	26,400	552,816.00	0.27
122	600587	新华医疗	35,050	551,687.00	0.27
123	688800	瑞可达	19,434	545,706.72	0.26
124	002906	华阳集团	20,300	543,228.00	0.26
125	300596	利安隆	20,000	542,600.00	0.26
126	002135	东南网架	136,700	541,332.00	0.26
127	000810	创维数字	61,800	530,244.00	0.26

128	600266	城建发展	141,200	528,088.00	0.26
129	002911	佛燃能源	57,226	523,045.64	0.25
130	002061	浙江交科	137,700	502,605.00	0.24
131	600916	中国黄金	50,700	487,734.00	0.24
132	603297	永新光学	8,000	483,920.00	0.23
133	300755	华致酒行	34,200	467,172.00	0.23
134	001236	弘业期货	63,900	454,329.00	0.22
135	300031	宝通科技	31,600	454,092.00	0.22
136	002154	报喜鸟	82,600	449,344.00	0.22
137	600248	陕建股份	114,900	417,087.00	0.20
138	688018	乐鑫科技	4,078	402,417.04	0.19
139	002405	四维图新	64,000	398,080.00	0.19
140	002446	盛路通信	69,500	392,675.00	0.19
141	002832	比音勒芬	15,300	369,801.00	0.18
142	600428	中远海特	58,200	356,184.00	0.17
143	300953	震裕科技	6,500	352,300.00	0.17
144	002583	海能达	86,300	351,241.00	0.17
145	600409	三友化工	69,700	349,894.00	0.17
146	600158	中体产业	45,300	348,357.00	0.17
147	300476	胜宏科技	10,700	345,182.00	0.17
148	601609	金田股份	60,900	344,694.00	0.17
149	601886	江河集团	70,600	344,528.00	0.17
150	300140	节能环境	57,600	343,872.00	0.17
151	000016	深康佳 A	161,300	343,569.00	0.17
152	600691	阳煤化工	198,900	340,119.00	0.16
153	600874	创业环保	60,100	335,959.00	0.16
154	603693	江苏新能	28,600	332,332.00	0.16
155	600490	鹏欣资源	127,800	332,280.00	0.16
156	600366	宁波韵升	63,600	331,992.00	0.16
157	600201	生物股份	45,900	330,939.00	0.16
158	601702	华峰铝业	18,100	330,506.00	0.16
159	300573	兴齐眼药	2,000	328,000.00	0.16
160	300737	科顺股份	75,900	326,370.00	0.16
161	002265	建设工业	37,700	325,351.00	0.16
162	688336	三生国健	15,907	323,707.45	0.16
163	688289	圣湘生物	18,341	322,434.78	0.16
164	688789	宏华数科	2,971	320,273.80	0.15
165	603393	新天然气	9,200	319,608.00	0.15
166	000557	西部创业	84,200	316,592.00	0.15
167	002212	天融信	64,900	316,063.00	0.15
168	688408	中信博	3,428	315,650.24	0.15
169	605020	永和股份	16,400	314,552.00	0.15
170	688598	金博股份	11,061	313,026.30	0.15

171	301308	江波龙	3,300	312,642.00	0.15
172	002145	中核钛白	94,800	310,944.00	0.15
173	002453	华软科技	72,400	310,596.00	0.15
174	002126	银轮股份	17,800	309,898.00	0.15
175	600459	贵研铂业	22,800	308,028.00	0.15
176	001376	百通能源	16,400	305,368.00	0.15
177	002991	甘源食品	5,000	303,250.00	0.15
178	002617	露笑科技	63,100	302,880.00	0.15
179	601001	晋控煤业	18,300	302,316.00	0.15
180	002302	西部建设	58,100	302,120.00	0.15
181	000913	钱江摩托	19,100	301,016.00	0.15
182	601022	宁波远洋	33,600	296,352.00	0.14
183	301559	中集环科	19,800	288,486.00	0.14
184	301316	慧博云通	18,700	274,516.00	0.13
185	000058	深赛格	50,400	270,648.00	0.13
186	000927	中国铁物	100,700	239,666.00	0.12
187	600645	中源协和	14,800	238,280.00	0.12
188	300687	赛意信息	17,000	236,640.00	0.11
189	603063	禾望电气	14,900	228,417.00	0.11
190	000848	承德露露	28,300	222,438.00	0.11
191	603132	金徽股份	16,100	221,536.00	0.11
192	688076	诺泰生物	2,723	213,156.44	0.10
193	688266	泽璟制药	3,812	206,686.64	0.10
194	002183	怡亚通	71,300	202,492.00	0.10
195	002270	华明装备	8,900	197,936.00	0.10
196	002961	瑞达期货	17,900	196,005.00	0.09
197	603368	柳药集团	11,000	192,500.00	0.09
198	002158	汉钟精机	10,900	182,248.00	0.09
199	300783	三只松鼠	8,300	181,521.00	0.09
200	300068	南都电源	20,000	165,600.00	0.08
201	002456	欧菲光	20,200	157,762.00	0.08
202	000727	冠捷科技	76,200	156,972.00	0.08
203	300123	亚光科技	32,900	152,656.00	0.07
204	300620	光库科技	3,900	143,442.00	0.07
205	605365	立达信	8,900	141,243.00	0.07
206	688575	亚辉龙	5,882	137,168.24	0.07
207	300770	新媒股份	4,100	136,858.00	0.07
208	688596	正帆科技	3,864	127,512.00	0.06
209	688127	蓝特光学	6,533	120,141.87	0.06
210	002458	益生股份	9,300	80,538.00	0.04
211	003009	中天火箭	1,900	73,492.00	0.04
212	601969	海南矿业	10,300	65,302.00	0.03
213	000627	天茂集团	35,700	62,475.00	0.03

214	000498	山东路桥	10,600	55,438.00	0.03
215	300446	航天智造	4,600	54,740.00	0.03
216	002851	麦格米特	2,100	54,264.00	0.03
217	600688	上海石化	18,300	47,763.00	0.02
218	002948	青岛银行	12,800	43,136.00	0.02
219	002214	大立科技	3,600	40,608.00	0.02
220	600864	哈投股份	7,800	37,050.00	0.02
221	002100	天康生物	4,800	33,264.00	0.02
222	600012	皖通高速	1,900	26,543.00	0.01
223	601375	中原证券	7,100	24,211.00	0.01
224	688106	金宏气体	1,309	22,933.68	0.01
225	002318	久立特材	900	20,997.00	0.01
226	688578	艾力斯	296	18,867.04	0.01
227	002567	唐人神	3,200	17,152.00	0.01
228	300638	广和通	1,000	17,100.00	0.01
229	603103	横店影视	1,200	16,608.00	0.01
230	002354	天娱数科	5,100	15,249.00	0.01
231	600961	株冶集团	1,600	15,104.00	0.01
232	603098	森特股份	1,300	10,218.00	0.00
233	688023	安恒信息	200	8,002.00	0.00
234	601333	广深铁路	1,400	4,536.00	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	603629	利通电子	111,600	2,060,136.00	1.00
2	300394	天孚通信	19,080	1,687,053.60	0.82
3	000526	学大教育	27,100	1,669,360.00	0.81
4	002919	名臣健康	106,300	1,234,143.00	0.60
5	300724	捷佳伟创	22,600	1,220,626.00	0.59
6	300492	华图山鼎	12,200	1,149,240.00	0.56
7	600566	济川药业	36,200	1,147,902.00	0.55
8	600096	云天化	59,100	1,147,722.00	0.55
9	603688	石英股份	38,600	1,142,946.00	0.55
10	600809	山西汾酒	5,400	1,138,752.00	0.55
11	603929	亚翔集成	46,300	1,106,570.00	0.53
12	600506	香梨股份	89,100	1,103,058.00	0.53
13	300630	普利制药	71,800	886,730.00	0.43
14	300002	神州泰岳	100,500	816,060.00	0.39
15	002030	达安基因	147,300	736,500.00	0.36
16	688260	昀冢科技	36,286	539,572.82	0.26

17	600066	宇通客车	20,900	539,220.00	0.26
18	003023	彩虹集团	33,600	535,920.00	0.26
19	300509	新美星	113,600	531,648.00	0.26
20	300308	中际旭创	3,820	526,701.60	0.25
21	300150	世纪瑞尔	203,700	525,546.00	0.25
22	300635	中达安	69,500	524,725.00	0.25
23	002209	达意隆	68,700	524,181.00	0.25
24	600612	老凤祥	8,800	512,072.00	0.25
25	002517	恺英网络	53,500	510,925.00	0.25
26	300176	派生科技	115,300	508,473.00	0.25
27	600598	北大荒	40,400	504,596.00	0.24
28	600309	万华化学	5,800	468,988.00	0.23
29	300552	万集科技	12,200	456,036.00	0.22
30	002073	软控股份	48,800	360,632.00	0.17
31	600186	莲花健康	98,800	338,884.00	0.16
32	600938	中国海油	9,800	323,400.00	0.16
33	000338	潍柴动力	19,800	321,552.00	0.16
34	002527	新时达	53,500	320,465.00	0.15
35	002897	意华股份	8,300	312,578.00	0.15
36	300832	新产业	4,600	310,224.00	0.15
37	600276	恒瑞医药	7,900	303,834.00	0.15
38	603298	杭叉集团	15,220	298,920.80	0.14
39	002755	奥赛康	29,900	288,535.00	0.14
40	002824	和胜股份	21,500	274,340.00	0.13
41	601169	北京银行	42,600	248,784.00	0.12
42	300269	联建光电	98,300	246,733.00	0.12
43	600114	东睦股份	15,900	228,801.00	0.11
44	002463	沪电股份	5,700	208,050.00	0.10
45	301012	扬电科技	8,400	207,984.00	0.10
46	688819	天能股份	8,600	205,196.00	0.10
47	300781	因赛集团	3,900	203,502.00	0.10
48	688281	华秦科技	2,360	196,635.20	0.09
49	300047	天源迪科	26,600	173,964.00	0.08
50	002094	青岛金王	81,000	144,990.00	0.07
51	600098	广州发展	20,900	133,760.00	0.06
52	002580	圣阳股份	21,600	132,840.00	0.06
53	605080	浙江自然	7,200	113,904.00	0.06
54	688788	科思科技	4,800	111,600.00	0.05
55	688011	新光光电	7,200	109,080.00	0.05
56	000975	山金国际	6,300	102,627.00	0.05
57	301589	诺瓦星云	497	93,440.97	0.05
58	300842	帝科股份	2,100	81,480.00	0.04
59	688660	电气风电	25,100	72,288.00	0.03

60	300397	天和防务	6,900	63,480.00	0.03
61	601990	南京证券	6,800	52,224.00	0.03
62	002377	国创高新	27,400	48,498.00	0.02
63	603042	华脉科技	4,600	48,024.00	0.02
64	002557	洽洽食品	1,700	47,923.00	0.02
65	603516	淳中科技	1,500	47,355.00	0.02
66	002128	电投能源	2,100	44,310.00	0.02
67	300912	凯龙高科	3,800	35,606.00	0.02
68	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.01
69	603285	键邦股份	1,137	21,205.05	0.01
70	300767	震安科技	2,500	21,200.00	0.01
71	601336	新华保险	600	18,018.00	0.01
72	002140	东华科技	1,900	14,725.00	0.01
73	688692	达梦数据	84	14,694.12	0.01
74	301536	星辰科技	448	14,456.96	0.01
75	301538	骏鼎达	149	13,594.76	0.01
76	603198	迎驾贡酒	200	11,500.00	0.01
77	601162	天风证券	4,900	10,682.00	0.01
78	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.01
79	301565	中仑新材	519	9,850.62	0.00
80	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00
81	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
82	601127	赛力斯	100	9,112.00	0.00
83	301580	爱迪特	138	9,098.34	0.00
84	688709	成都华微	478	8,981.62	0.00
85	002713	东易日盛	3,700	8,140.00	0.00
86	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
87	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
88	001389	广合科技	209	7,223.04	0.00
89	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
90	301555	惠柏新材	224	6,345.92	0.00
91	301578	辰奕智能	153	6,054.21	0.00
92	688584	上海合晶	374	5,942.86	0.00
93	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
94	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
95	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
96	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
97	001378	德冠新材	205	4,891.30	0.00
98	603341	龙旗科技	125	4,686.25	0.00
99	300871	回盛生物	400	3,816.00	0.00
100	603107	上海汽配	215	3,416.35	0.00
101	001359	平安电工	165	3,399.00	0.00
102	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00

103	603344	星德胜	139	3,149.74	0.00
104	603325	博隆技术	43	2,926.58	0.00
105	001379	腾达科技	208	2,803.84	0.00
106	603375	盛景微	71	2,761.90	0.00
107	001387	雪祺电气	173	2,638.25	0.00
108	603312	西典新能	100	2,536.00	0.00
109	603381	永臻股份	98	2,462.74	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	688278	特宝生物	5,841,670.27	2.19
2	300113	顺网科技	4,933,055.00	1.85
3	603583	捷昌驱动	4,838,891.00	1.82
4	601126	四方股份	4,802,557.74	1.80
5	603489	八方股份	4,629,193.80	1.74
6	688318	财富趋势	4,526,436.01	1.70
7	300034	钢研高纳	4,291,919.00	1.61
8	000818	航锦科技	4,177,660.00	1.57
9	600007	中国国贸	4,146,320.00	1.56
10	600850	电科数字	4,083,706.00	1.53
11	600491	龙元建设	3,922,784.00	1.47
12	603688	石英股份	3,762,296.50	1.41
13	002351	漫步者	3,687,707.88	1.38
14	600273	嘉化能源	3,650,378.00	1.37
15	002416	爱施德	3,628,145.00	1.36
16	603025	大豪科技	3,518,208.00	1.32
17	300476	胜宏科技	3,461,656.00	1.30
18	300002	神州泰岳	3,441,735.00	1.29
19	000032	深桑达 A	3,414,336.00	1.28
20	000550	江铃汽车	3,377,156.00	1.27

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票；

2、基金持有的股票分类为交易性金融资产的，本项的“累计买入金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产
----	------	------	----------	---------

				净值比例 (%)
1	688278	特宝生物	6,463,656.60	2.43
2	603583	捷昌驱动	6,116,805.00	2.30
3	688578	艾力斯	5,023,231.15	1.89
4	600850	电科数字	4,931,734.00	1.85
5	600491	龙元建设	4,826,712.00	1.81
6	603283	赛腾股份	4,594,722.00	1.73
7	601126	四方股份	4,513,455.00	1.69
8	000818	航锦科技	4,454,177.00	1.67
9	300457	赢合科技	4,448,533.81	1.67
10	688318	财富趋势	4,436,837.93	1.67
11	603196	日播时尚	4,380,655.00	1.64
12	688007	光峰科技	4,367,014.07	1.64
13	600711	盛屯矿业	4,318,259.00	1.62
14	300113	顺网科技	4,245,275.00	1.59
15	688408	中信博	4,190,254.17	1.57
16	603920	世运电路	4,108,766.00	1.54
17	300573	兴齐眼药	3,853,909.60	1.45
18	601022	宁波远洋	3,705,635.00	1.39
19	000682	东方电子	3,658,801.60	1.37
20	600675	中华企业	3,630,390.00	1.36

注：1、卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票；

2、基金持有的股票分类为交易性金融资产的，本项“累计卖出金额”按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	830,042,996.37
卖出股票收入（成交）总额	836,726,348.28

注：1、买入包括基金二级市场上主动的买入、新股、配股、债转股、换股及行权等获得的股票，卖出主要指二级市场上主动的卖出、换股、要约收购、发行人回购及行权等减少的股票；

2、“买入股票成本（成交）总额”、“卖出股票收入（成交）总额”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货将根据风险管理的原则，以套期保值为目的，主要选择流动性好、交易活跃的股指期货合约。通过对股指期货的投资，实现管理市场风险和改善投资组合风险收益特性的目的。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金参与国债期货投资是为了有效控制债券市场的系统性风险，本基金将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，适度运用国债期货提高投资组合运作效率。在国债期货投资过程中，基金管理人通过对宏观经济和利率市场走势的分析与判断，并充分考虑国债期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置，谨慎进行投资，以调整债券组合的久期，降低投资组合的整体风险。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货合约。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1

报告期内基金投资的前十名证券除道通科技（证券代码 688208）、德明利（证券代码 001309）、东方通（证券代码 300379）外其他证券的发行主体未有被监管部门立案调查，不存在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

1、道通科技（证券代码 688208）

根据 2023 年 10 月 22 日发布的相关公告，该证券发行人因违规发布广告或进行虚假、误导宣传被深圳市市场监管局南山监管局处以罚款。

2、德明利（证券代码 001309）

根据 2024 年 1 月 2 日发布的相关公告，该证券发行人因未依法履行职责被深圳证监局给予警示。

3、东方通（证券代码 300379）

根据 2024 年 4 月 29 日发布的相关公告，该证券发行人因财务会计报告违规被北京证监局责令改正。

根据 2024 年 6 月 6 日发布的相关公告，该证券发行人因财务会计报告违规被北京证监局给予警示。

对上述证券的投资决策程序的说明：本基金为指数型基金，因复制指数被动持有，上述证券的投资决策程序符合相关法律法规和公司制度的要求。

7.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库，本基金管理人从制度和流程上要求股票必须先入库再买入。

7.12.3 期末其他各项资产构成

金额单位：人民币元

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	506,006.76
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	506,006.76

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限的情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限的情况。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
3,112	75,333.58	83,253,235.00	35.51%	151,184,852.00	64.49%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中信证券-工行-中信证券贵宾定制 7 号集合资产管理计划	15,216,600.00	6.49%
2	招商证券股份有限公司	10,609,258.00	4.53%
3	上海国际信托有限公司-上海信托添越睿银 1 号集合资金信托计划	9,909,800.00	4.23%
4	广发证券资管-中电科投资控股有限公司-广发资管长昇 6 号单一资产管理计划	9,870,900.00	4.21%
5	余子贵	9,801,800.00	4.18%
6	财信吉祥人寿保险股份有限公司-祥和产品	7,317,600.00	3.12%
7	招商财富资管-中文天地出版传媒集团股份有限公司-招商财富-践昇多资产 1 号 FOF 单一资产管理计划	5,651,900.00	2.41%
8	方正证券股份有限公司	4,862,524.00	2.07%
9	上海思懿投资管理有限公司-思懿投资省心享安欣三号私募证券投资基金	4,588,200.00	1.96%
10	楼晔	4,500,977.00	1.92%

注：以上数据由中国证券登记结算公司提供，前十名持有人均为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	49,900.00	0.0213%
------------------	-----------	---------

8.4 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	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2022年11月18日)基金份额总额	1,464,438,087.00
本报告期期初基金份额总额	270,438,087.00
本报告期基金总申购份额	225,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	261,000,000.00
本报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-
本报告期期末基金份额总额	234,438,087.00

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金管理人未发生重大人事变动。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的重大诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期基金投资策略无改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金管理人没有受到监管部门的稽查或处罚，亦未收到关于基金管理人的高级管理人员受到监管部门的稽查或处罚的书面通知或文件。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
广发证券	4	1,665,484,168.37	100.00%	719,752.54	100.00%	-

注：本报告期内，基金交易佣金根据券商季度综合评分结果给与分配，券商综合评分根据研究报告质量、路演质量、联合调研质量等维度进行打分，从多家服务券商中选取符合法律规范经营的综合能力靠前的券商给与佣金分配，季度评分和佣金分配分别由专人负责。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	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
广发证券	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	招商基金管理有限公司旗下部分基金增加民生证券股份有限公司为场内申购赎回代办券商的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-01-15
2	招商基金管理有限公司关于指定旗下部分证券投资基金主流流动性服务商的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会	2024-01-15

		会基金电子披露网站	
3	招商基金管理有限公司关于终止北京中期时代基金销售有限公司办理旗下基金销售业务的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-01-18
4	招商基金管理有限公司旗下基金 2023 年第 4 季度报告提示性公告	上海证券报及基金管理人网站	2024-01-19
5	招商中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-01-19
6	招商基金管理有限公司旗下部分基金增加申万宏源证券有限公司为场内申购赎回代办券商的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-02-28
7	招商基金管理有限公司旗下部分基金增加申万宏源西部证券有限公司为场内申购赎回代办券商的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-02-28
8	招商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场内申购赎回代办券商的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-03-01
9	招商基金管理有限公司旗下基金 2023 年年度报告提示性公告	上海证券报及基金管理人网站	2024-03-29
10	招商中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金 2023 年年度报告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-03-29
11	招商基金管理有限公司旗下基金 2024 年第 1 季度报告提示性公告	上海证券报及基金管理人网站	2024-04-19
12	招商中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金 2024 年第 1 季度报告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-04-19
13	招商基金管理有限公司关于提醒投资者持续完善身份信息资料的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-05-18
14	招商基金管理有限公司关于旗下基金投资关联方承销证券的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-06-05
15	招商基金管理有限公司旗下部分基金增加东方证券股份有限公司为场内申购赎回代办券商的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-06-19
16	招商基金管理有限公司旗下部分基金增加中国银河证券股份有限公司为场内申购赎回代办券商的公告	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-06-28
17	招商中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要更新	上海证券报、基金管理人网站及中国证监会基金电子披露网站	2024-06-28

§ 11 备查文件目录

11.1 备查文件目录

- 1、中国证券监督管理委员会批准设立招商基金管理有限公司的文件；
- 2、中国证券监督管理委员会批准招商中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金设立的文件；
- 3、《招商中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》；
- 4、《招商中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金托管协议》；
- 5、《招商中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》；
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照。

11.2 存放地点

招商基金管理有限公司

地址：深圳市福田区深南大道 7088 号

11.3 查阅方式

上述文件可在招商基金管理有限公司互联网站上查阅，或者在营业时间内到招商基金管理有限公司查阅。

投资者对本报告书如有疑问，可咨询本基金管理人招商基金管理有限公司。

客户服务中心电话：400-887-9555

网址：<http://www.cmfcchina.com>

招商基金管理有限公司

2024 年 8 月 30 日