

财通中证 1000 指数增强型证券投资基金 2024 年中期报告

2024 年 06 月 30 日

基金管理人:财通基金管理有限公司

基金托管人:广发证券股份有限公司

送出日期:2024 年 08 月 31 日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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30日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2024年1月1日起至6月30日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	10
2.4 信息披露方式	10
2.5 其他相关资料	11
§3 主要财务指标和基金净值表现	11
3.1 主要会计数据和财务指标	11
3.2 基金净值表现	12
§4 管理人报告	14
4.1 基金管理人及基金经理情况	14
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	15
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	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	17
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	18
§5 托管人报告	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	18
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	18
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	18
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	18
6.1 资产负债表	18
6.2 利润表	20
6.3 净资产变动表	21
6.4 报表附注	23
§7 投资组合报告	56
7.1 期末基金资产组合情况	56
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	57
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	59
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	71
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	73
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	74
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	74
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	74

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 .....	74
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	74
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	74
7.12 投资组合报告附注 .....	74
§8 基金份额持有人信息 .....	75
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	75
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	76
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	76
§9 开放式基金份额变动 .....	77
§10 重大事件揭示 .....	77
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	77
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 .....	77
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	78
10.4 基金投资策略的改变 .....	78
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	78
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 .....	78
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	78
10.8 其他重大事件 .....	79
§11 影响投资者决策的其他重要信息 .....	82
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	82
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	82
§12 备查文件目录 .....	82
12.1 备查文件目录 .....	82
12.2 存放地点 .....	83
12.3 查阅方式 .....	83

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	财通中证1000指数增强型证券投资基金	
基金简称	财通中证1000指数增强	
场内简称	-	
基金主代码	019270	
交易代码	-	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023年11月07日	
基金管理人	财通基金管理有限公司	
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	239,853,854.49份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	财通中证1000指数增强A	财通中证1000指数增强C
下属分级基金场内简称	-	-
下属分级基金的交易代码	019270	019271
报告期末下属分级基金的份额总额	53,247,581.54份	186,606,272.95份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	<p>本基金为股票型指数增强基金，在对标的指数进行有效跟踪的基础上，结合增强型的投资方法，进行积极的组合管理和风险控制，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。</p>
投资策略	<p><b>1、股票投资策略</b></p> <p>本基金属于指数增强型股票基金，力求控制本基金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0.5%，年化跟踪误差不超过7.75%；同时通过量化策略进行投资组合管理，力争实现超越业绩比较基准的投资回报，谋求基金资产的长期增值。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管</p>

理人将采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。

(1) 指数投资策略

指数投资策略参照标的指数的成份股、备选成份股及其权重，初步构建投资组合，并按照标的指数的调整规则作出相应调整。

(2) 指数增强策略

本基金为股票型指数增强基金，主要利用全市场多因子选股模型，在保持对基准指数紧密跟踪的前提下力争实现对基准指数长期超越。

1) 多因子alpha模型——股票超额回报预测

多因子alpha模型以中国股票市场较长期的回溯研究为基础，结合前瞻性市场判断，用精研的多个因子捕捉市场有效性暂时缺失之处，以多因子在不同个股上的不同体现估测个股的超值回报。概括来讲，本基金alpha模型的因子可归为如下几类：价值（value）、质量（quality）、动量（momentum）、成长（growth）、市场预期等等。其中，本基金将侧重从基本面投资角度出发，参考市盈率、市净率、市销率、PEG、EV/EBITDA等估值指标，优选价值相对其成长能力被低估的上市公司构成股票池。公司的量化投研团队会持续研究市场的状态以及市场变化，并对模型和模型所采用的因子做出适当更新或调整。

多因子alpha模型利用长期积累并最新扩展的数据库，科学地考虑了大量的各类信息，包括来自市场各类投资者、公司各类报表、分析师预测等等多方的信息。基金经理根据市场状况及变化对各类信息的重要性做出具有一定前瞻性的判断，适合调整各因子类别的具体组成及权重。

2) 风险估测模型——力争有效控制预期风险

本基金将利用风险预测模型和适当的控制措施，力争有效控制投资组合的预期投资风险，并力求将投资组合的实现风险控制目标范围内。

3) 交易成本模型——控制交易成本以保护投

资业绩

本基金的交易成本模型既考虑固定成本，也考虑交易的市场冲击效应，以力争减少交易对业绩造成的负面影响。在控制交易成本的基础上，力求进行投资收益的优化。

4) 投资组合的优化和调整

本基金将综合考虑预期回报，风险及交易成本进行投资组合优化。其选股范围将包括流动性和基本面信息较好的股票。投资组合构建完成后，本基金将充分考虑各种市场信息的变化情况，对投资组合进行相应调整，并根据市场的实际情况适当控制和调整组合的换手率。

2、存托凭证投资策略

本基金将根据投资目标和股票投资策略，基于对基础证券投资价值的深入研究判断，进行存托凭证的投资。

3、固定收益类资产投资策略

固定收益投资在保证资产流动性的基础上，采取利率预期策略、信用风险管理和时机策略相结合的积极性投资方法，力求在控制各类风险的基础上获取稳定的收益。

(1) 利率预期与久期控制策略

本基金密切跟踪最新发布的宏观经济数据和金融运行数据，分析宏观经济运行的可能情景，预测财政政策、货币政策等政府宏观经济政策取向，分析金融市场资金供求状况变化趋势，在此基础上预测市场利率水平变动趋势，以及收益率曲线变化趋势。在预期市场利率水平将上升时，降低组合的久期；预期市场利率将下降时，提高组合的久期。并根据收益率曲线变化情况制定相应的债券组合期限结构策略，如子弹型组合、哑铃型组合或者阶梯型组合等。

(2) 个券选择策略

个券选择层面，对各信用品种进行详细的财务分析和非财务分析后，进行个券选择。财务分析方

面，以企业财务报表为依据，对企业规模、资产负债结构、偿债能力和盈利能力四方面进行评分；非财务分析方面（包括管理能力、市场地位和发展前景等指标）则主要采取实地调研和电话会议等形式实施。

### （3）时机策略

i.价值分析策略。根据当日收益率曲线和债券特性，建立债券的估值模型，对当日无交易的债券计算理论价值，买进价格低于价值的债券；相反，卖出价格高于价值的债券。

ii.骑乘策略。当收益率曲线比较陡峭时，也即相邻期限利差较大时，可以买入期限位于收益率曲线陡峭处的债券，也即收益率水平处于相对高位的债券，随着持有期限的延长，债券的剩余期限将会缩短，从而此时债券的收益率水平将会较投资期初有所下降，通过债券的收益率的下滑，进而获得资本利得收益。

iii.息差策略。利用回购利率低于债券收益率的情形，通过正回购将所获得资金投资于债券以获取超额收益。

iv.利差策略。对两个期限相近的债券的利差进行分析，对利差水平的未来走势做出判断，从而进行相应的债券置换。当预期利差水平缩小时，买入收益率高的债券同时卖出收益率低的债券，通过两债券利差的缩小获得投资收益；当预期利差水平扩大时，买入收益率低的债券同时卖出收益率高的债券，通过两债券利差的扩大获得投资收益。

### 4、资产支持证券投资策略

资产支持证券的定价受市场利率、发行条款、标的资产的构成及质量、提前偿还率等多种因素影响。本基金将在基本面分析和债券市场宏观分析的基础上，对资产支持证券的交易结构风险、信用风险、提前偿还风险和利率风险等进行分析，采取包括收益率曲线策略、信用利差曲线策略、预期利率波动率策略等积极主动的投资策略，投资于资产支



	<p>持证券。</p> <p><b>5、股指期货的投资策略</b></p> <p>本基金将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，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。套期保值将主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。本基金在进行股指期货投资时，将通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。</p> <p><b>6、股票期权投资策略</b></p> <p>本基金投资股票期权将按照风险管理的原则，以套期保值为主要目的，结合投资目标、比例限制、风险收益特征以及法律法规的相关限定和要求，确定参与股票期权交易的投资时机和投资比例。若相关法律法规发生变化时，基金管理人股票期权投资管理从其最新规定，以符合上述法律法规和监管要求的变化。</p> <p><b>7、融资及转融通证券出借业务投资策略</b></p> <p>本基金在参与融资、转融通证券出借业务时将根据风险管理的原则，在法律法规允许的范围和比例内、风险可控的前提下，本着谨慎原则，参与融资和转融通证券出借业务。参与转融通证券出借业务时，本基金将从基金持有的融券标的股票中选择流动性好、交易活跃的股票作为转融通证券出借交易对象，力争为本基金份额持有人增厚投资收益。</p> <p>未来，随着投资工具的发展和丰富，基金管理人在履行适当程序后，本基金可在不改变投资目标及风险收益特征的前提下，相应调整和更新相关投资策略，并在招募说明书中更新。</p>
<p>业绩比较基准</p>	<p>中证1000指数收益率*95%+银行活期存款利率（税后）*5%</p>
<p>风险收益特征</p>	<p>本基金是股票指数增强型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场</p>

	<p>基金。</p> <p>本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，跟踪中证1000指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。</p>	
<p>下属分级基金的风险收益特征</p>	<p>本基金是股票指数增强型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。</p> <p>本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，跟踪中证1000指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。</p>	<p>本基金是股票指数增强型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。</p> <p>本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，跟踪中证1000指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似。</p>

### 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		财通基金管理有限公司	广发证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	方斌	罗琦
	联系电话	021-20537888	020-66338888
	电子邮箱	service@ctfund.com	gzluoqi@gf.com.cn
客户服务电话		400-820-9888	95575
传真		021-68888169	020-87553363-6847
注册地址		上海市虹口区吴淞路619号505室	广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街2号618室
办公地址		上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心43/45楼	广州市天河区马场路26号广发证券大厦34楼
邮政编码		200120	510627
法定代表人		吴林惠	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	www.ctfund.com
基金中期报告备置地点	基金管理人和基金托管人办公地址

### 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	财通基金管理有限公司	上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心43/45楼

## §3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2024年01月01日-2024年06月30日)	
	财通中证1000指数 增强A	财通中证1000指数 增强C
本期已实现收益	-7,491,192.31	-21,478,045.78
本期利润	-8,938,879.93	-26,918,324.73
加权平均基金份额本期利润	-0.1223	-0.1340
本期加权平均净值利润率	-13.41%	-14.71%
本期基金份额净值增长率	-10.26%	-10.45%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2024年06月30日)	
期末可供分配利润	-6,699,941.03	-23,900,792.52
期末可供分配基金份额利润	-0.1258	-0.1281
期末基金资产净值	46,547,640.51	162,705,480.43
期末基金份额净值	0.8742	0.8719

3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2024年06月30日)	
	基金份额累计净值增长率	-12.58%

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

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

(3)期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数（为期末余额，不是当期发生数）。

### 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

财通中证1000指数增强A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-6.60%	1.24%	-8.15%	1.36%	1.55%	-0.12%
过去三个月	-5.27%	1.33%	-9.51%	1.42%	4.24%	-0.09%
过去六个月	-10.26%	1.78%	-15.97%	1.87%	5.71%	-0.09%
自基金合同生效起至今	-12.58%	1.58%	-18.70%	1.68%	6.12%	-0.10%

财通中证1000指数增强C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-6.64%	1.24%	-8.15%	1.36%	1.51%	-0.12%
过去三个月	-5.36%	1.33%	-9.51%	1.42%	4.15%	-0.09%
过去六个月	-10.45%	1.79%	-15.97%	1.87%	5.52%	-0.08%
自基金合同	-12.81%	1.58%	-18.70%	1.68%	5.89%	-0.10%

生效起至今						
-------	--	--	--	--	--	--

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

(2)本基金业绩比较基准为：中证1000指数收益率\*95%+银行活期存款利率（税后）\*5%。

### 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

财通中证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  
(2023年11月07日-2024年06月30日)



财通中证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  
(2023年11月07日-2024年06月30日)



注：(1)本基金合同生效日为2023年11月7日，本基金合同生效起至报告期末不满一年；

(2)本基金建仓期是合同生效日起6个月，截至报告期末和建仓期末，本基金的资产配置符合基金契约的相关要求。

## §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

财通基金管理有限公司（下称“财通基金”）经中国证监会批准，于2011年6月正式成立。目前公司拥有公募基金管理、特定客户资产管理、QDII、受托管理保险资金投资管理等业务资格。公司股东为财通证券股份有限公司、杭州市实业投资集团有限公司和浙江亨通控股股份有限公司，注册资本2亿元人民币，注册地上海。成立近13年来，公司收获了“三大报”权威奖项（金牛奖+金基金奖+明星基金奖），先后荣获110余项业内权威大奖。

截至2024年6月末，财通基金合计管理规模约1,267.14亿元，其中，公募基金管理规模约921.26亿元。公司以打造“特色鲜明、多元发展、客户信赖”的一流资产管理公司为企业愿景，坚持多元化业务布局，旗下公募基金覆盖股票、混合、债券、指数、货币等完整产品线，可满足不同类型客户的多元化需求。同时公司在专户业务中勇于突破，不断探索定增+、固收+、量化+等特色领域，努力以专业创造价值。

财通基金始终恪守“敬畏、感恩、专业、责任”的核心价值观，坚信投研是核心竞争力，为客户创造收益才是硬道理。公司以资产管理为本源，坚守初心、苦练内功，配备了一支资深投研专家团队，纵深一级半、二级市场，持续为投资者创造价值。

#### 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		
郭欣	本基金的基金经理	2024-03-08	-	10年	上海财经大学概率论与数理统计硕士。历任诺德基金管理有限公司研究员，上海翼丰投资管理有限公司量化研究员。2017年11月加入财通基金管理有限公司，曾任量化投资部研究员、投资

					经理助理、投资经理，现任 量化投资部基金经理。
--	--	--	--	--	----------------------------

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

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

(3)证券从业的含义遵从法律法规及行业协会的相关规定。

#### 4.1.3 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

无。

#### 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销售机构监督管理办法》《公开募集证券投资基金运作管理办法》《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》、基金合同和其他有关法律法规、监管部门的相关规定，依照诚实信用、勤勉尽责、安全高效的原则管理和运用基金资产，在认真控制投资风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益，没有发生损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人以价值投资为理念，致力于建设合理的组织架构和科学的投资决策体系，营造公平交易的执行环境。公司通过严格的内控制度和授权体系，确保投资、研究、交易等各个环节的独立性。公司将投资管理职能和交易执行职能相隔离，实行集中交易，并建立了公平的交易分配制度，确保在场内、场外各类交易中，各投资组合都享有公平的交易执行机会。

同时，公司逐步建立健全公司各投资组合均可参考的投资对象备选库和交易对手备选库，在此平台上共享研究成果，并对各组合提供无倾向性支持；在公用备选库的基础上，各投资组合经理根据不同投资组合的投资目标、投资风格、投资范围和关联交易限制等，建立不同投资组合的投资对象备选库和交易对手备选库，进而根据投资授权构建具体的投资组合。在确保投资组合间信息隔离、权限明晰的基础上，形成信息公开、资源共享的公平投资管理环境。

公司建立了专门的公平交易制度，并在交易系统中适当启用公平交易模块，保证公平交易的严格执行。对异常交易的监控包括事前、事中和事后等环节，特殊情况会经过

严格的报告和审批程序，会定期针对旗下所有组合的交易记录进行了交易时机和价差的专项统计分析，以排查异常交易。

报告期内，本基金管理人严格执行了《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和《财通基金管理有限公司公平交易管理办法》的规定，未发现组合间存在违背公平交易原则的行为或异常交易行为。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本投资组合为指数增强型开放式基金。本报告期内，本投资组合的主动型投资部分与本公司管理的其他主动型投资组合未发生过同日反向交易的情况，也未发生影响市场价格的临近日同向或反向交易。

经过事前制度约束、事中严密监控，以及事后的统计排查，本报告期内各笔交易的市场成交比例、成交均价等交易结果数据表明，本期基金运作未对市场产生有违公允性的影响，亦未发现本基金存在异常交易行为。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，本基金组合采用类行业中性配置，力争控制行业暴露在较低范围之内，同时控制组合相对市场主流风格如大小盘、价值、成长等的暴露，采用量化模型在行业内优选个股，分散持仓，力争获得相对业绩基准的长期的超额收益，此外积极参与新股申购，进一步增强组合相对于业绩基准的阿尔法。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末，财通中证1000指数增强A基金份额净值为0.8742元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-10.26%，同期业绩比较基准收益率为-15.97%；截至报告期末，财通中证1000指数增强C基金份额净值为0.8719元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为-10.45%，同期业绩比较基准收益率为-15.97%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

回顾2024年上半年，国内宏观经济依旧维持弱复苏态势，但动能有所衰弱。3月份开始，信贷脉冲持续走弱，背后一方面是私人部门需求疲软，个人和企业信贷乏力。另一方面，今年财政节奏偏缓，实物工作开展进度偏慢。除此之外，M1和M2剪刀差持续收敛，其中有取消“手工补息”监管的影响，但也有实体微观活力不足的隐忧。从PMI来看，信贷下滑的结果是5、6月份连续两个月略弱于预期的经济扩张幅度。“供强需弱”格局下，今年二季度，国内CPI、PPI整体小幅回升，但“回升”斜率并不陡峭，企业盈利改善较难“一蹴而就”。



海外方面，今年以来市场反复博弈美联储是否会提前降息，但目前美国经济数据依旧不弱，6月份议息会议基本确认美联储将继续维持“Higher for Longer”的货币政策导向。与此同时，近期美国大选风险逐渐进入视野，我们认为这使得短期内美债利率或将继续维持高位。对于国内而言，货币政策在需求走弱的环境下，虽有加码必要，但考虑到内外息差下汇率承压，加之“资金防空转”导向下，我们认为货币政策上进行价格型调控的空间相对有限，结构性货币政策在未来一段时间内或将仍是调控主线。

经济目前仍在持续复苏的脉络上，展望下半年宏观基本面，市场风险与机遇并存。机遇方面，国内政策层面大概率不会“大水漫灌”，而是继续以“固本培元”稳增长为主。我们认为可能的主线有两条：一是专项债发行节奏能否提速，进而形成有效实物工作量，二是“两会”提出的“新质生产力”相关扶持政策辐射范围能否进一步扩增。除此之外，如果海外增长超预期，或美联储超预期提前降息，海外金融条件将有望进一步放松，从而为国内货币政策提供更多空间。风险方面，下半年海外经济增速的放缓和地缘政治摩擦或将通过出口链给国内增长带来一定压力。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

根据《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》《关于固定收益品种的估值处理标准》《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》《资产管理产品相关会计处理规定》等法律法规、自律规则，公司设立估值委员会并制定估值委员会议事规则。

估值委员会成员由常设委员和非常设委员组成。常设委员为委员会会议必然参会人员，非常设委员根据审议议题邀请参会。常设委员包括总经理、督察长、基金清算部门分管领导、风险管理部负责人、法律合规部负责人、基金清算部负责人；非常设委员为会议议题涉及的投资组合经理和研究人员及其所在部门负责人、分管领导，在每次会议召集时确定。估值委员会成员均具有会计核算经验、行业分析经验、金融工具应用、风险管理等丰富的证券投资基金行业从业经验和专业能力。如果基金经理认为某证券有更能准确反应其公允价值的估值方法，可以向估值委员会申请对其进行专项评估。新的证券价格需经估值委员会和托管人同意后才能采纳，否则不改变用来进行证券估值的初始价格。

估值委员会职责：根据相关估值原则研究相关估值政策和估值模型，拟定公司的估值政策、估值方法和估值程序、确定调整/暂停估值方案，确保公司各基金产品净值计算的公允性，以维护广大投资者的利益。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金《基金合同》约定：在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准。

本报告期内本基金未进行过利润分配。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

报告期内，本基金未有连续20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5000万元的情况出现。

### §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，本基金托管人在对财通中证1000指数增强型证券投资基金的托管过程中，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，财通基金管理有限公司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财通基金管理有限公司编制和披露的财通中证1000指数增强型证券投资基金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：财通中证1000指数增强型证券投资基金

报告截止日：2024年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日

<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	11,779,118.69	33,131,351.15
结算备付金		4,334,414.28	1,382,304.84
存出保证金		798,052.80	1,947,936.00
交易性金融资产	6.4.7.2	190,118,006.57	302,672,003.15
其中：股票投资		190,118,006.57	302,672,003.15
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	-	-
应收清算款		650,000.70	1,656,254.88
应收股利		-	-
应收申购款		2,205,451.63	260,834.39
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		209,885,044.67	341,050,684.41
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024年06月30日</b>	<b>上年度末 2023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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		335,156.16	-
应付管理人报酬		139,817.62	231,438.59
应付托管费		26,215.83	43,394.72

应付销售服务费		53,560.26	84,463.31
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	77,173.86	30,000.00
负债合计		631,923.73	389,296.62
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	239,853,854.49	349,821,354.28
未分配利润	6.4.7.8	-30,600,733.55	-9,159,966.49
净资产合计		209,253,120.94	340,661,387.79
负债和净资产总计		209,885,044.67	341,050,684.41

注：报告截止日2024年6月30日，基金份额总额239,853,854.49份，其中A类基金份额净值0.8742元，份额总额53,247,581.54份；C类基金份额净值0.8719元，份额总额186,606,272.95份。

## 6.2 利润表

会计主体：财通中证1000指数增强型证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年01月01日至2024年0 6月30日
一、营业总收入		-34,233,554.18
1.利息收入		79,465.72
其中：存款利息收入	6.4.7.9	79,465.72
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-27,509,823.03
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-28,312,100.75

基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	-
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.12	-1,656,588.23
股利收益	6.4.7.13	2,458,865.95
其他投资收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.14	-6,887,966.57
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.15	84,769.70
<b>减：二、营业总支出</b>		1,623,650.48
1.管理人报酬	6.4.10.2.1	995,341.46
2.托管费	6.4.10.2.2	186,626.51
3.销售服务费	6.4.10.2.3	364,605.51
4.投资顾问费		-
5.利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6.信用减值损失	6.4.7.16	-
7.税金及附加		-
8.其他费用	6.4.7.17	77,077.00
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-35,857,204.66
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-35,857,204.66
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-
<b>六、综合收益总额</b>		-35,857,204.66

注：本基金基金合同于2023年11月7日生效，故无比较式的上年度数据。

### 6.3 净资产变动表

会计主体：财通中证1000指数增强型证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	349,821,354.28	-9,159,966.49	340,661,387.79
二、本期期初净资产	349,821,354.28	-9,159,966.49	340,661,387.79
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-109,967,499.79	-21,440,767.06	-131,408,266.85
（一）、综合收益总额	-	-35,857,204.66	-35,857,204.66
（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）	-109,967,499.79	14,416,437.60	-95,551,062.19
其中：1.基金申购款	90,729,891.12	-6,465,076.28	84,264,814.84
2.基金赎回款	-200,697,390.91	20,881,513.88	-179,815,877.03
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	239,853,854.49	-30,600,733.55	209,253,120.94

注：本基金基金合同于2023年11月7日生效，故无比较式的上年度数据。

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：

徐春庭

刘为臻

刘为臻

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

财通中证1000指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”），系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[2023]1760号《关于准予财通中证1000指数增强型证券投资基金注册的批复》准予注册，由基金管理人财通基金管理有限公司向社会公开发行人募集，基金合同于2023年11月7日生效，首次设立募集规模为348,941,536.57份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人及注册登记机构为财通基金管理有限公司，基金托管人为广发证券股份有限公司。

本基金根据销售费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别，分别设置代码、分别计算和公告基金份额净值和基金份额累计净值。在投资者认购、申购时收取认购、申购费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为A类基金份额；在投资人认购、申购时不收取认购、申购费用，而从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为C类基金份额。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，以标的指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。其他包括国内依法发行上市的股票（包括主板、创业板、科创板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、债券（含国债、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、政府支持债券、地方政府债、可转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、银行存款（包括定期存款、协议存款、通知存款等）、同业存单、货币市场工具、股指期货、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。

基金的投资组合比例为：股票（含存托凭证）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股和备选成份股占非现金基金资产的比例不低于80%。每个交易日日终，在扣除股指期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的比例限制，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%+银行活期存款利率（税后）\*5%。

### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

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

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注6.4.2中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定要求,真实、完整地反映了本基金2024年6月30日的财务状况、自2024年1月1日起至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

#### 6.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为自2024年1月1日起至2024年6月30日止。

#### 6.4.4.2 记账本位币

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

#### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (a) 金融资产的分类

本基金的金融工具包括股票投资、债券投资、买入返售金融资产等。

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

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

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

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



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

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

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

**(b) 金融负债的分类**

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

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

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

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

**6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认**

**(a) 金融工具的初始确认**

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

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

**(b) 后续计量**

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

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

- 以摊余成本计量的金融资产

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

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

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

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

#### (c) 金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；

- 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；

- 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

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

- 所转移金融资产在终止确认日的账面价值；

- 因转移金融资产而收到的对价。

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

#### (d) 金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

- 以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

预期信用损失的计量

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

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

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

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

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

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

预期信用损失准备的列报

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

核销

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

已减记的金融资产以后又收回的,作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外,本基金按下述原则计量公允价值:

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

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

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

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

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

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

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

#### 6.4.4.7 实收基金

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

#### 6.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

#### 6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

投资收益

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

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

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

#### 公允价值变动收益

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

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、销售服务费和托管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。

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若基金合同生效不满3个月可不进行收益分配。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对应类别的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；基金份额持有人可对A类和C类基金份额选择不同的分红方式；同一投资人持有的同一类别的基金份额只能选择一种分红方式，如投资人在不同销售机构选择的分红方式不同，则基金份额登记机构将以投资人最后一次选择的分红方式为准。基金收益分配后任一类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的任一类基金份额净值减去该类每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。本基金各基金份额类别在费用收取上不同，其对应的可分配收益可能有所不同。同一类别的每一基金份额享有同等分配权。

#### 6.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

编制财务报表时，本基金需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入和支出的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本基金

对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

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

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

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

#### **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**

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

##### **6.4.5.2 会计估计变更的说明**

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

##### **6.4.5.3 差错更正的说明**

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

#### **6.4.6 税项**

根据财税[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[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《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》、深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《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[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《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号文《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号文《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》、财政部 税务总局公告2024年第8号《关于延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》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

a) 资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以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。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

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

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

c) 对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）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。

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。

d) 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。自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

e) 对基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日
----	--------------------

活期存款	3,628,234.12
等于：本金	3,626,275.01
加：应计利息	1,959.11
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	8,150,884.57
等于：本金	8,150,352.13
加：应计利息	532.44
减：坏账准备	-
合计	11,779,118.69

注：其他存款本期末余额为存放在证券经纪商基金专用证券账户的证券交易结算资金。

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	202,604,128.70	-	190,118,006.57	-12,486,122.13
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	202,604,128.70	-	190,118,006.57	-12,486,122.13

**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**

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	7,307,306.67	-	-	-
--股指期货	7,307,306.67	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	7,307,306.67	-	-	-

**6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况**

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IM2409	中证1000股指期货 2409合约	1.00	956,040.00	-63,560.00
IM2407	中证1000股指期货 2407合约	2.00	1,943,200.00	-106,480.00
IM2412	中证1000股指期货 2412合约	4.00	3,751,200.00	-486,826.67
合计				-656,866.67
减：可抵销 期货暂收 款				-656,866.67
净额				-

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为0。

**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**

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

**6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券**

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

**6.4.7.5 其他资产**

本基金本报告期末未持有其他资产。

**6.4.7.6 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06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	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	77,077.00
其他应付	96.86
合计	77,173.86

**6.4.7.7 实收基金**

**6.4.7.7.1 财通中证1000指数增强A**

金额单位：人民币元

项目	本期
----	----

(财通中证1000指数增强A)	2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	94,405,626.26	94,405,626.26
本期申购	7,620,098.47	7,620,098.47
本期赎回（以“-”号填列）	-48,778,143.19	-48,778,143.19
本期末	53,247,581.54	53,247,581.54

#### 6.4.7.7.2 财通中证1000指数增强C

金额单位：人民币元

项目 (财通中证1000指数增强C)	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	255,415,728.02	255,415,728.02
本期申购	83,109,792.65	83,109,792.65
本期赎回（以“-”号填列）	-151,919,247.72	-151,919,247.72
本期末	186,606,272.95	186,606,272.95

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.8 未分配利润

##### 6.4.7.8.1 财通中证1000指数增强A

单位：人民币元

项目 (财通中证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	-736,262.63	-1,695,972.83	-2,432,235.46
本期期初	-736,262.63	-1,695,972.83	-2,432,235.46
本期利润	-7,491,192.31	-1,447,687.62	-8,938,879.93
本期基金份额交易产生的变动数	3,826,472.39	844,701.97	4,671,174.36
其中：基金申购款	-460,311.41	-56,186.45	-516,497.86
基金赎回款	4,286,783.80	900,888.42	5,187,672.22
本期已分配利润	-	-	-

本期末	-4,400,982.55	-2,298,958.48	-6,699,941.03
-----	---------------	---------------	---------------

**6.4.7.8.2 财通中证1000指数增强C**

单位：人民币元

项目 (财通中证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	-2,140,103.62	-4,587,627.41	-6,727,731.03
本期期初	-2,140,103.62	-4,587,627.41	-6,727,731.03
本期利润	-21,478,045.78	-5,440,278.95	-26,918,324.73
本期基金份额交易产生的变动数	7,760,358.83	1,984,904.41	9,745,263.24
其中：基金申购款	-5,836,564.92	-112,013.50	-5,948,578.42
基金赎回款	13,596,923.75	2,096,917.91	15,693,841.66
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-15,857,790.57	-8,043,001.95	-23,900,792.52

**6.4.7.9 存款利息收入**

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
活期存款利息收入	61,723.10
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	17,707.27
结算备付金利息收入	-
其他	35.35
合计	79,465.72

**6.4.7.10 股票投资收益**

**6.4.7.10.1 股票投资收益——买卖股票差价收入**

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2024年01月01日至2024年06月30日
卖出股票成交总额	1,135,251,504.53
减：卖出股票成本总额	1,161,277,245.18
减：交易费用	2,286,360.10
买卖股票差价收入	-28,312,100.75

**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**

本基金本报告期未有债券投资收益。

**6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

本基金本报告期未有债券买卖差价收入。

**6.4.7.11.3 债券投资收益——赎回差价收入**

本基金本报告期未有债券赎回差价收入。

**6.4.7.11.4 债券投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期未有债券申购差价收入。

**6.4.7.12 衍生工具收益**

**6.4.7.12.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期无衍生工具收益--买卖权证差价收入。

**6.4.7.12.2 衍生工具收益——其他投资收益**

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
期货投资	-1,656,588.23

**6.4.7.13 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
股票投资产生的股利收益	2,458,865.95

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	2,458,865.95

#### 6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
1.交易性金融资产	-6,346,781.04
——股票投资	-6,346,781.04
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-541,185.53
——权证投资	-
——期货投资	-541,185.53
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-6,887,966.57

#### 6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
基金赎回费收入	84,299.58
转换费收入	470.12
合计	84,769.70

#### 6.4.7.16 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

**6.4.7.17 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
审计费用	17,404.66
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
合计	77,077.00

**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，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

**6.4.8.2 资产负债表日后事项**

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

**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
财通基金管理有限公司（“财通基金”）	基金管理人、基金销售机构
财通证券股份有限公司（“财通证券”）	基金管理人的股东、基金代销机构
广发证券股份有限公司（“广发证券”）	基金托管人、基金代销机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

**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01月01日至2024年06月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
广发证券	703,195,738.98	32.26%
财通证券	31,016,578.34	1.42%

**6.4.10.1.2 权证交易**

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

**6.4.10.1.3 债券交易**

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

**6.4.10.1.4 债券回购交易**

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

**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01月01日至2024年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券	496,421.83	31.45%	-	-
财通证券	22,893.52	1.45%	-	-

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)本基金管理人在《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》（以下简称“佣金新规”）施行日前已与相关券商按佣金新规的要求更新相关服务协议，协议生效日前本基金管理人在租用证券交易专用交易单元进行股票、债券、权证及回购交易的同时，还获得证券研究综合服务，自协议生效日起，本基金管理人不再获得证券研究综合服务。

**6.4.10.2 关联方报酬**



**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	995,341.46
其中：应支付销售机构的客户维护费	405,337.13
应支付基金管理人的净管理费	590,004.33

注：(1)支付基金管理人的基金管理费按前一日基金资产净值的0.80%年费率计提，每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付；

(2)基金管理费计算公式为：日基金管理费=前一日基金资产净值×0.80%/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01月01日至2024年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	186,626.51

注：(1)支付基金托管人的基金托管费按前一日基金资产净值的0.15%年费率计提，每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付；

(2)基金托管费计算公式为：日基金托管费=前一日基金资产净值×0.15%/当年天数。

**6.4.10.2.3 销售服务费**

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2024年01月01日至2024年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	财通中证1000指数增强A	财通中证1000指数增强C	合计
财通证券	0.00	9,058.33	9,058.33
广发证券	0.00	149,030.27	149,030.27
合计	0.00	158,088.60	158,088.60

注：(1)本基金A类基金份额不收取销售服务费；

(2)本基金C类基金份额销售服务费按C类基金份额前一日基金资产净值的0.40%年费率计提，每日计提，逐日累计至每月月末，按月支付；

(3)本基金C类基金份额销售服务费的计算公式为：每日应计提的销售服务费=C类基金份额前一日基金资产净值×0.40%/当年天数。

**6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

本基金本报告期末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**  
无。

**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**

无。

**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固有资金投资本基金的情况**

本基金的基金管理人本报告期末运用固有资金投资本基金。

**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**

本基金除基金管理人之外的其他关联方于本报告期末及上年度末均未投资本基金。

**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01月01日至2024年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
广发证券	2,567,860.08	6,840.72
财通证券	1,133,385.85	2,848.80

**6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期末在承销期内直接购入关联方承销的证券。

**6.4.10.8 其他关联交易事项的说明**

**6.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明**

本基金本报告期无其他关联交易事项的说明。

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

本基金本报告期无其他当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用。

**6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金**

本基金本报告期未进行利润分配。

**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
600773	西藏城投	2024-04-08	6个月	非公开发行流通受限	7.58	9.85	104,222	790,002.76	1,026,586.70	-
300659	中孚信息	2024-03-28	6个月	非公开发行流通受限	14.49	12.12	71,084	1,030,007.16	861,538.08	-
300612	宣亚国际	2024-03-22	6个月	非公开发行流通受限	14.00	12.19	67,857	949,998.00	827,176.83	-
603520	司太立	2024-06-14	6个月	非公开发行流通受限	9.75	8.80	89,231	870,002.25	785,232.80	-
688512	慧智微	2024-06-19	6个月	询价转让流通受限	7.68	7.54	86,000	660,480.00	648,440.00	-
000926	福星股份	2024-01-18	6个月	非公开发行流通受限	3.64	3.11	206,044	750,000.16	640,796.84	-

600792	云煤能源	2024-04-26	6个月	非公开发行流通受限	3.65	3.12	197,350	720,327.50	615,732.00	-
300565	科信技术	2024-01-25	6个月	非公开发行流通受限	12.56	9.76	55,732	699,993.92	543,944.32	-
688175	高凌信息	2024-06-24	6个月	询价转让流通受限	13.06	13.23	39,241	512,487.46	519,158.43	-
603185	弘元绿能	2024-02-01	6个月	非公开发行流通受限	25.22	16.71	28,945	729,992.90	483,670.95	-
300305	裕兴股份	2024-01-25	6个月	非公开发行流通受限	8.01	5.47	81,148	649,995.48	443,879.56	-
300619	金银河	2023-12-28	6个月	非公开发行流通受限	46.16	24.24	14,081	649,978.96	341,323.44	-
688707	振华新材	2024-01-17	6个月	非公开发行流通受限	16.60	9.56	31,928	530,004.80	305,231.68	-
003038	鑫铂股份	2024-01-16	6个月	非公开发行流通受限	27.92	14.43	13,476	376,249.92	194,458.68	-
301589	诺瓦星云	2024-02-01	6个月	新股限售	126.89	188.01	395	50,121.55	74,263.95	-
603350	安乃达	2024-06-26	1个月内(含)	认购新发证券	20.56	20.56	945	19,429.20	19,429.20	-
603285	键邦股份	2024-06-28	1个月内(含)	认购新发证券	18.65	18.65	926	17,269.90	17,269.90	-
3015	星辰	2024	6个月	新股限售	16.1	32.2	428	6,91	13,8	-

36	科技	-03-20		售	6	7		6.48	11.56	
301538	骏鼎达	2024-03-13	6个月	新股限售	55.82	91.24	107	5,972.74	9,762.68	-
688692	达梦数据	2024-06-04	6个月	新股限售	86.96	174.93	77	6,695.92	13,469.61	-
688709	成都华微	2024-01-31	6个月	新股限售	15.69	18.79	575	9,021.75	10,804.25	-
688691	灿芯股份	2024-04-02	6个月	新股限售	19.86	42.51	238	4,726.68	10,117.38	-
301392	汇成真空	2024-05-28	6个月	新股限售	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-
301565	中仑新材	2024-06-13	6个月	新股限售	11.88	18.98	464	5,512.32	8,806.72	-
301580	爱迪特	2024-06-19	6个月	新股限售	44.95	65.93	132	5,933.40	8,702.76	-
301591	肯特股份	2024-02-20	6个月	新股限售	19.43	36.98	219	4,255.17	8,098.62	-
301587	中瑞股份	2024-03-27	6个月	新股限售	21.73	25.26	306	6,649.38	7,729.56	-
688584	上海合晶	2024-02-01	6个月	新股限售	22.66	15.89	453	10,264.98	7,198.17	-
601033	永兴股份	2024-01-11	6个月	新股限售	16.20	15.96	436	7,063.20	6,958.56	-
001389	广合科技	2024-03-2	6个月	新股限售	17.43	34.56	197	3,433.71	6,808.32	-

		6								
688695	中创股份	2024-03-06	6个月	新股限售	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-
688530	欧莱新材	2024-04-29	6个月	新股限售	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-
301588	美新科技	2024-03-06	6个月	新股限售	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-
301502	华阳智能	2024-01-26	6个月	新股限售	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-
603341	龙旗科技	2024-02-23	6个月	新股限售	26.00	37.49	139	3,614.00	5,211.11	-
603325	博隆技术	2024-01-03	6个月	新股限售	72.46	68.06	52	3,767.92	3,539.12	-
603082	北自科技	2024-01-23	6个月	新股限售	21.28	29.49	107	2,276.96	3,155.43	-
603312	西典新能	2024-01-04	6个月	新股限售	29.02	25.36	124	3,598.48	3,144.64	-
603344	星德胜	2024-03-13	6个月	新股限售	19.18	22.66	138	2,646.84	3,127.08	-
001359	平安电工	2024-03-19	6个月	新股限售	17.39	20.60	146	2,538.94	3,007.60	-
603375	盛景微	2024-01-17	6个月	新股限售	38.18	38.90	72	2,748.96	2,800.80	-
001387	雪祺电气	2024-01-04	6个月	新股限售	15.38	15.25	133	2,045.54	2,028.25	-

603381	永臻股份	2024-06-19	6个月	新股限售	23.35	25.13	85	1,984.75	2,136.05	-
301589	诺瓦星云	2024-05-30	1-6个月(含)	新股限售-送股	-	188.01	316	-	59,411.16	-
301538	骏鼎达	2024-05-22	1-6个月(含)	新股限售-送股	-	91.24	42	-	3,832.08	-
001387	雪祺电气	2024-06-03	1-6个月(含)	新股限售-送股	-	15.25	40	-	610.00	-
300619	金银河	2024-06-14	1个月内(含)	非公开发行流通受限-送股	-	24.24	4,224	-	102,389.76	-
003038	鑫铂股份	2024-05-29	1-6个月(含)	非公开发行流通受限-送股	-	14.43	5,390	-	77,777.70	-
603350	安乃达	2024-06-26	6个月	新股限售	20.56	20.56	106	2,179.36	2,179.36	-
603285	键邦股份	2024-06-28	6个月	新股限售	18.65	18.65	103	1,920.95	1,920.95	-

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

002 288	*S T超 华	202 4-0 6-2 7	收 盘 价 连 续2 0个 交 易 日 低 于1 元	-	-	-	56,400	129,434.00	-	-
------------	---------------	------------------------	---	---	---	---	--------	------------	---	---

### 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

本基金本报告期末未持有因银行间市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末未持有因交易所市场债券正回购交易而作为抵押的债券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的管理人进行风险管理的主要目标是加强对投资风险的控制和防范，保证基金资产的安全，维护基金份额持有人的利益；同时，提升基金投资组合的风险调整后收益水平，将以上各种风险控制在限定的范围之内，在基金的风险和收益之间取得最佳的平衡，实现“风险和收益相匹配”的投资目标，谋求基金资产的长期稳定增长。

本基金的基金管理人建立了董事会领导下的架构清晰、控制有效、系统全面、切实可行的风险控制体系。董事会下设合规控制委员会，负责对公司风险管理战略和政策、内部控制及风险控制基本制度进行审定，对基本制度的执行情况、关联交易的合法合规性等进行监督和检查。董事会聘任督察长，负责公司及其基金运作的监察稽核工作。公司经营管理层负责公司日常经营管理中的风险控制工作，经营管理层下设投资决策委员会和风险控制委员会，负责对公司经营及基金运作中的风险进行研究、评估和防控。公司各业务部门根据具体情况制定本部门的作业流程及风险控制制度，加强对风险的控



制，作为一线责任人，将风险控制在最小范围内。同时，公司设独立的法律合规部和风险管理部，两者依各自职能对公司运作各环节的各类风险进行监控。

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分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。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。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### **6.4.13.2 信用风险**

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，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建立了信用风险管理流程，通过对各类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，建立相应的分级别的交易对手库，并分别限定交易额度，同时采取一定的风险缓释措施。本基金的银行存款通过本基金的托管人存放在交通银行股份有限公司，还有部分存款存放在开立于本基金的结算机构财通证券、中信建投证券和广发证券的证券账户内，按银行同业利率计息，与该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均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，违约风险可能性很小；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、对手授信额度、价格偏离等方面进行限制以控制相应的信用风险。

#### **6.4.13.3 流动性风险**

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。

##### **6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析**

本基金的基金管理人严格按照《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》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

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，并对基金组合资产中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超过7个工作日可变现资产的可变现价值，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带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持大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，因此除在附注6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能及时变现。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资产的公允价值。

本基金本报告期末及上年度末均无重大流动性风险。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。本基金持有的利率敏感性资产主要为货币资金，结算备付金等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年06月30	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
-------------------	-------	-------	--------	------	------	-----	----

日							
资产							
货币 资金	11,779,118.6 9	-	-	-	-	-	11,779,118.69
结算 备付 金	4,334,414.28	-	-	-	-	-	4,334,414.28
存出 保证 金	798,052.80	-	-	-	-	-	798,052.80
交易 性金 融资 产	-	-	-	-	-	190,118,006.5 7	190,118,006.5 7
应收 清算 款	-	-	-	-	-	650,000.70	650,000.70
应收 申购 款	-	-	-	-	-	2,205,451.63	2,205,451.63
资产 总计	16,911,585.7 7	-	-	-	-	192,973,458.9 0	209,885,044.6 7
负债							
应付 赎回 款	-	-	-	-	-	335,156.16	335,156.16
应付 管理 人报 酬	-	-	-	-	-	139,817.62	139,817.62
应付 托管 费	-	-	-	-	-	26,215.83	26,215.83

应付销售服务费	-	-	-	-	-	53,560.26	53,560.26
其他负债	-	-	-	-	-	77,173.86	77,173.86
负债总计	-	-	-	-	-	631,923.73	631,923.73
利率敏感度缺口	16,911,585.77	-	-	-	-	192,341,535.17	209,253,120.94
上年度末2023年12月31日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
货币资金	33,131,351.15	-	-	-	-	-	33,131,351.15
结算备付金	1,382,304.84	-	-	-	-	-	1,382,304.84
存出保证金	1,947,936.00	-	-	-	-	-	1,947,936.00
交易性金融资产	-	-	-	-	-	302,672,003.15	302,672,003.15
应收清算	-	-	-	-	-	1,656,254.88	1,656,254.88

款							
应收 申购 款	-	-	-	-	-	260,834.39	260,834.39
资产 总计	36,461,591.9 9	-	-	-	-	304,589,092.4 2	341,050,684.4 1
负债							
应付 管理 人报 酬	-	-	-	-	-	231,438.59	231,438.59
应付 托管 费	-	-	-	-	-	43,394.72	43,394.72
应付 销售 服务 费	-	-	-	-	-	84,463.31	84,463.31
其他 负债	-	-	-	-	-	30,000.00	30,000.00
负债 总计	-	-	-	-	-	389,296.62	389,296.62
利率 敏感 度缺 口	36,461,591.9 9	-	-	-	-	304,199,795.8 0	340,661,387.7 9

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

截至报告期末，本基金无交易性债券投资，因此利率风险因素对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险主要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证券市场的整体波动，以及单个证券发行主体的自身经营情况或特殊事件影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，以价值投资为核心，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中，股票（含存托凭证）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股和备选成份股占非现金基金资产的比例不低于80%。每个交易日日终，在扣除股指期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，保持不低于基金资产净值5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日		上年度末 2023年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	190,118,006.57	90.86	302,672,003.15	88.85
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资	-	-	-	-

产—债券投资				
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	190,118,006.57	90.86	302,672,003.15	88.85

**6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析**

假设	1.基金的市场价格风险决定于基金相对其业绩比较基准的贝塔系数，以及业绩比较基准的变动。		
	2.除业绩比较基准变动外，其他影响基金资产净值的风险变量保持不变。		
	3.贝塔系数的估计以过去一年的历史数据作为样本，采用线性回归法估计。		
	4.业绩比较基准的变动对基金的净值表现具有对称性影响。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位：人民币元)	
		本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
	业绩比较基准增加1%	1,933,624.92	2,396,836.47
	业绩比较基准减少1%	-1,933,624.92	-2,396,836.47

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

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

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

第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

**6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具**

**6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值**

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	181,350,121.90	300,208,809.23
第二层次	36,699.10	-
第三层次	8,731,185.57	2,463,193.92
合计	190,118,006.57	302,672,003.15

**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。对于公开市场交易的股票、债券等投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，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投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

**6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明**

于2024年6月30日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具(2023年12月31日：无)。

**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以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

**6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项**

于2024年6月30日，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

**§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	190,118,006.57	90.58



	其中：股票	190,118,006.57	90.58
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	16,113,532.97	7.68
8	其他各项资产	3,653,505.13	1.74
9	合计	209,885,044.67	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	6,773,732.80	3.24
C	制造业	113,867,044.50	54.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,062,757.00	3.85
E	建筑业	3,319,266.00	1.59
F	批发和零售业	14,697,456.00	7.02
G	交通运输、仓储和邮政业	5,593,897.00	2.67
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,400,150.72	4.49
J	金融业	3,724,170.00	1.78
K	房地产业	1,026,586.70	0.49
L	租赁和商务服务业	4,179,219.00	2.00

M	科学研究和技术服务业	4,360.30	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	1,433,715.79	0.69
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	369,210.00	0.18
R	文化、体育和娱乐业	1,349,818.86	0.65
S	综合	-	-
	合计	173,801,384.67	83.06

### 7.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	4,437.00	0.00
C	制造业	9,186,112.61	4.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	59,696.00	0.03
E	建筑业	11,984.00	0.01
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,481,003.00	0.71
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,715,121.38	1.30
J	金融业	10,633.00	0.01
K	房地产业	973,700.84	0.47
L	租赁和商务服务业	1,049,080.83	0.50
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	4,191.24	0.00
O	居民服务、修理和其他服	-	-

	务业		
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	323,232.00	0.15
R	文化、体育和娱乐业	497,430.00	0.24
S	综合	-	-
	合计	16,316,621.90	7.80

### 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通过港股通机制投资的港股。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002267	陕天然气	427,900	3,234,924.00	1.55
2	002745	木林森	262,700	2,117,362.00	1.01
3	300783	三只松鼠	94,400	2,064,528.00	0.99
4	300679	电连技术	48,900	1,967,247.00	0.94
5	002697	红旗连锁	421,400	1,951,082.00	0.93
6	600662	外服控股	481,700	1,931,617.00	0.92
7	000543	皖能电力	216,600	1,916,910.00	0.92
8	301308	江波龙	19,300	1,828,482.00	0.87
9	300428	立中集团	95,700	1,779,063.00	0.85
10	600428	中远海特	288,300	1,764,396.00	0.84
11	600285	羚锐制药	72,800	1,762,488.00	0.84
12	002139	拓邦股份	164,300	1,744,866.00	0.83
13	002011	盾安环境	177,000	1,739,910.00	0.83
14	603583	捷昌驱动	85,000	1,732,300.00	0.83
15	002274	华昌化工	232,000	1,721,440.00	0.82
16	603328	依顿电子	217,600	1,710,336.00	0.82

17	300303	聚飞光电	349,300	1,697,598.00	0.81
18	601369	陕鼓动力	206,900	1,659,338.00	0.79
19	600586	金晶科技	281,900	1,635,020.00	0.78
20	002249	大洋电机	337,600	1,596,848.00	0.76
21	002020	京新药业	152,100	1,592,487.00	0.76
22	300451	创业慧康	456,700	1,580,182.00	0.76
23	002004	华邦健康	414,800	1,576,240.00	0.75
24	600623	华谊集团	272,100	1,572,738.00	0.75
25	000915	华特达因	52,100	1,571,336.00	0.75
26	600888	新疆众和	220,800	1,561,056.00	0.75
27	002215	诺普信	209,400	1,560,030.00	0.75
28	002891	中宠股份	74,400	1,552,728.00	0.74
29	603368	柳药集团	87,600	1,533,000.00	0.73
30	002053	云南能投	125,300	1,514,877.00	0.72
31	002978	安宁股份	54,200	1,510,012.00	0.72
32	601886	江河集团	306,400	1,495,232.00	0.71
33	603297	永新光学	24,300	1,469,907.00	0.70
34	688586	江航装备	157,501	1,464,759.30	0.70
35	601137	博威合金	94,700	1,443,228.00	0.69
36	000550	江铃汽车	66,200	1,437,202.00	0.69
37	300685	艾德生物	80,800	1,425,312.00	0.68
38	603187	海容冷链	121,700	1,419,022.00	0.68
39	300226	上海钢联	83,500	1,414,490.00	0.68
40	601609	金田股份	248,600	1,407,076.00	0.67
41	600475	华光环能	159,500	1,389,245.00	0.66
42	300857	协创数据	24,200	1,379,400.00	0.66
43	603983	丸美股份	49,600	1,365,488.00	0.65
44	002948	青岛银行	405,100	1,365,187.00	0.65
45	000034	神州数码	59,100	1,352,799.00	0.65
46	601811	新华文轩	96,000	1,344,960.00	0.64
47	601311	骆驼股份	167,400	1,342,548.00	0.64

48	600929	雪天盐业	251,700	1,334,010.00	0.64
49	600502	安徽建工	307,000	1,320,100.00	0.63
50	600033	福建高速	388,500	1,301,475.00	0.62
51	688289	圣湘生物	73,600	1,293,888.00	0.62
52	600557	康缘药业	82,300	1,292,110.00	0.62
53	002993	奥海科技	34,500	1,283,400.00	0.61
54	600750	江中药业	55,500	1,282,605.00	0.61
55	600577	精达股份	322,300	1,279,531.00	0.61
56	600966	博汇纸业	266,400	1,273,392.00	0.61
57	002727	一心堂	83,800	1,264,542.00	0.60
58	688776	国光电气	22,813	1,263,840.20	0.60
59	600267	海正药业	180,000	1,263,600.00	0.60
60	603638	艾迪精密	89,500	1,255,685.00	0.60
61	002034	旺能环境	96,400	1,254,164.00	0.60
62	002489	浙江永强	527,400	1,249,938.00	0.60
63	688408	中信博	13,500	1,243,080.00	0.59
64	688208	道通科技	51,378	1,240,264.92	0.59
65	002390	信邦制药	373,800	1,237,278.00	0.59
66	300039	上海凯宝	230,900	1,235,315.00	0.59
67	600480	凌云股份	123,400	1,213,022.00	0.58
68	300755	华致酒行	88,600	1,210,276.00	0.58
69	000969	安泰科技	151,600	1,202,188.00	0.57
70	002583	海能达	291,200	1,185,184.00	0.57
71	002171	楚江新材	178,900	1,178,951.00	0.56
72	600037	歌华有线	193,600	1,157,728.00	0.55
73	603013	亚普股份	84,500	1,138,215.00	0.54
74	000030	富奥股份	227,300	1,116,043.00	0.53
75	600717	天津港	259,300	1,107,211.00	0.53
76	002245	蔚蓝锂芯	141,000	1,092,750.00	0.52
77	688100	威胜信息	28,596	1,090,937.40	0.52
78	603299	苏盐井神	113,800	1,081,100.00	0.52

79	688128	中国电研	62,359	1,073,198.39	0.51
80	300973	立高食品	37,300	1,047,757.00	0.50
81	000758	中色股份	203,300	1,032,764.00	0.49
82	603071	物产环能	82,100	1,028,713.00	0.49
83	600908	无锡银行	193,000	1,026,760.00	0.49
84	600773	西藏城投	104,222	1,026,586.70	0.49
85	601001	晋控煤业	58,500	966,420.00	0.46
86	000528	柳工	86,000	962,340.00	0.46
87	600711	盛屯矿业	254,800	935,116.00	0.45
88	002701	奥瑞金	209,400	871,104.00	0.42
89	600273	嘉化能源	121,800	869,652.00	0.42
90	600718	东软集团	103,000	851,810.00	0.41
91	002649	博彦科技	105,400	838,984.00	0.40
92	000061	农产品	170,100	826,686.00	0.40
93	002204	大连重工	193,300	825,391.00	0.39
94	603132	金徽股份	59,300	815,968.00	0.39
95	688798	艾为电子	14,334	811,591.08	0.39
96	688050	爱博医疗	10,935	801,754.20	0.38
97	688127	蓝特光学	42,601	783,432.39	0.37
98	603025	大豪科技	56,200	776,684.00	0.37
99	002839	张家港行	190,400	765,408.00	0.37
100	688088	虹软科技	26,178	755,497.08	0.36
101	688106	金宏气体	42,454	743,794.08	0.36
102	301015	百洋医药	30,900	727,077.00	0.35
103	688686	奥普特	11,300	723,539.00	0.35
104	000811	冰轮环境	74,700	720,855.00	0.34
105	688016	心脉医疗	7,202	706,156.10	0.34
106	688232	新点软件	35,800	705,976.00	0.34
107	600971	恒源煤电	57,620	687,982.80	0.33
108	600618	氯碱化工	78,200	686,596.00	0.33
109	002990	盛视科技	33,700	678,381.00	0.32

110	002283	天润工业	157,100	673,959.00	0.32
111	300687	赛意信息	47,800	665,376.00	0.32
112	688389	普门科技	40,921	665,375.46	0.32
113	600933	爱柯迪	44,500	658,155.00	0.31
114	002516	旷达科技	180,600	657,384.00	0.31
115	600562	国睿科技	46,300	632,458.00	0.30
116	600458	时代新材	61,100	617,110.00	0.29
117	600997	开滦股份	86,900	596,134.00	0.28
118	600874	创业环保	103,600	579,124.00	0.28
119	600073	光明肉业	95,300	525,103.00	0.25
120	601101	昊华能源	54,900	504,531.00	0.24
121	600861	北京人力	30,000	489,600.00	0.23
122	688575	亚辉龙	17,700	412,764.00	0.20
123	000600	建投能源	65,300	411,390.00	0.20
124	000902	新洋丰	34,500	409,515.00	0.20
125	600916	中国黄金	42,200	405,964.00	0.19
126	688235	百济神州	3,500	405,440.00	0.19
127	000650	仁和药业	67,700	399,430.00	0.19
128	002456	欧菲光	51,100	399,091.00	0.19
129	001213	中铁特货	100,300	396,185.00	0.19
130	603393	新天然气	11,400	396,036.00	0.19
131	603128	华贸物流	68,600	395,822.00	0.19
132	300633	开立医疗	10,000	395,800.00	0.19
133	002043	兔宝宝	37,800	391,986.00	0.19
134	002214	大立科技	34,700	391,416.00	0.19
135	002550	千红制药	72,500	390,775.00	0.19
136	002746	仙坛股份	67,900	389,067.00	0.19
137	000065	北方国际	37,200	385,764.00	0.18
138	600217	中再资环	100,300	377,128.00	0.18
139	601890	亚星锚链	53,300	375,765.00	0.18
140	600688	上海石化	143,000	373,230.00	0.18

141	002991	甘源食品	6,100	369,965.00	0.18
142	002219	新里程	198,500	369,210.00	0.18
143	605333	沪光股份	13,200	367,620.00	0.18
144	300352	北信源	95,700	367,488.00	0.18
145	002946	新乳业	41,600	364,416.00	0.17
146	002434	万里扬	74,100	363,090.00	0.17
147	300446	航天智造	29,900	355,810.00	0.17
148	300953	震裕科技	6,500	352,300.00	0.17
149	300085	银之杰	43,600	352,288.00	0.17
150	300821	东岳硅材	51,000	348,840.00	0.17
151	601677	明泰铝业	30,000	346,800.00	0.17
152	301291	明阳电气	11,300	339,565.00	0.16
153	001287	中电港	20,400	337,212.00	0.16
154	002163	海南发展	61,300	335,924.00	0.16
155	603220	中贝通信	12,200	331,352.00	0.16
156	601882	海天精工	14,200	325,322.00	0.16
157	300232	洲明科技	61,800	322,596.00	0.15
158	600691	阳煤化工	188,500	322,335.00	0.15
159	603108	润达医疗	20,900	316,426.00	0.15
160	688707	振华新材	31,928	305,231.68	0.15
161	301316	慧博云通	20,700	303,876.00	0.15
162	002484	江海股份	22,900	303,425.00	0.15
163	301268	铭利达	19,300	300,115.00	0.14
164	002335	科华数据	13,300	281,029.00	0.13
165	000503	国新健康	40,300	268,801.00	0.13
166	600812	华北制药	64,300	264,916.00	0.13
167	601963	重庆银行	31,600	244,900.00	0.12
168	002901	大博医疗	9,400	242,802.00	0.12
169	002389	航天彩虹	17,100	237,519.00	0.11
170	603997	继峰股份	21,800	223,014.00	0.11
171	002088	鲁阳节能	18,100	218,829.00	0.10



172	300432	富临精工	33,400	215,096.00	0.10
173	600313	农发种业	38,300	214,097.00	0.10
174	000795	英洛华	38,500	213,290.00	0.10
175	002541	鸿路钢构	11,900	201,943.00	0.10
176	688019	安集科技	1,600	201,280.00	0.10
177	600201	生物股份	27,500	198,275.00	0.09
178	603323	苏农银行	39,300	189,033.00	0.09
179	301087	可孚医疗	5,500	186,450.00	0.09
180	300678	中科信息	6,800	180,336.00	0.09
181	002468	申通快递	21,400	179,760.00	0.09
182	600110	诺德股份	57,800	176,290.00	0.08
183	603699	纽威股份	10,100	172,912.00	0.08
184	000059	华锦股份	40,900	171,371.00	0.08
185	000762	西藏矿业	9,300	168,144.00	0.08
186	600610	中毅达	41,200	163,976.00	0.08
187	688192	迪哲医药	4,400	162,096.00	0.08
188	002782	可立克	14,200	157,336.00	0.08
189	002291	遥望科技	36,400	156,520.00	0.07
190	603678	火炬电子	6,300	155,547.00	0.07
191	002396	星网锐捷	11,500	151,915.00	0.07
192	688503	聚和材料	5,400	151,740.00	0.07
193	600216	浙江医药	13,500	148,230.00	0.07
194	688177	百奥泰	6,900	145,728.00	0.07
195	688630	芯碁微装	2,300	143,911.00	0.07
196	600667	太极实业	25,000	142,750.00	0.07
197	000901	航天科技	15,500	135,780.00	0.06
198	000582	北部湾港	18,000	133,920.00	0.06
199	603713	密尔克卫	2,500	133,800.00	0.06
200	600810	神马股份	21,500	133,300.00	0.06
201	000966	长源电力	30,000	132,300.00	0.06
202	601528	瑞丰银行	27,000	127,440.00	0.06

203	603398	沐邦高科	8,100	126,441.00	0.06
204	600508	上海能源	8,800	124,520.00	0.06
205	300034	钢研高纳	7,800	123,942.00	0.06
206	300573	兴齐眼药	740	121,360.00	0.06
207	301205	联特科技	1,900	119,225.00	0.06
208	300757	罗博特科	1,300	113,555.00	0.05
209	603871	嘉友国际	6,400	113,216.00	0.05
210	002737	葵花药业	4,300	100,534.00	0.05
211	301177	迪阿股份	5,400	100,440.00	0.05
212	002068	黑猫股份	14,100	100,110.00	0.05
213	002832	比音勒芬	4,000	96,680.00	0.05
214	600420	国药现代	8,500	90,780.00	0.04
215	600877	电科芯片	8,000	85,760.00	0.04
216	301262	海看股份	3,700	83,435.00	0.04
217	002960	青鸟消防	6,200	78,368.00	0.04
218	300183	东软载波	6,300	72,954.00	0.03
219	603008	喜临门	4,100	71,053.00	0.03
220	600559	老白干酒	3,900	70,902.00	0.03
221	600821	金开新能	12,500	64,250.00	0.03
222	002747	埃斯顿	4,400	62,568.00	0.03
223	603556	海兴电力	1,300	60,879.00	0.03
224	603281	江瀚新材	2,600	58,370.00	0.03
225	002421	达实智能	22,600	52,658.00	0.03
226	603327	福蓉科技	3,800	48,982.00	0.02
227	300101	振芯科技	3,300	48,741.00	0.02
228	002096	易普力	3,808	45,315.20	0.02
229	601033	永兴股份	2,753	44,470.79	0.02
230	002091	江苏国泰	5,800	39,498.00	0.02
231	000062	深圳华强	4,400	39,160.00	0.02
232	688278	特宝生物	652	34,914.60	0.02
233	001258	立新能源	4,600	31,878.00	0.02

234	688076	诺泰生物	400	31,312.00	0.01
235	601918	新集能源	2,900	28,275.00	0.01
236	600179	安通控股	12,000	27,960.00	0.01
237	600903	贵州燃气	4,100	25,584.00	0.01
238	688578	艾力斯	400	25,496.00	0.01
239	601068	中铝国际	6,000	25,260.00	0.01
240	600685	中船防务	900	25,110.00	0.01
241	601096	宏盛华源	5,700	23,313.00	0.01
242	603989	艾华集团	1,500	21,090.00	0.01
243	600550	保变电气	4,000	20,840.00	0.01
244	603162	海通发展	2,100	19,530.00	0.01
245	002402	和而泰	1,300	13,923.00	0.01
246	002539	云图控股	1,900	13,547.00	0.01
247	601083	锦江航运	1,400	13,384.00	0.01
248	688368	晶丰明源	241	13,351.40	0.01
249	002635	安洁科技	700	10,808.00	0.01
250	002145	中核钛白	3,200	10,496.00	0.01
251	688239	航宇科技	281	9,778.80	0.00
252	002036	联创电子	1,400	9,450.00	0.00
253	003039	顺控发展	700	8,771.00	0.00
254	600252	中恒集团	3,800	8,246.00	0.00
255	600269	赣粤高速	1,400	7,238.00	0.00
256	603083	剑桥科技	200	6,456.00	0.00
257	000927	中国铁物	2,700	6,426.00	0.00
258	688268	华特气体	106	5,470.66	0.00
259	688062	迈威生物	178	5,151.32	0.00
260	301047	义翘神州	70	4,196.50	0.00
261	603103	横店影视	300	4,152.00	0.00
262	301153	中科江南	140	3,956.40	0.00
263	001376	百通能源	200	3,724.00	0.00
264	688439	振华风光	56	3,721.20	0.00

265	000791	甘肃能源	600	3,702.00	0.00
266	002840	华统股份	200	3,318.00	0.00
267	600210	紫江企业	600	3,192.00	0.00
268	600059	古越龙山	400	3,176.00	0.00
269	688336	三生国健	147	2,991.45	0.00
270	001236	弘业期货	400	2,844.00	0.00
271	000403	派林生物	100	2,666.00	0.00
272	603093	南华期货	300	2,598.00	0.00
273	301171	易点天下	100	1,470.00	0.00
274	603718	海利生物	200	1,234.00	0.00
275	688403	汇成股份	144	1,221.12	0.00
276	688318	财富趋势	15	1,183.65	0.00
277	600389	江山股份	55	776.05	0.00
278	688023	安恒信息	19	760.19	0.00
279	688526	科前生物	50	734.50	0.00
280	601801	皖新传媒	102	706.86	0.00
281	300134	大富科技	100	682.00	0.00
282	688298	东方生物	16	434.40	0.00
283	688315	诺禾致源	15	163.80	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	600035	楚天高速	344,500	1,477,905.00	0.71
2	688510	航亚科技	72,789	1,340,045.49	0.64
3	002517	恺英网络	127,300	1,215,715.00	0.58
4	300659	中孚信息	71,084	861,538.08	0.41
5	300612	宣亚国际	67,857	827,176.83	0.40
6	603520	司太立	89,231	785,232.80	0.38

7	688512	慧智微	86,000	648,440.00	0.31
8	000926	福星股份	206,044	640,796.84	0.31
9	600792	云煤能源	197,350	615,732.00	0.29
10	300565	科信技术	55,732	543,944.32	0.26
11	688175	高凌信息	39,241	519,158.43	0.25
12	603185	弘元绿能	28,945	483,670.95	0.23
13	300305	裕兴股份	81,148	443,879.56	0.21
14	300619	金银河	18,305	443,713.20	0.21
15	000509	华塑控股	136,600	351,062.00	0.17
16	002741	光华科技	37,200	334,056.00	0.16
17	000560	我爱我家	148,200	329,004.00	0.16
18	301267	华夏眼科	15,600	323,232.00	0.15
19	300426	唐德影视	45,100	305,778.00	0.15
20	002152	广电运通	27,600	288,696.00	0.14
21	002475	立讯精密	7,300	286,963.00	0.14
22	603322	超讯通信	10,300	273,053.00	0.13
23	003038	鑫铂股份	18,866	272,236.38	0.13
24	301589	诺瓦星云	1,420	271,575.61	0.13
25	300071	福石控股	107,200	221,904.00	0.11
26	601858	中国科传	9,900	189,288.00	0.09
27	600198	大唐电信	36,500	187,975.00	0.09
28	688692	达梦数据	767	168,291.81	0.08
29	301538	骏鼎达	1,491	150,854.52	0.07
30	002866	传艺科技	10,300	132,561.00	0.06
31	688691	灿芯股份	2,379	124,660.88	0.06
32	688709	成都华微	5,746	110,707.97	0.05
33	600612	老凤祥	1,600	93,104.00	0.04
34	301587	中瑞股份	3,056	89,267.06	0.04
35	301591	肯特股份	2,184	88,113.42	0.04
36	688584	上海合晶	4,526	74,199.02	0.04
37	688530	欧莱新材	3,437	69,099.55	0.03

38	688695	中创股份	1,856	63,082.50	0.03
39	601985	中国核电	5,600	59,696.00	0.03
40	301588	美新科技	2,568	59,238.22	0.03
41	603341	龙旗科技	1,383	53,702.23	0.03
42	301502	华阳智能	1,375	53,673.83	0.03
43	603325	博隆技术	515	35,384.26	0.02
44	603344	星德胜	1,376	32,554.34	0.02
45	603082	北自科技	1,070	32,276.55	0.02
46	001359	平安电工	1,452	32,092.22	0.02
47	603375	盛景微	714	28,339.56	0.01
48	001387	雪祺电气	1,729	26,756.25	0.01
49	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.01
50	603285	键邦股份	1,029	19,190.85	0.01
51	300866	安克创新	260	18,514.60	0.01
52	000999	华润三九	390	16,606.20	0.01
53	301536	星辰科技	471	15,318.71	0.01
54	688496	清越科技	1,400	12,936.00	0.01
55	000032	深桑达A	800	11,984.00	0.01
56	001389	广合科技	263	9,763.14	0.00
57	000921	海信家电	300	9,672.00	0.00
58	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
59	301565	中仑新材	464	8,806.72	0.00
60	301580	爱迪特	132	8,702.76	0.00
61	688080	映翰通	260	7,885.80	0.00
62	000333	美的集团	100	6,450.00	0.00
63	002007	华兰生物	400	6,316.00	0.00
64	688020	方邦股份	155	5,170.80	0.00
65	601088	中国神华	100	4,437.00	0.00
66	603568	伟明环保	200	4,116.00	0.00
67	688168	安博通	150	4,035.00	0.00
68	601198	东兴证券	500	3,980.00	0.00

69	600325	华发股份	600	3,900.00	0.00
70	688150	莱特光电	192	3,724.80	0.00
71	300803	指南针	100	3,641.00	0.00
72	688058	宝兰德	157	3,270.31	0.00
73	603312	西典新能	124	3,144.64	0.00
74	601919	中远海控	200	3,098.00	0.00
75	601077	渝农商行	600	3,012.00	0.00
76	688028	沃尔德	177	2,908.11	0.00
77	688349	三一重能	117	2,906.28	0.00
78	688393	安必平	189	2,897.37	0.00
79	601019	山东出版	200	2,364.00	0.00
80	688606	奥泰生物	50	2,356.50	0.00
81	688636	智明达	97	2,211.60	0.00
82	603381	永臻股份	85	2,136.05	0.00
83	600479	千金药业	200	2,034.00	0.00
84	603031	安孚科技	84	1,896.72	0.00
85	300532	今天国际	120	1,474.80	0.00
86	603508	思维列控	76	1,425.00	0.00
87	603208	江山欧派	63	1,205.82	0.00
88	688425	铁建重工	183	673.44	0.00
89	688580	伟思医疗	25	669.00	0.00
90	688697	纽威数控	36	564.84	0.00
91	688538	和辉光电	150	297.00	0.00
92	688159	有方科技	5	189.30	0.00
93	688029	南微医学	3	184.68	0.00
94	002058	威尔泰	22	167.20	0.00
95	688220	翱捷科技	4	149.84	0.00
96	300197	节能铁汉	66	75.24	0.00
97	002288	*ST超华	56,400	-	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	601222	林洋能源	7,364,569.00	2.16
2	688368	晶丰明源	6,840,768.89	2.01
3	601609	金田股份	6,623,332.00	1.94
4	600662	外服控股	6,590,876.44	1.93
5	000030	富奥股份	6,225,350.00	1.83
6	002276	万马股份	5,781,046.00	1.70
7	002249	大洋电机	5,749,175.00	1.69
8	002948	青岛银行	5,635,366.00	1.65
9	002745	木林森	5,525,815.00	1.62
10	600718	东软集团	5,511,598.00	1.62
11	600966	博汇纸业	5,452,592.38	1.60
12	600623	华谊集团	5,304,803.00	1.56
13	003012	东鹏控股	5,250,617.00	1.54
14	600216	浙江医药	5,161,563.00	1.52
15	300685	艾德生物	5,090,820.00	1.49
16	688100	威胜信息	4,970,636.68	1.46
17	688095	福昕软件	4,851,493.86	1.42
18	603766	隆鑫通用	4,811,663.00	1.41
19	002946	新乳业	4,801,830.74	1.41
20	600645	中源协和	4,777,312.00	1.40

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

**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	601222	林洋能源	10,605,675.00	3.11
2	600761	安徽合力	8,785,181.48	2.58
3	688100	威胜信息	7,128,375.24	2.09
4	002171	楚江新材	6,845,383.97	2.01
5	002283	天润工业	6,546,407.00	1.92
6	002649	博彦科技	6,352,782.00	1.86
7	688368	晶丰明源	6,089,888.46	1.79
8	000061	农产品	6,008,765.00	1.76
9	601019	山东出版	5,949,870.70	1.75
10	688088	虹软科技	5,942,233.55	1.74
11	601126	四方股份	5,888,522.00	1.73
12	002381	双箭股份	5,867,344.90	1.72
13	000030	富奥股份	5,829,834.00	1.71
14	688106	金宏气体	5,555,209.09	1.63
15	601311	骆驼股份	5,501,788.00	1.62
16	601137	博威合金	5,473,965.00	1.61
17	601609	金田股份	5,440,340.00	1.60
18	600458	时代新材	5,313,348.79	1.56
19	603699	纽威股份	5,299,331.00	1.56
20	002390	信邦制药	5,150,167.00	1.51

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

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,055,070,029.64
卖出股票收入（成交）总额	1,135,251,504.53

注：本表“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，本着谨慎原则，参与股指期货的投资，以管理投资组合的系统性风险，改善组合的风险收益特性。套期保值主要采用流动性好、交易活跃的期货合约。本基金在进行股指期货投资时，通过对证券市场和期货市场运行趋势的研究，并结合股指期货的定价模型寻求其合理的估值水平。

**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**

本基金暂不投资国债期货。

**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 本报告期内基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查或在报告编制日前一年收到公开谴责、处罚的情形。**

**7.12.2 报告期内，本基金投资的前十名股票中，没有超出基金合同规定的备选股票库之外的股票。**

**7.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
----	----	----

1	存出保证金	798,052.80
2	应收清算款	650,000.70
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,205,451.63
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,653,505.13

**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的说明**

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限情况。

**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**

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	300659	中孚信息	861,538.08	0.41	非公开发行锁定
2	300612	宣亚国际	827,176.83	0.40	非公开发行锁定

**7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

由于四舍五入的原因，本报告中涉及比例计算的分项之和与合计项之间可能存在尾差。

**§8 基金份额持有人信息**

**8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

份额级别	持有	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	人 户 数 (户)		持有份额	占总 份额 比例	持有份额	占总份 额比例
财通 中证1 000指 数增 强A	1,3 43	39,648.24	2,252,037.93	4.23%	50,995,543.61	95.77%
财通 中证1 000指 数增 强C	4,4 24	42,180.44	6,905,188.53	3.70%	179,701,084.42	96.30%
合计	5,7 67	41,590.75	9,157,226.46	3.82%	230,696,628.03	96.18%

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

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比 例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	财通中证1000指 数增强A	9,796.08	0.0184%
	财通中证1000指 数增强C	1.00	0.0000%
	合计	9,797.08	0.0041%

注：分级基金管理人的从业人员持有基金占基金总份额比例的计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区
----	------	--------------

		间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	财通中证1000指数增强A	0
	财通中证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	财通中证1000指数增强A	0
	财通中证1000指数增强C	0
	合计	0

### §9 开放式基金份额变动

单位：份

	财通中证1000指数增强 A	财通中证1000指数增强 C
基金合同生效日(2023年11月07日)基金份额总额	94,243,846.35	254,697,690.22
本报告期期初基金份额总额	94,405,626.26	255,415,728.02
本报告期基金总申购份额	7,620,098.47	83,109,792.65
减：本报告期基金总赎回份额	48,778,143.19	151,919,247.72
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	53,247,581.54	186,606,272.95

注：总申购份额含红利再投、转换入份额；总赎回份额含转换出份额。

### §10 重大事件揭示

#### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内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

- 1、本报告期内本基金管理人未发生重大人事变动。
- 2、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**

本报告期内无涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

**10.4 基金投资策略的改变**

本报告期内本基金投资策略未发生改变。

**10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况**

本报告期内本基金未改聘会计师事务所，为毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）。

**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**

本报告期内未发生管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况。

**10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况**

本报告期内，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	
财通证券	2	31,016,578.34	1.42%	22,893.52	1.45%	-
民生证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中信	2	-	-	-	-	-

证券						
中信 证券 山东	2	-	-	-	-	-
广发 证券	3	703,195,738.98	32.26%	496,421.83	31.45%	-
中信 建投 证券	3	1,445,508,038.85	66.32%	1,059,286.06	67.10%	-

注：1、基金专用交易单元的选择标准如下：

- (1)经营行为稳健规范，内控制度健全的证券经营机构；
- (2)具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施满足基金进行证券交易的需要；
- (3)具有较强的全方位金融服务能力和水平，能积极为公司投资业务的开展，投资信息的交流以及其他方面业务的开展提供良好的服务和支持。

2、基金专用交易单元的选择程序如下：

- (1)投资、研究部门与券商联系商讨合作意向，根据公司对券商交易单元的选择标准，确定选用交易单元的所属券商以及（主）交易单元，报投资总监与总经理审核批准；
- (2)集中交易部与券商商议交易单元租用协议，经相关业务部门确认后，报公司领导审批；
- (3)基金清算部负责对接托管行、各证券交易所、中登公司上海和深圳分公司办理交易单元手续及账户开户手续。

**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**

本报告期内本基金未租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况。

**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	财通基金管理有限公司关于旗下部分证券投资基金投资非公开发行股票的公告	中国证监会规定媒介	2024-01-18
2	财通基金管理有限公司关于旗下部分证券投资基金投资非公开发行股票的公告	中国证监会规定媒介	2024-01-19
3	关于财通中证1000指数增强	中国证监会规定媒介	2024-01-19

	型证券投资基金开放日常赎回、转换转出业务的公告		
4	财通基金管理有限公司关于旗下部分证券投资基金投资非公开发行股票的公告	中国证监会规定媒介	2024-01-20
5	财通基金管理有限公司关于旗下部分证券投资基金投资非公开发行股票的公告	中国证监会规定媒介	2024-01-27
6	财通基金管理有限公司关于旗下部分证券投资基金投资非公开发行股票的公告	中国证监会规定媒介	2024-02-03
7	关于华融融达期货股份有限公司终止代理销售财通基金管理有限公司旗下基金的公告	中国证监会规定媒介	2024-02-03
8	关于和合期货有限公司终止代理销售财通基金管理有限公司旗下基金的公告	中国证监会规定媒介	2024-02-29
9	财通中证1000指数增强型证券投资基金更新招募说明书（2024年03月09日公告）	中国证监会规定媒介	2024-03-09
10	财通中证1000指数增强型证券投资基金基金产品资料概要更新（2024年03月09日公告）	中国证监会规定媒介	2024-03-09
11	财通中证1000指数增强型证券投资基金基金经理变更公告	中国证监会规定媒介	2024-03-09
12	财通基金管理有限公司关于旗下部分证券投资基金投资非公开发行股票的公告	中国证监会规定媒介	2024-03-26
13	关于北京增财基金销售有限公司终止代理销售财通基金	中国证监会规定媒介	2024-03-29



	管理有限公司旗下基金的公告		
14	财通基金管理有限公司关于旗下部分证券投资基金投资非公开发行股票的公告	中国证监会规定媒介	2024-03-30
15	关于深圳新华信通基金销售有限公司终止代理销售财通基金管理有限公司旗下基金的公告	中国证监会规定媒介	2024-04-13
16	财通中证1000指数增强型证券投资基金2024年第1季度报告	中国证监会规定媒介	2024-04-20
17	关于天相投资顾问有限公司终止代理销售财通基金管理有限公司旗下基金的公告	中国证监会规定媒介	2024-04-26
18	关于民商基金销售（上海）有限公司终止代理销售财通基金管理有限公司旗下基金的公告	中国证监会规定媒介	2024-04-27
19	财通基金管理有限公司关于旗下部分证券投资基金投资非公开发行股票的公告	中国证监会规定媒介	2024-04-30
20	关于深圳富济基金销售有限公司终止代理销售财通基金管理有限公司旗下基金的公告	中国证监会规定媒介	2024-05-17
21	财通基金管理有限公司关于暂停海银基金销售有限公司办理旗下基金相关业务的公告	中国证监会规定媒介	2024-06-07
22	关于江苏天鼎证券投资咨询有限公司终止代理销售财通基金管理有限公司旗下基金	中国证监会规定媒介	2024-06-14

	的公告		
23	财通基金管理有限公司关于旗下部分证券投资基金投资非公开发行股票的公告	中国证监会规定媒介	2024-06-18
24	财通基金管理有限公司关于旗下部分证券投资基金投资非公开发行股票的公告	中国证监会规定媒介	2024-06-21
25	财通基金管理有限公司关于旗下部分证券投资基金投资非公开发行股票的公告	中国证监会规定媒介	2024-06-26
26	财通基金管理有限公司关于旗下部分基金估值调整情况的公告	中国证监会规定媒介	2024-06-29
27	财通中证1000指数增强型证券投资基金基金产品资料概要更新（2024年06月29日公告）	中国证监会规定媒介	2024-06-29
28	财通中证1000指数增强型证券投资基金更新招募说明书（2024年06月29日公告）	中国证监会规定媒介	2024-06-29

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

报告期内本基金未有单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况发生。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金注册的文件；
- 2、财通中证1000指数增强型证券投资基金基金合同；
- 3、财通中证1000指数增强型证券投资基金托管协议；

- 4、财通中证1000指数增强型证券投资基金招募说明书及其更新；
- 5、报告期内披露的各项公告；
- 6、法律法规要求备查的其他文件。

## 12.2 存放地点

上海市浦东新区银城中路68号时代金融中心43/45楼。

## 12.3 查阅方式

投资者可在本基金管理人网站上免费查阅备查文件，对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人。

咨询电话：400-820-9888

公司网址：[www.ctfund.com](http://www.ctfund.com)

财通基金管理有限公司  
二〇二四年八月三十一日