

**申万菱信中证 1000 指数增强型证券投资基金**  
**2023 年中期报告**  
**2023 年 6 月 30 日**

基金管理人：申万菱信基金管理有限公司

基金托管人：中国银行股份有限公司

送出日期：二〇二三年八月三十一日

## 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人中国银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 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 2023 年 2 月 14 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.....	6
2.1 基金基本情况.....	6
2.2 基金产品说明.....	6
2.3 基金管理人和基金托管人.....	7
2.4 信息披露方式.....	7
2.5 其他相关资料.....	7
3 主要财务指标和基金净值表现.....	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	8
3.2 基金净值表现.....	9
4 管理人报告.....	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	13
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.....	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
5 托管人报告.....	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
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.....	16
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.....	16
6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	16
6.1 资产负债表.....	17
6.2 利润表.....	18
6.3 净资产（基金净值）变动表.....	19
6.4 报表附注.....	20
7 投资组合报告.....	51
7.1 期末基金资产组合情况.....	51
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	52
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.....	53
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	57
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	59
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.....	60
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.....	60
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.....	60
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.....	60
7.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	60

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	60
7.12 投资组合报告附注 .....	61
8 基金份额持有人信息 .....	61
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	62
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	62
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的情况 .....	63
9 开放式基金份额变动 .....	63
10 重大事件揭示 .....	63
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	64
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 .....	64
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	64
10.4 基金投资策略的改变 .....	64
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件 .....	64
10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	64
10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	64
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	64
11 备查文件目录 .....	65
11.1 备查文件目录 .....	65
11.2 存放地点 .....	65
11.3 查阅方式 .....	66



## 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	申万菱信中证 1000 指数增强型证券投资基金	
基金简称	申万菱信中证 1000 指数增强	
基金主代码	017067	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 2 月 14 日	
基金管理人	申万菱信基金管理有限公司	
基金托管人	中国银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	486,564,255.92 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	申万菱信中证 1000 指数增 强 A	申万菱信中证 1000 指数增 强 C
下属分级基金的交易代码	017067	017068
报告期末下属分级基金的份额总额	325,168,956.46 份	161,395,299.46 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为增强型股票指数基金，通过数量化的投资方法与严格的投资纪律约束，力争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	本基金在指数化投资的基础上通过数量化模型进行投资组合优化，在控制与业绩比较基准偏离风险的前提下，力争获得超越标的指数的投资收益。
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率*95%+银行人民币活期存款利率(税后)*5%
风险收益特征	本基金为股票型指数增强基金，其预期风险和预期收益均高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。

## 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		申万菱信基金管理有限公司	中国银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	王菲萍	许俊
	联系电话	021-23261188	010-66596688
	电子邮箱	service@swsmu.com	fxjd_hq@bank-of-china.com
客户服务电话		4008808588	95566
传真		021-23261199	010-66594942
注册地址		上海市中山南路100号11层	北京市西城区复兴门内大街1号
办公地址		上海市中山南路100号11层	北京市西城区复兴门内大街1号
邮政编码		200010	100818
法定代表人		陈晓升	葛海蛟

## 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.swsmu.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	申万菱信基金管理有限公司	上海市中山南路 100 号 10、11 层

## 3 主要财务指标和基金净值表现

## 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2023 年 2 月 14 日(基金合同生效日)至 2023 年 6 月 30 日)	
	申万菱信中证 1000 指数增强 A	申万菱信中证 1000 指数增强 C
本期已实现收益	-3,576,722.68	-1,749,347.85
本期利润	-8,628,619.64	-4,519,524.01
加权平均基金份额本期利润	-0.0209	-0.0150
本期加权平均净值利润率	-2.12%	-1.52%
本期基金份额净值增长率	-2.44%	-2.59%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
	申万菱信中证 1000 指数增强 A	申万菱信中证 1000 指数增强 C
期末可供分配利润	-7,944,528.90	-4,182,832.84
期末可供分配基金份额利润	-0.0244	-0.0259
期末基金资产净值	317,224,427.56	157,212,466.62
期末基金份额净值	0.9756	0.9741
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2023 年 6 月 30 日)	
	申万菱信中证 1000 指数增强 A	申万菱信中证 1000 指数增强 C
基金份额累计净值增长率	-2.44%	-2.59%

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、上述基金业绩指标已扣除了基金的管理费、托管费和各项交易费用，但不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如：申购费、赎回费等），计入认购或交易基金各项费用后，实际收益水平要低于所列数字。

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。

4、本基金合同生效日为 2023 年 2 月 14 日，截至本报告期末本基金合同生效未满 6 个月。

### 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

申万菱信中证 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	1.82%	0.91%	0.59%	0.99%	1.23%	-0.08%
过去三个月	-2.25%	0.85%	-3.77%	0.87%	1.52%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-2.44%	0.70%	-6.05%	0.84%	3.61%	-0.14%

申万菱信中证 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	1.78%	0.91%	0.59%	0.99%	1.19%	-0.08%
过去三个月	-2.36%	0.85%	-3.77%	0.87%	1.41%	-0.02%
自基金合同生效起至今	-2.59%	0.70%	-6.05%	0.84%	3.46%	-0.14%

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%+银行人民币活期存款利率(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

申万菱信中证 1000 指数增强型证券投资基金

份额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 2 月 14 日至 2023 年 6 月 30 日)

申万菱信中证 1000 指数增强 A



申万菱信中证 1000 指数增强 C



- 注：1、本基金合同生效日为 2023 年 02 月 14 日，截至本报告期末本基金合同生效未满一年。  
2、本基金建仓期为本基金合同生效日起六个月，截至本报告期末，本基金尚处于建仓期中。

#### 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

申万菱信基金自成立以来，始终将持有人的利益放在首位，秉持“研究至善”的愿景、“长期致胜”的使命，遵循“诚于心、行于矩、敏于变”的企业价值观。近年来，申万菱信基金围绕市场和客户需求，逐渐形成“投资美好生活、创新理财服务”的产品规划；通过努力打造“美好生活”系列权益产品，不断丰富“全市场、宽基指数与增强、主题指数、量化对冲、固收+、另类投资和纯固收”等产品大类，致力于为持有人提供“温暖陪伴”的产品服务，以努力达成“长期致胜”的使命。公司现有开放式公募基金 82 只，资产管理总规模超过 940.08 亿元，产品累计分红 200.35 亿元（数据截至 2023 年 6 月 30 日）。

近年来，申万菱信基金通过建设关键假设平台(Key Assumption Platform)，推动“研究数字化”；通过基金经理的风格开发、稳定和优化，推动“投资风格化”；通过风险管理工作的关口前移，加强市场风险管理支持，推动“风控全流程”，从而不断建设申万菱信基金的“机构理性”，以提升投资业绩。此外，申万菱信基金还持续打造卓越战略与产品管理体系 (Excellent Strategy & Product)、卓越品牌与客户服务体系 (Excellent Branding & Service)，提升面向不同类别客户的全方位专业服务水平。

申万菱信基金股东实力雄厚，中央汇金公司控股的申万宏源证券持有公司 67% 的股份，日本三菱 UFJ 信托银行持有公司 33% 的股份。申万菱信基金拥有公开募集证券投资基金管理人、特定客户资产管理人、合格境内机构投资者(QDII)管理人、保险资金投资管理人、基金投资顾问、合格境内有限合伙人(QDLP)等业务资格，并全资设立申万菱信(上海)资产管理有限公司，专门从事特定客户资产管理业务和专项资产管理业务。公司曾多次荣获中国基金业金牛奖、中国明星基金奖、中国金基金奖等多项业内重量级奖项以及东方财富“最佳指数投资团队”等荣誉。

展望未来，申万菱信基金将紧紧依托双方股东优势，不断深化体制机制改革，以更加市场化的导向推动专业队伍的全方位发展，努力将公司打造成为一家优秀乃至卓越的资产管理机构。

### 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		
刘敦	量化投资部负责人，本基金基金经理	2023-02-14	-	14 年	刘敦先生，硕士研究生。2008 年起从事金融相关工作，曾任职于艾利士通资产管理有限公司、平安资产管理有限公司、申银万国证券研究所等。2015 年 03 月加入申万菱信基金管理有限公司，曾任专户投资经理，申万菱信沪深 300 价值指数证券投资基金、申万菱信深证成指分级证券投资基金、申万菱信价值优选灵活配置混合型证券投资基金、申万菱信量化成长混合型证券投资基金、申万菱信价值优先混合型证券投资基金基金经理，现任量化投资部负责人，申万菱信沪深 300 指数增强型证券投资基金、申万菱信量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金、申万菱信中证 500 指数优选增强型证券投资基金、申万菱信双禧混合型发起式证券投资基金、申万菱信中证 1000 指数增强型证券投资基金基金经理。
夏祥全	本基金基金经理	2023-02-14	-	11 年	夏祥全先生，硕士研究生。2011 年起从事金融相关工作，曾任职于上海申银万国证券研究所、上海保银投资管理有限公司、上海证源资产管理有限公司等。2020 年 03 月加入申万菱信基金，曾任申万菱信量化成长混合型证券投资基金、申万菱信价值优先混合型证券投资基金基金经理，现任申万菱信量化对冲策略灵活配置混合型发起式证券投资基金、申万菱信双禧混合型发起式证券投资基金、申万菱信中证 1000 指数增强型证券投资基金基金经理。

注：1.任职日期和离任日期一般情况下指公司作出决定之日；若该基金经理自基金合同生效日起即任职，则任职日期为基金合同生效日。

2.证券从业的含义遵从行业协会关于从业人员资格管理办法的相关规定。

#### 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

## 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《证券法》、《证券投资基金法》及其配套法规的规定，严格遵守基金合同约定，本着诚实信用、勤勉尽责等原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。

本基金投资运作符合法律法规和基金合同的规定，信息披露及时、准确、完整；本基金资产与本基金管理人与公司资产之间严格分开；没有发生内幕交易、操纵市场和不当关联交易及其他违规行为。在基金资产的管理运作中，无任何损害基金持有人利益的行为，并通过稳健经营、规范运作、规避风险，保护了基金持有人的合法权益。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，本公司制定了《公平交易办法》，通过组织结构的设置、工作制度、流程和技术手段全面落实公平交易原则在具体业务（包括研究分析、投资决策、交易执行等）环节中的实现，在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，确保各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会；同时，通过对投资交易行为的日常监控和事后分析评估来加强对公平交易过程和结果的监督。

在研究分析方面，本公司建立了规范、完善的研究管理平台，规范了研究人员的投资建议、研究报告的发布流程，使各投资组合经理在获取投资建议的及时性、准确性及深度等方面得到公平对待。

在投资决策方面，首先，公司建立健全投资授权制度，明确投资决策委员会、投资总监、投资组合经理等各投资决策主体的职责和权限。投资决策委员会和投资总监等管理机构和人员不得对投资经理在授权范围内的投资活动进行干预。投资经理在授权范围内可以自主决策，超过投资权限的操作必须经过严格的审批程序；其次，公司建立投资组合投资信息的管理及保密制度，除分管投资副总及投资总监等因业务管理的需要外，不同投资经理之间的持仓和交易等重大非公开投资信息相互隔离；另外，公司还建立机制要求公募投资经理与特定客户资产投资经理互相隔离，且不能互相授权投资事宜。

在交易执行方面，本公司设立了独立于投资管理职能的交易部，实行了集中交易制度和公平的交易分配制度：（1）对于交易所公开竞价的同向交易，内部制定了专门的交易规则，保证各投资组合获得公平的交易执行机会；（2）对于部分债券一级市场申购、非公开发行股票申购等以公司名义

进行的交易，各投资经理在交易前独立地确定各投资组合的交易价格和数量，集中交易室按照价格优先、比例分配的原则对交易结果进行分配；（3）对于银行间市场的现券交易，交易部在银行间市场开展独立、公平的询价，并由风险管理部对交易价格的公允性（根据市场公认的第三方信息）、交易对手和交易方式进行事前审核，确保交易得到公平和公允的执行。

在日常监控和事后分析评估方面，本公司风险管理部开展日内和定期的工作对公平交易执行情况作整体监控和效果评估。其中日常监控包括了日内不定点对交易系统的抽查监控；对非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购的申购方案和分配过程进行审核和监控；以及对银行间交易过程中投资组合与交易对手之间议价交易的交易方式和交易价格的公允性进行审查。事后分析评估上，风险管理部在每个季度和每年度的《公平交易执行报告》中，对不同组合间同一投资标的、临近交易日的同向交易和反向交易的合理性开展分析评估。

本公司通过事前的制度规范、事中的监控和事后的分析评估，严格执行了公平交易制度，公平对待了旗下各投资组合。本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况。

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本公司制定了《异常交易监控与报告办法》，明确定义了投资交易过程中出现的各种可能导致不公平交易和利益输送的异常交易类型，并规定且落实了异常交易的日常监控、识别以及事后的分析流程。

本基金本报告期内未出现异常交易的情况。本报告期内，本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% 的情况有 5 次。投资组合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易，未导致不公平交易和利益输送。

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023 年上半年，上海与深圳 A 股呈现一定分化，上证综指上涨 3.65%，深证成指上涨 0.10%，沪深 300 指数下跌 0.75%，中证 500 指数上涨 2.29%，中证 1000 指数上涨 5.10%；以中证 500、中证 1000 指数为代表的中小盘市值股票跑赢以沪深 300 为代表的大市值股票。

作为指数增强基金，本基金的基金合同规定本基金持有的股票资产占基金资产的比例不低于 80%，其中投资于中证 1000 指数成分股的资产占非现金资产的比例不低于 80%。基金成立以来，结合市场状况，我们采取了相对稳健的建仓策略，逐渐提高权益仓位，截止到 2023 年一季度末，基金的权益仓位已提升至 90% 以上，在二季度中，本基金完全按照基金合同约定的建仓完毕后正常运作阶段的权益仓位要求进行运作。

本基金采用的量化模型秉持基本面优秀、分析师情绪改善且量价特征配合的主要选股逻辑，自基金成立以来，从结果来看模型筛选的股票组合与标的指数的行情特征较为一致，报告期内本基金净值表现跑赢业绩比较基准。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

自基金合同生效日起,本基金 A 类产品净值表现为-2.44%,同期业绩基准表现为-6.05%。

自基金合同生效日起,本基金 C 类产品净值表现为-2.59%,同期业绩基准表现为-6.05%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2023 年上半年，经济不确定性下市场结构性特征明显，大市值股票跑输中小市值股票，通信、传媒、计算机等行业领跑市场，商贸零售、房地产、美容护理等行业相对落后，且表现最好的行业与表现最差的行业涨幅相差 74.10%，远高于 2021 年、2022 年全年表现最好的行业与表现最差的行业涨幅差（67.40%、47.48%），行业分化程度较大。展望 2023 年下半年，经济发展的不确定性有望降低，但新兴技术下对不同行业生命周期的影响，不同行业的景气度依然可能有较大差异，市场结构性特征大概率或将延续，随着新兴技术进入落地阶段，估值与业绩的匹配性值得重视。在后续的运用中，本基金将继续秉持基本面优秀、分析师情绪改善且量价特征配合的主要选股逻辑，在适度控制相对基准指数的偏离的基础上，力争构建具有较高性价比的量化投资组合。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金托管人根据法律法规要求履行估值政策及净值计算的复核责任。会计师事务所所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性发表专业意见。

本基金管理人按照相关法律法规规定，设有估值委员会，并制定了相关制度及流程。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。本基金管理人估值委员会成员包括督察长、分管基金投资的副总经理、分管基金运营的副总经理、基金运营部门负责人、法律合规与审计部门负责人、风险管理部门负责人。以上成员均具有多年的证券、基金从业经验，熟悉相关法律法规，具备投资、研究、风险管理、法律合规、基金估值运作等方面的专业胜任能力。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与最终决策和日常估值的执行。参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

报告期内，本基金管理人已与中债金融估值中心有限公司及中证指数有限公司签署服务协议，由中债金融估值中心有限公司按约定提供银行间同业市场的估值数据和流通受限股票的折扣率数据，由中证指数有限公司按约定提供交易所债券市场的估值数据。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

### 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，中国银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在申万菱信中证 1000 指数增强型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

#### 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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”、“关联方承销证券”、“关联方证券出借”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、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：申万菱信中证 1000 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日
<b>资 产：</b>		
银行存款	6.4.7.1	10,957,714.18
结算备付金		4,081,513.95
存出保证金		1,356,192.54
交易性金融资产	6.4.7.2	459,579,270.51
其中：股票投资		435,584,009.69
基金投资		-
债券投资		23,995,260.82
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		55,217.16
应收股利		-
应收申购款		56,550.64
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.5	-
资产总计		476,086,458.98
<b>负债和净资产</b>		<b>本期末 2023 年 6 月 30 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		485,678.96
应付管理人报酬		390,348.96
应付托管费		58,552.34
应付销售服务费		52,336.08
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	662,648.46
负债合计		1,649,564.80
<b>净资产：</b>		
实收基金	6.4.7.7	486,564,255.92
其他综合收益		-
未分配利润	6.4.7.8	-12,127,361.74
净资产合计		474,436,894.18
负债和净资产总计		476,086,458.98

注：（1）报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额总额 486,564,255.92 份。A 类基金份额净值 0.9756 元，份额总额 325,168,956.46 份；C 类基金份额净值 0.9741 元，份额总额 161,395,299.46 份。

（2）本基金基金合同于 2023 年 2 月 14 日生效。

## 6.2 利润表

会计主体：申万菱信中证 1000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2023 年 2 月 14 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023 年 2 月 14 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		-9,656,364.61
1.利息收入		1,008,661.79
其中：存款利息收入	6.4.7.9	132,610.74
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		876,051.05
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-3,142,927.73
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-9,991,707.43
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	1,173,412.89
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-
衍生工具收益	6.4.7.14	651,874.16
股利收益	6.4.7.15	5,023,492.65
3.公允价值变动收益（损失以“-”号	6.4.7.16	-7,822,073.12

填列)		
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	299,974.45
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>3,491,779.04</b>
1. 管理人报酬		2,577,240.49
2. 托管费		386,586.06
3. 销售服务费		430,583.10
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		4,877.79
8. 其他费用	6.4.7.19	92,491.60
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		<b>-13,148,143.65</b>
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		<b>-13,148,143.65</b>
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		<b>-</b>
<b>六、综合收益总额</b>		<b>-13,148,143.65</b>

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：申万菱信中证 1000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2023 年 2 月 14 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 2 月 14 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益（若有）	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	1,118,851,589.96	-	-	1,118,851,589.96
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-632,287,334.04	-	-12,127,361.74	-644,414,695.78
（一）、综合收益总额	-	-	-13,148,143.65	-13,148,143.65

(二)、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-632,287,334.04	-	1,020,781.91	-631,266,552.13
其中: 1.基金申购款	7,336,055.54	-	-141,247.39	7,194,808.15
2.基金赎回款	-639,623,389.58	-	1,162,029.30	-638,461,360.28
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	486,564,255.92	-	-12,127,361.74	474,436,894.18

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：

基金管理人负责人：汪涛，主管会计工作负责人：王伟，会计机构负责人：徐越

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

申万菱信中证 1000 指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2022]2440 号文《关于准予申万菱信中证 1000 指数增强型证券投资基金注册的批复》核准，由申万菱信基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则和《申万菱信中证 1000 指数增强型证券投资基金基金份额发售公告》发售。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,118,577,678.81 元。经向中国证监会备案，《申万菱信中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2023 年 2 月 14 日生效。基金合同生效日的基金份额总额为 1,118,851,589.96 份基金份额，其中认购资金利息折合基金份额 273,911.15 份。本基金的基金管理人为申万菱信基金管理有限公司，基金托管人为中国银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套规则、《申万菱信中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》和《申万菱信中证 1000 指数增强型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行或上市的股票（包括主板、创业板及其他依法发行、上市的股票、存托凭证）、债券（含国债、央行票据、金融债、次级债、企业债、

公司债、短期融资券、超短期融资券、中期票据、可转债及分离交易可转债、可交换债券、地方政府债等)、货币市场工具、债券回购、银行存款、同业存单、股指期货、国债期货、股票期权、资产支持证券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)。本基金可以参与融资和转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

本基金持有的股票资产占基金资产的比例不低于 80%,其中投资于中证 1000 指数成份股及备选成份股的资产占非现金资产的比例不低于 80%;每个交易日日终在扣除国债期货和股指期货合约需缴纳的交易保证金以及股票期权合约需缴纳的现金保证金后,本基金应当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、存出保证金及应收申购款等。股票期权、股指期货、国债期货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。如果法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为:中证 1000 指数收益率\*95%+银行人民币活期存款利率(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》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和《资产管理产品相关会计处理规定》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的要求,真实、完整地反映了本基金 2023 年 6 月 30 日的财务状况、自 2023 年 2 月 14 日(基金合同生效日)至 2023 年 6 月 30 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

#### 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 日至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为自 2023 年 2 月 14 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日止期间。

#### 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。本基金目前暂无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

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。

本基金持有的股票投资、基金投资、债券投资和资产支持证券投资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，在资产负债表中以交易性金融资产列示。本基金持有的衍生金融工

具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

管理金融资产业务模式，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，确定管理金融资产业务模式。

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

本基金在初始确认时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。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

##### -以摊余成本计量的金融负债

该类金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 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。

#### i. 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。

#### ii. 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。

#### iii. 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，参考类似金融工具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

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。

买入返售金融资产利息收入按到期应收或实际收到的金额与初始确认金额的差额，在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认，直线法与实际利率法确定的收入差异较小的可采用直线法。

股票投资收益、债券投资收益、基金投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其成本的差额确认。本基金的交易费用于进行股票、债券、基金、权证等交易发生时按照确定的金额确认并计入投资收益。

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于除息日确认。

债券利息按债券投资的票面价值与票面利率计算的金额扣除应由发行债券的企业代扣代缴的个人所得税(如适用)后的净额确认为当期损益。贴息债视同到期一次性还本付息的附息债，根据其发行价、到期价和发行期限按直线法推算内含票面利率后，计算利息计入当期损益。如票面利率与实际

利率出现重大差异，按实际利率计算利息计入当期损益。

转融通证券出借业务利息收入按出借起始日证券账面价值及出借费率计算的金额，在转融通证券实际出借期间内逐日计提。

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变动计入当期损益的金融资产、衍生金融资产、以公允价值计量且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。

其他收入在本基金履行了基金合同中的履约义务，即在客户取得服务控制权时确认收入。

#### **6.4.4.10 费用的确认和计量**

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费等按照权责发生制原则，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。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

本基金的其他费用如无需在收益期内预提或分摊，则于发生时直接计入当期损益；如需采用预提或待摊的方法，预提或待摊时计入当期损益。

#### **6.4.4.11 基金的收益分配政策**

由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，而 C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同，本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益分配方式分为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相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。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

#### **6.4.4.12 分部报告**

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

定报告分部。

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，包括但不限于非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等，不包括停牌、新发行未上市、回购交易中的质押券等流通受限股票，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。

根据中基协发[2014]24 号《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于 2015 年 1 季度固定收益品种的估值处理标准》和中基协字[2022]566 号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》（以下合称“估值处理标准”），在上海证券交易所、深圳证券交易所及银行间同业市场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

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[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《财政部、国家税务总局、证监会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《财政部、国家税务总局、证监会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》、《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》（财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号）、财税[2014]81号文《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2005]103号文《关于股权分置试点改革有关税收政策问题的通知》、上证交字[2008]16号《关于做好调整证券交易印花税税率相关工作的通知》及深圳证券交易所于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《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》、财税[2016]36号文《财政部、国家税务总局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》、中投信〔2021〕20号《关于香港联合交易所有限公司上调股票交易印花税率有关提示的通知》、财政部公告2019年第93号《关于继续执行沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、财政部税务总局公告2023年第2号《关于延续实施有关个人所得税优惠政策的公告》、财税〔2014〕81号《财政部、国家税务总局、中国证券监督管理委员会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》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) 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，暂不征收企业所得税。

(b) 自 2016 年 5 月 1 日起，在全国范围内全面推开营业税改征增值税（以下称营改增）试点，建筑业、房地产业、金融业、生活服务业等全部营业税纳税人，纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。

自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人（以下称管理人）运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务，按照以下规定确定销售额：提供贷款服务，以 2018 年 1 月 1 日起产生的利息及利息性质的收入为销售额；转让 2017 年 12 月 31 日前取得的股票（不包括限售股）、债券、基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以 2017 年最后一个交易日的股票收盘价（2017 年最后一个交易日处于停牌期间的股票，为停牌前最后一个交易日收盘价）、债券估值（中债金融估值中心有限公司或中证指数有限公司提供的债券估值）、基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

2018 年 1 月 1 日（含）以后，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。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日以前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券收入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。

(c) 基金作为流通股股东在股权分置改革过程中收到由非流通股股东支付的股份、现金对价，暂免征收印花税、企业所得税和个人所得税。

(d) 对基金从上市公司取得的股息、红利所得，由上市公司在向基金支付上述收入时代扣代缴 20% 的个人所得税。自 2013 年 1 月 1 日起，对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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

个人所得税应纳税所得额。对基金从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，由挂牌公司代扣代缴 20% 的个人所得税。对所取得的股息红利收入根据持股期限差别化计算个人所得税的应纳税所得额：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，其股息红利所得暂减按 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。

对内地个人投资者通过沪港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称中国结算）提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。内地个人投资者通过沪港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。个人投资者在国外已缴纳的预提税，可持有效扣税凭证到中国结算的主管税务机关申请税收抵免。

对内地企业投资者通过沪港通投资香港联交所上市股票取得的股息红利所得，计入其收入总额，依法计征企业所得税。其中，内地居民企业连续持有 H 股满 12 个月取得的股息红利所得，依法免征企业所得税。

(e) 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。对于基金通过沪港通/深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

根据香港联合交易所有限公司（以下简称联交所）上调股票交易印花税公告，自 2021 年 8 月 1 日起，香港市场的股票交易印花税由按成交金额的 0.1% 双向收取，上调为按成交金额的 0.13% 双向收取（取整到元，不足一元按一元计）。按照《上海证券交易所沪港通业务实施办法》第七十六条的有关规定，投资者进行沪港通下的港股通交易，应按照联交所市场的有关规定交纳相关费用。

(f) 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。

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的转让差价所得和通过基金互认买卖香港基金份额取得的转让差价所得，自 2019 年 12 月 5 日起至 2023 年 12 月 31 日止，继续暂免征收个人所得税。对内地企业投资者通过沪港通投资香港联交所上市股票取得的转让差价

所得，计入其收入总额，依法征收企业所得税。

(g) 对基金在 2018 年 1 月 1 日 (含) 以后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费附加。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
活期存款	10,957,714.18
等于：本金	10,956,694.08
加：应计利息	1,020.10
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
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	-
合计	10,957,714.18

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	443,685,776.81	-	435,584,009.69	-8,101,767.12	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所 市场	23,807,086.00	154,760.82	23,995,260.82	33,414.00
	银行间 市场	-	-	-	-
	合计	23,807,086.00	154,760.82	23,995,260.82	33,414.00

资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	467,492,862.81	154,760.82	459,579,270.51	-8,068,353.12

### 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			
	2023 年 6 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	8,904,680.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	8,904,680.00	-	-	-

#### 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
IM2309	IM2309	7.00	9,150,960.00	246,280.00
合计	-			246,280.00
减：可抵销期货暂收款	-			246,280.00
净额	-			-

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

### 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

本基金本报告期末无其他资产余额。

## 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年6月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	629.63
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	583,062.99
其中：交易所市场	583,062.99
银行间市场	-
应付利息	-
预提审计费用	32,008.68
预提信息披露费	46,947.16
合计	662,648.46

## 6.4.7.7 实收基金

## 申万菱信中证 1000 指数增强 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年2月14日（基金合同生效日）至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	542,583,426.99	542,583,426.99
本期申购	1,816,294.60	1,816,294.60
本期赎回（以“-”号填列）	-219,230,765.13	-219,230,765.13
本期末	325,168,956.46	325,168,956.46

## 申万菱信中证 1000 指数增强 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年2月14日（基金合同生效日）至2023年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	576,268,162.97	576,268,162.97
本期申购	5,519,760.94	5,519,760.94
本期赎回（以“-”号填列）	-420,392,624.45	-420,392,624.45
本期末	161,395,299.46	161,395,299.46

注：（1）申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

(2) 本基金基金合同于 2023 年 2 月 14 日生效。设立时募集的扣除认购费后的实收基金(本金)为人民币 1,118,577,678.81 元,在募集期间产生的存款利息为人民币 273,911.15 元,以上实收基金(本息)合计为人民币 1,118,851,589.96 元,折合 1,118,851,589.96 份基金份额。

#### 6.4.7.8 未分配利润

申万菱信中证 1000 指数增强 A

单位: 人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期利润	-3,576,722.68	-5,051,896.96	-8,628,619.64
本期基金份额交易产生的变动数	-1,055,906.50	1,739,997.24	684,090.74
其中: 基金申购款	3,130.89	-41,328.87	-38,197.98
基金赎回款	-1,059,037.39	1,781,326.11	722,288.72
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-4,632,629.18	-3,311,899.72	-7,944,528.90

申万菱信中证 1000 指数增强 C

单位: 人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期利润	-1,749,347.85	-2,770,176.16	-4,519,524.01
本期基金份额交易产生的变动数	-787,317.45	1,124,008.62	336,691.17
其中: 基金申购款	45,885.86	-148,935.27	-103,049.41
基金赎回款	-833,203.31	1,272,943.89	439,740.58
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,536,665.30	-1,646,167.54	-4,182,832.84

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位: 人民币元

项目	本期 2023 年 2 月 14 日(基金合同生效日)至 2023 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	74,838.48
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	24,154.04
其他	33,618.22
合计	132,610.74

**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
	2023年2月14日（基金合同生效日）至2023年6月30日
卖出股票成交总额	412,917,726.22
减：卖出股票成本总额	421,214,816.40
减：交易费用	1,694,617.25
买卖股票差价收入	-9,991,707.43

**6.4.7.10.2 股票投资收益——证券出借差价收入**

本基金本报告期无股票投资收益-证券出借差价收入。

**6.4.7.11 债券投资收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2023年2月14日（基金合同生效日）至2023年6月30日
债券投资收益——利息收入	788,936.15
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	384,476.74
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	1,173,412.89

**6.4.7.12 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2023年2月14日（基金合同生效日）至2023年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	405,961,668.24
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	401,778,991.69

减：应计利息总额	3,798,085.13
减：交易费用	114.68
买卖债券差价收入	384,476.74

#### 6.4.7.12.1 资产支持证券投资收益项目构成

本基金本报告期无资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期无贵金属投资收益。

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023年2月14日（基金合同生效日）至2023年6月30日
股指期货投资收益	651,874.16

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023年2月14日（基金合同生效日）至2023年6月30日
股票投资产生的股利收益	5,023,492.65
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	5,023,492.65

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023年2月14日（基金合同生效日）至2023年6月30日
1.交易性金融资产	-8,068,353.12
——股票投资	-8,101,767.12
——债券投资	33,414.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-

——其他	-
2.衍生工具	246,280.00
——权证投资	-
——期货投资	246,280.00
4.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	-7,822,073.12

**6.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2023年2月14日（基金合同生效日）至2023年6月30日
基金赎回费收入	299,974.45
合计	299,974.45

**6.4.7.18 信用减值损失**

本基金本报告期内未发生信用减值损失。

**6.4.7.19 其他费用**

单位：人民币元

项目	本期
	2023年2月14日（基金合同生效日）至2023年6月30日
审计费用	32,008.68
信息披露费	46,947.16
证券出借违约金	-
汇划手续费	13,535.76
合计	92,491.60

**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**

截至财务报表批准日，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**

无。

**6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方**

关联方名称	与本基金的关系
申万菱信基金管理有限公司（以下简称“申万菱信”）	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
申万宏源证券有限公司（以下简称“申万宏源”）	基金管理人的股东、基金销售机构
三菱 UFJ 信托银行株式会社	基金管理人的股东
中国银行股份有限公司（以下简称“中国银行”）	基金托管人、基金销售机构
申万菱信（上海）资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

**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 2023年2月14日（基金合同生效日）至2023年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
申万宏源	1,275,771,552.07	100.00%

**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**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年2月14日（基金合同生效日）至2023年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
申万宏源	825,116,158.12	100.00%

**6.4.10.1.4 债券回购交易**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年2月14日（基金合同生效日）至2023年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例

申万宏源	1,970,000,000.00	100.00%
------	------------------	---------

#### 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 2023年2月14日（基金合同生效日）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
申万宏源	1,181,271.13	100.00%	583,062.99	100.00%

注：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，以扣除证券公司需承担的费用后的净额列示。该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务。

#### 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 2023年2月14日（基金合同生效日）至2023年6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费
其中：支付销售机构的客户维护费	1,094,901.03

注：基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.00% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{基金管理费率} / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年2月14日（基金合同生效日）至2023年6月30日
	当期发生的基金应支付的托管费

注：基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.15% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times \text{基金托管费率} / \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。

#### 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 2023年2月14日（基金合同生效日）至2023年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	申万菱信中证 1000 指数增强 A	申万菱信中证 1000 指数 增强 C	合计
中国银行	0.00	194,918.71	194,918.71
申万宏源	0.00	131,524.50	131,524.50
合计	-	326,443.21	326,443.21

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.4%，销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值的 0.4% 年费率计提。计算方法如下：

$H = E \times C$  类基金销售服务费年费率 / 当年天数

H 为 C 类基金份额每日应计提的基金销售服务费

E 为 C 类基金份额前一日的基金资产净值

基金销售服务费每日计提，按月支付。

#### 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

本基金本报告期末与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

##### 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

本基金本报告期末与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

#### 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

本报告期内，本基金管理人未发生运用固有资金投资本基金的情况。

#### 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	
	2023年2月14日（基金合同生效日）至2023年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国银行股份有限公司	10,957,714.18	74,838.48

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期未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

无。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2023年6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

本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 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

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日止，本基金无因从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末 2023 年 6 月 30 日止，本基金无因从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 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融出证券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

本基金为指数增强型基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资等。与这些金融工具有关的风险，以及本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

本基金为指数增强型基金，属于中高风险品种，在跟踪指数的基础上，采用了量化增强的策略。本基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现与跟踪指数相同的风险收益目标。

本基金管理人已制定针对以上金融工具风险的管理政策和控制制度，并且形成了由本基金管理人在公司层面建立的风险管理委员会以及在董事会层面建立的风险控制委员会负责对与所投资金融工具相关的风险类型、管理政策和各种投资限制的定期回顾、评估和修改，本基金管理人的风险管理部门负责具体落实和日常跟踪的工作机制。

本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。

本基金面临的主要风险包括：信用风险、流动性风险和市场风险。与本基金相关的市场风险主要是其他价格风险。

#### **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来源于金融工具的发行者或是交易对手不能履行约定义务而产生。

本基金的银行存款存放在本基金的托管行或其他国内大中型商业银行，本基金管理人认为与以上银行相关的信用风险不重大。

本基金在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债券等投资品种的交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小，本基金管理人认为在交易所进行的交易涉及的信用风险不重大。

对于银行间债券等品种的交易，本基金管理人主要通过事前检查和控制交易对手信用及交割方式来管理风险。

对于发行者的信用风险控制，本基金管理人主要通过通过对投资品种的信用等级评估来选择适当的投资对象来管理。于本期末，本基金持有除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为 0%。

#### **6.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险主要来源于基金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。

本基金管理人已经建立涵盖制度、流程、组织架构、制衡机制、风险处置等方面的流动性风险管控体系；建立以压力测试为核心、覆盖全类型产品的基金流动性风险监测与预警制度及风险应对预案。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金管理人已经建立针对公募基金申购赎回状况的监控和预测机制以及建立了巨额赎回审批规程，对于巨额赎回建立严格的流动性评估机制；此外，本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。

针对资产的流动性风险，本基金管理人持续监控和预测旗下基金的各项流动性指标，包括组合持仓集中度指标、投资组合在短时间内变现能力的综合指标、组合持仓中变现能力较差的品种的比例控制和流通受限资产的总量控制，通过指标来持续地评估、选择、跟踪和控制投资组合的投资流动性风险。

除了上述日常流动性管理机制外，本基金管理人已建立压力测试制度，针对不同类型投资组合建立流动性压力测试模型，对各相关风险因子进行极端假设，进而评估对投资组合流动性的负面影响。此外，本基金管理人已建立流动性风险应急机制，一旦发生或认为可能发生较大的流动性风险，本基金管理人会立即启动相应的应急流程。

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

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自 2017 年 10 月 1 日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余是流动性较好的可在银行间同业市场交易的金融资产工具、银行存款和结算备付金，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注

6.4.12。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的 15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中 7 个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过 7 个工作日可变现资产的可变现价值。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。于本期末，除附注“期末债券正回购交易中作为抵押的债券”中列示的卖出回购证券款余额（如有）将在 1 个月内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了逆回购交易质押品管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果、流动性风险管理措施的实施以及本基金的资产和负债情况，本基金管理人认为本基金在本报告期内流动性情况良好。

#### 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。

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末	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
-----	--------	--------	----------	-------	-------	-----	----

2023年6月30日							
资产							
银行存款	10,957,714.18	-	-	-	-	-	10,957,714.18
结算备付金	4,081,513.95	-	-	-	-	-	4,081,513.95
存出保证金	1,356,192.54	-	-	-	-	-	1,356,192.54
交易性金融资产	-	-	23,995,260.82	-	-	435,584,009.69	459,579,270.51
买入返售金融资产	-	-	-	-	-	-	-
应收证券清算款	-	-	-	-	-	55,217.16	55,217.16
应收股利	-	-	-	-	-	-	-
应收申购款	-	-	-	-	-	56,550.64	56,550.64
其他资产	-	-	-	-	-	-	-
资产总计	16,395,420.67	-	23,995,260.82	-	-	435,695,777.49	476,086,458.98
负债							
短期借款	-	-	-	-	-	-	-
交易性金融负债	-	-	-	-	-	-	-
卖出回购金融资产款	-	-	-	-	-	-	-
应付证券清算款	-	-	-	-	-	-	-
应付赎回款	-	-	-	-	-	485,678.96	485,678.96
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	390,348.96	390,348.96
应付托管费	-	-	-	-	-	58,552.34	58,552.34
应付销售服务费	-	-	-	-	-	52,336.08	52,336.08
应交税费	-	-	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	-	-	662,648.46	662,648.46
负债总计	-	-	-	-	-	1,649,564.80	1,649,564.80

利率敏感度缺	16,395,420.	-	23,995,260.	-	-	434,046,21	474,436,89
口	67		82			2.69	4.18

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者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本期末，本基金持有交易性债券投资公允价值占基金资产净值的比例为 5.06%，因此市场利率的变动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

基金的其他价格风险是指以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。本基金的市场价格风险主要来源于本基金投资的股权和债权工具的未来价格可能受到一般市场波动或是其他影响个别股权工具价值的特定风险影响。由于本基金是一只中高风险的指数增强型基金，投资于股票资产不低于基金资产净值的 80%，其中，投资于中证 1000 指数成份股及备选成份股的资产占非现金资产的比例不低于 80%，所以存在很高的其他价格风险。

本基金在指数化投资的基础上通过数量化模型进行投资组合优化，在控制与业绩比较基准偏离风险的前提下，力争获得超越标的指数的投资收益。

本基金管理人日常主要运用跟踪误差、标准差、beta 值、VAR 等指标对基金进行风险度量，有效监控基金的投资组合面临的的市场价格风险。

#### 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 2023 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产—股票投资	435,584,009.69	91.81
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	435,584,009.69	91.81
----	----------------	-------

注：其他包含股指期货投资，于本期末，持仓数量为 7 手，合约市值为 9150960 元(附注 6.4.7.3)。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投资产生的持仓损益，则其他中包含的股指期货投资与相关的期货暂收款(结算所得持仓损益)之间按抵消后的金额为 0。

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准（见附件 6.4.1）中的股票指数以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2023 年 6 月 30 日
	基准上升 5%	18,900,000.00
	基准下降 5%	-18,900,000.00

#### 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 2023 年 6 月 30 日
第一层次	435,584,009.69
第二层次	23,995,260.82
第三层次	-
合计	459,579,270.51

###### 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。对于本基金投资的证券交易所上市的证券，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时，本基金不会于停牌期间、交易不活跃期间及限售期间将相关证券的公允价值列入第一层次。本基金综合考虑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，确定相关证券公允价值的层次。

###### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 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。

#### 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

于 2023 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	435,584,009.69	91.49
	其中：股票	435,584,009.69	91.49
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	23,995,260.82	5.04
	其中：债券	23,995,260.82	5.04
	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	15,039,228.13	3.16
8	其他各项资产	1,467,960.34	0.31
9	合计	476,086,458.98	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

#### 7.2.1.1 指数投资期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	1,997,637.00	0.42
B	采矿业	15,937,464.00	3.36
C	制造业	307,861,077.71	64.89
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	14,904,583.00	3.14
E	建筑业	5,590,200.00	1.18
F	批发和零售业	16,424,301.00	3.46
G	交通运输、仓储和邮政业	7,762,675.70	1.64
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	30,508,548.01	6.43
J	金融业	9,799,647.27	2.07
K	房地产业	8,597,243.00	1.81
L	租赁和商务服务业	1,969,680.00	0.42
M	科学研究和技术服务业	2,080,782.00	0.44
N	水利、环境和公共设施管理业	4,786,125.00	1.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	7,364,046.00	1.55
S	综合	-	-
	合计	435,584,009.69	91.81

#### 7.2.1.2 积极投资期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资的股票组合。

### 7.2.2 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 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	占基金资产净值比例（%）
1	300856	科思股份	49,200.00	3,875,484.00	0.82
2	002865	钧达股份	25,368.00	3,869,381.04	0.82
3	603920	世运电路	188,000.00	3,671,640.00	0.77
4	603328	依顿电子	442,800.00	3,666,384.00	0.77
5	002017	东信和平	277,810.00	3,642,089.10	0.77
6	603690	至纯科技	100,200.00	3,490,968.00	0.74
7	603959	百利科技	300,800.00	3,459,200.00	0.73
8	300634	彩讯股份	129,800.00	3,426,720.00	0.72
9	002085	万丰奥威	493,600.00	3,420,648.00	0.72
10	603179	新泉股份	77,300.00	3,392,697.00	0.72
11	002139	拓邦股份	258,700.00	3,376,035.00	0.71
12	300627	华测导航	103,692.00	3,366,879.24	0.71
13	688556	高测股份	61,951.00	3,292,076.14	0.69
14	605009	豪悦护理	67,400.00	3,235,200.00	0.68
15	603279	景津装备	103,000.00	3,230,080.00	0.68
16	600729	重庆百货	102,600.00	3,225,744.00	0.68
17	002126	银轮股份	179,700.00	3,180,690.00	0.67
18	002318	久立特材	185,000.00	3,150,550.00	0.66
19	603368	柳药集团	127,300.00	3,145,583.00	0.66
20	600508	上海能源	210,100.00	3,084,268.00	0.65
21	601702	华峰铝业	225,400.00	3,083,472.00	0.65
22	300130	新国都	108,500.00	3,073,805.00	0.65
23	002484	江海股份	143,900.00	3,063,631.00	0.65
24	600210	紫江企业	568,600.00	3,024,952.00	0.64
25	301089	拓新药业	48,400.00	2,997,896.00	0.63
26	002929	润建股份	68,500.00	2,973,585.00	0.63
27	600929	雪天盐业	370,200.00	2,939,388.00	0.62
28	601567	三星医疗	232,400.00	2,935,212.00	0.62
29	002847	盐津铺子	34,050.00	2,895,952.50	0.61

30	600211	西藏药业	48,700.00	2,892,780.00	0.61
31	600933	爱柯迪	123,300.00	2,871,657.00	0.61
32	603197	保隆科技	52,900.00	2,869,825.00	0.60
33	300775	三角防务	84,925.00	2,868,766.50	0.60
34	001269	欧晶科技	38,900.00	2,860,317.00	0.60
35	002746	仙坛股份	362,500.00	2,856,500.00	0.60
36	002987	京北方	128,520.00	2,817,158.40	0.59
37	002851	麦格米特	76,600.00	2,793,602.00	0.59
38	000951	中国重汽	164,300.00	2,768,455.00	0.58
39	603439	贵州三力	161,800.00	2,760,308.00	0.58
40	603129	春风动力	17,000.00	2,752,300.00	0.58
41	003040	楚天龙	151,700.00	2,751,838.00	0.58
42	300393	中来股份	194,760.00	2,734,430.40	0.58
43	000915	华特达因	77,000.00	2,717,330.00	0.57
44	301039	中集车辆	203,900.00	2,697,597.00	0.57
45	688518	联赢激光	96,800.00	2,696,848.00	0.57
46	600639	浦东金桥	214,900.00	2,666,909.00	0.56
47	605507	国邦医药	123,900.00	2,635,353.00	0.56
48	688559	海目星	55,900.00	2,627,859.00	0.55
49	600761	安徽合力	131,600.00	2,622,788.00	0.55
50	301268	铭利达	62,600.00	2,621,062.00	0.55
51	605123	派克新材	24,075.00	2,615,748.75	0.55
52	300827	上能电气	72,300.00	2,606,415.00	0.55
53	603229	奥翔药业	123,700.00	2,595,226.00	0.55
54	301216	万凯新材	155,850.00	2,591,785.50	0.55
55	002698	博实股份	147,300.00	2,576,277.00	0.54
56	002034	旺能环境	162,800.00	2,573,868.00	0.54
57	600483	福能股份	221,500.00	2,558,325.00	0.54
58	002768	国恩股份	105,500.00	2,552,045.00	0.54
59	688019	安集科技	15,317.00	2,524,701.11	0.53
60	688408	中信博	29,915.00	2,522,731.95	0.53
61	688711	宏微科技	42,790.00	2,496,368.60	0.53
62	002158	汉钟精机	99,900.00	2,493,504.00	0.53
63	002641	公元股份	442,100.00	2,493,444.00	0.53
64	688100	威胜信息	83,315.00	2,483,620.15	0.52
65	603323	苏农银行	587,300.00	2,472,533.00	0.52
66	601908	京运通	408,600.00	2,472,030.00	0.52
67	600510	黑牡丹	406,200.00	2,465,634.00	0.52
68	600908	无锡银行	459,600.00	2,463,456.00	0.52
69	002402	和而泰	144,900.00	2,460,402.00	0.52
70	603609	禾丰股份	270,114.00	2,458,037.40	0.52
71	601222	林洋能源	299,800.00	2,455,362.00	0.52
72	601137	博威合金	157,700.00	2,453,812.00	0.52
73	002605	姚记科技	52,800.00	2,451,504.00	0.52

74	002324	普利特	171,500.00	2,447,305.00	0.52
75	600098	广州发展	395,700.00	2,445,426.00	0.52
76	000875	吉电股份	453,600.00	2,444,904.00	0.52
77	603301	振德医疗	82,500.00	2,443,650.00	0.52
78	301155	海力风电	31,600.00	2,435,728.00	0.51
79	300206	理邦仪器	161,400.00	2,433,912.00	0.51
80	601528	瑞丰银行	501,800.00	2,433,730.00	0.51
81	603979	金诚信	78,200.00	2,432,020.00	0.51
82	601963	重庆银行	307,197.00	2,429,928.27	0.51
83	600572	康恩贝	354,400.00	2,427,640.00	0.51
84	600285	羚锐制药	150,500.00	2,417,030.00	0.51
85	002859	洁美科技	87,200.00	2,415,440.00	0.51
86	300638	广和通	106,200.00	2,408,616.00	0.51
87	300303	聚飞光电	384,000.00	2,403,840.00	0.51
88	600821	金开新能	345,200.00	2,378,428.00	0.50
89	000528	柳工	300,100.00	2,370,790.00	0.50
90	002697	红旗连锁	405,500.00	2,368,120.00	0.50
91	603187	海容冷链	117,740.00	2,353,622.60	0.50
92	605222	起帆电缆	113,900.00	2,353,174.00	0.50
93	300319	麦捷科技	274,400.00	2,348,864.00	0.50
94	300910	瑞丰新材	46,550.00	2,341,465.00	0.49
95	301207	华兰疫苗	70,350.00	2,339,841.00	0.49
96	002063	远光软件	269,000.00	2,334,920.00	0.49
97	688033	天宜上佳	122,000.00	2,332,640.00	0.49
98	688261	东微半导	16,600.00	2,321,842.00	0.49
99	688037	芯源微	13,546.00	2,315,688.70	0.49
100	688676	金盘科技	76,441.00	2,315,397.89	0.49
101	000913	钱江摩托	126,800.00	2,311,564.00	0.49
102	300693	盛弘股份	62,500.00	2,307,500.00	0.49
103	002724	海洋王	265,100.00	2,301,068.00	0.49
104	300602	飞荣达	147,900.00	2,290,971.00	0.48
105	603936	博敏电子	190,840.00	2,290,080.00	0.48
106	002990	盛视科技	61,700.00	2,270,560.00	0.48
107	002649	博彦科技	159,300.00	2,250,909.00	0.47
108	300332	天壕环境	196,000.00	2,248,120.00	0.47
109	002135	东南网架	347,800.00	2,246,788.00	0.47
110	300855	图南股份	63,570.00	2,245,292.40	0.47
111	003006	百亚股份	129,500.00	2,237,760.00	0.47
112	300232	洲明科技	243,400.00	2,224,676.00	0.47
113	000860	顺鑫农业	66,000.00	2,223,540.00	0.47
114	688526	科前生物	93,300.00	2,219,607.00	0.47
115	603588	高能环境	236,100.00	2,212,257.00	0.47
116	002258	利尔化学	170,800.00	2,205,028.00	0.46
117	600583	海油工程	375,200.00	2,194,920.00	0.46

118	300666	江丰电子	32,289.00	2,194,360.44	0.46
119	301087	可孚医疗	44,500.00	2,193,850.00	0.46
120	002335	科华数据	60,900.00	2,189,355.00	0.46
121	603071	物产环能	130,900.00	2,171,631.00	0.46
122	000885	城发环境	162,810.00	2,167,001.10	0.46
123	300443	金雷股份	61,000.00	2,162,450.00	0.46
124	002015	协鑫能科	158,800.00	2,132,684.00	0.45
125	002163	海南发展	213,100.00	2,131,000.00	0.45
126	600971	恒源煤电	272,400.00	2,121,996.00	0.45
127	300294	博雅生物	58,100.00	2,107,868.00	0.44
128	688202	美迪西	24,408.00	2,080,782.00	0.44
129	600740	山西焦化	403,800.00	2,071,494.00	0.44
130	601001	晋控煤业	220,000.00	2,059,200.00	0.43
131	600129	太极集团	34,600.00	2,058,354.00	0.43
132	603871	嘉友国际	130,760.00	2,054,239.60	0.43
133	601101	昊华能源	352,620.00	2,052,248.40	0.43
134	603599	广信股份	75,400.00	2,041,832.00	0.43
135	002351	漫步者	98,300.00	2,032,844.00	0.43
136	300674	宇信科技	114,600.00	2,026,128.00	0.43
137	603466	风语筑	145,000.00	2,015,500.00	0.42
138	300723	一品红	68,408.00	2,004,354.40	0.42
139	003012	东鹏控股	247,400.00	2,001,466.00	0.42
140	002727	一心堂	75,800.00	2,001,120.00	0.42
141	002234	民和股份	109,700.00	1,997,637.00	0.42
142	603345	安井食品	13,600.00	1,996,480.00	0.42
143	600123	兰花科创	243,620.00	1,992,811.60	0.42
144	603567	珍宝岛	133,100.00	1,991,176.00	0.42
145	603171	税友股份	49,300.00	1,971,014.00	0.42
146	600057	厦门象屿	226,400.00	1,969,680.00	0.42
147	688389	普门科技	83,752.00	1,967,334.48	0.41
148	600612	老凤祥	27,900.00	1,949,652.00	0.41
149	300133	华策影视	274,800.00	1,948,332.00	0.41
150	601801	皖新传媒	205,600.00	1,930,584.00	0.41
151	301367	怡和嘉业	13,000.00	1,928,420.00	0.41
152	688639	华恒生物	21,283.00	1,925,685.84	0.41
153	300738	奥飞数据	186,100.00	1,898,220.00	0.40
154	600295	鄂尔多斯	210,560.00	1,888,723.20	0.40
155	002737	葵花药业	77,500.00	1,886,350.00	0.40
156	002928	华夏航空	222,500.00	1,880,125.00	0.40
157	603297	永新光学	23,300.00	1,861,670.00	0.39
158	002130	沃尔核材	226,600.00	1,839,992.00	0.39
159	600223	福瑞达	177,400.00	1,820,124.00	0.38
160	603208	江山欧派	48,880.00	1,780,209.60	0.38
161	300593	新雷能	77,630.00	1,778,503.30	0.37

162	002782	可立克	116,100.00	1,775,169.00	0.37
163	603027	千禾味业	82,300.00	1,738,176.00	0.37
164	600428	中远海特	263,700.00	1,661,310.00	0.35
165	301031	中熔电气	12,200.00	1,655,662.00	0.35
166	600007	中国国贸	88,800.00	1,644,576.00	0.35
167	688148	芳源股份	134,791.00	1,644,450.20	0.35
168	688318	财富趋势	16,164.00	1,615,915.08	0.34
169	300224	正海磁材	124,900.00	1,606,214.00	0.34
170	002020	京新药业	124,800.00	1,599,936.00	0.34
171	000034	神州数码	58,600.00	1,558,174.00	0.33
172	600977	中国电影	104,600.00	1,469,630.00	0.31
173	688568	中科星图	17,960.00	1,447,216.80	0.31
174	002993	奥海科技	42,000.00	1,424,640.00	0.30
175	000950	重药控股	203,500.00	1,369,555.00	0.29
176	603305	旭升集团	46,360.00	1,292,053.20	0.27
177	002635	安洁科技	86,400.00	1,192,320.00	0.25
178	603938	三孚股份	57,116.00	1,130,325.64	0.24
179	002123	梦网科技	79,500.00	1,056,555.00	0.22
180	300036	超图软件	43,163.00	1,023,394.73	0.22
181	603636	南威软件	64,400.00	944,748.00	0.20
182	002895	川恒股份	42,100.00	829,370.00	0.17
183	605090	九丰能源	31,200.00	696,696.00	0.15
184	002216	三全食品	43,800.00	682,404.00	0.14
185	000048	京基智农	33,772.00	659,229.44	0.14
186	000028	国药一致	13,400.00	584,374.00	0.12
187	300119	瑞普生物	31,400.00	558,920.00	0.12
188	300777	中简科技	7,000.00	330,820.00	0.07
189	002959	小熊电器	2,100.00	175,350.00	0.04
190	002262	恩华药业	3,500.00	107,905.00	0.02
191	002991	甘源食品	1,000.00	76,700.00	0.02
192	000935	四川双马	4,300.00	72,412.00	0.02

### 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

本基金本报告期末未持有积极投资的股票组合。

## 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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例
----	------	------	----------	-------------

				(%)
1	002015	协鑫能科	5,722,206.00	1.21
2	688033	天宜上佳	4,773,843.89	1.01
3	300723	一品红	4,173,587.36	0.88
4	301039	中集车辆	3,715,307.00	0.78
5	000048	京基智农	3,405,606.56	0.72
6	002839	张家港行	3,389,778.20	0.71
7	603323	苏农银行	3,389,346.70	0.71
8	000567	海德股份	3,386,275.00	0.71
9	000090	天健集团	3,384,441.23	0.71
10	600510	黑牡丹	3,378,760.00	0.71
11	000011	深物业 A	3,367,138.00	0.71
12	603129	春风动力	3,342,722.00	0.70
13	688516	奥特维	3,291,571.14	0.69
14	300502	新易盛	3,278,891.14	0.69
15	688711	宏微科技	3,264,818.99	0.69
16	688019	安集科技	3,255,285.53	0.69
17	300596	利安隆	3,254,544.00	0.69
18	000049	德赛电池	3,254,140.00	0.69
19	600742	一汽富维	3,252,170.00	0.69
20	603279	景津装备	3,251,873.60	0.69

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末基金资产净值 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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	300502	新易盛	7,137,593.00	1.50
2	002291	遥望科技	4,362,555.00	0.92
3	002463	沪电股份	4,296,946.90	0.91
4	002015	协鑫能科	4,156,997.00	0.88
5	603118	共进股份	3,864,980.00	0.81
6	003031	中瓷电子	3,703,308.60	0.78
7	301060	兰卫医学	3,608,522.00	0.76
8	300633	开立医疗	3,550,536.14	0.75
9	002222	福晶科技	3,535,812.00	0.75
10	000567	海德股份	3,518,400.00	0.74
11	688617	惠泰医疗	3,516,339.56	0.74
12	002959	小熊电器	3,486,994.00	0.73
13	002100	天康生物	3,479,466.00	0.73

14	600481	双良节能	3,455,528.00	0.73
15	002567	唐人神	3,437,204.00	0.72
16	688276	百克生物	3,393,578.21	0.72
17	688106	金宏气体	3,372,827.12	0.71
18	300346	南大光电	3,364,370.36	0.71
19	301035	润丰股份	3,328,962.00	0.70
20	002839	张家港行	3,324,065.00	0.70

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

金额单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	864,900,593.21
卖出股票收入（成交）总额	412,917,726.22

注：买入股票成本总额、卖出股票收入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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	23,995,260.82	5.06
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	23,995,260.82	5.06

**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**

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019694	23 国债 01	120,000.00	12,133,157.26	2.56
2	019703	23 国债 10	118,000.00	11,862,103.56	2.50

**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，以套期保值为主要目的，有选择地投资于股指期货，并主要投资于流动性好、交易活跃且与基金投资目标匹配的期货合约。本基金的股指期货套保策略主要用于实现两项投资目标：第一、在合适的交易价格上建立股指期货多头套保仓位，力争获得相对于目标指数的超额收益；第二、在基金组合管理中，将股指期货合约作为高效管理权益仓位的投资工具，力争降低权益仓位调整的交易成本。

**7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

本基金本报告期内未投资国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期没有出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内收到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 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。

### 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	1,356,192.54
2	应收清算款	55,217.16
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	56,550.64
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,467,960.34

### 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。

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## 8 基金份额持有人信息

## 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
申万菱信中证 1000 指数增强 A	2,961	109,817.28	1,606,042.38	0.49%	323,562,914.08	99.51%
申万菱信中证 1000 指数增强 C	5,085	31,739.49	1,500,568.33	0.93%	159,894,731.13	99.07%
合计	7,991	60,889.03	3,106,610.71	0.64%	483,457,645.21	99.36%

注：（1）机构投资者/个人投资者持有份额占总份额比例计算中，对于下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对于合计数，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）。

（2）若同一持有人同时持有多个类别基金份额，会存在持有人户数合计数小于各份额类别持有人户数总和的情形。

## 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	申万菱信中证 1000 指数增强 A	406,650.85	0.13%
	申万菱信中证 1000 指数增强 C	47,857.10	0.03%
	合计	454,507.95	0.09%

注：注：分级基金管理人的从业人员持有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的情况

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	申万菱信中证 1000 指数增强 A	10~50
	申万菱信中证 1000 指数增强 C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	申万菱信中证 1000 指数增强 A	10~50
	申万菱信中证 1000 指数增强 C	0
	合计	10~50

## 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	申万菱信中证 1000 指数增强 A	申万菱信中证 1000 指数增强 C
基金合同生效日（2023 年 2 月 14 日）基金份额总额	542,583,426.99	576,268,162.97
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	1,816,294.60	5,519,760.94
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	219,230,765.13	420,392,624.45
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期末基金份额总额	325,168,956.46	161,395,299.46

注：1) 本基金合同生效日为 2023 年 2 月 14 日。

2) 申购含红利再投、转换入份额，赎回含转换出份额。

## 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

- 1、本报告期内，基金管理人董事、监事和高级管理人员未发生变更。
- 2、本报告期内，无涉及本基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期无涉及对公司运营管理及基金运作产生重大影响的，与本基金管理人、基金财产、基金托管业务相关的诉讼事项。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内本基金管理人的基金投资策略严格遵循本基金《招募说明书》中披露的基本投资策略，未发生显著的改变。

### 10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

无。

### 10.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金聘用毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）负责基金审计事务，未发生改聘会计师事务所事宜。

### 10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.7.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员未受监管部门稽查或处罚。

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

### 10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.8.1 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	
申万宏源证券	2	1,275,771,552.07	100.00%	1,181,271.13	100.00%	-

注：交易单元选择的标准：1、经营行为规范，在近一年内无重大违规行为；2、公司财务状况

良好；3、有良好的内控制度，在业内有良好的声誉；4、有较强的研究能力，能及时、全面、定期提供质量较高的宏观、行业、公司和证券市场研究报告，并能根据基金投资的特殊要求，提供专门的研究报告；5、建立了广泛的信息网络，能及时提供准确的信息资讯和服务。

### 10.8.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
申万宏源证券	825,116,158.12	100.00%	1,970,000,000.00	100.00%	-	-	-	-

## 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

基金合同；  
 招募说明书及其更新；  
 产品资料概要及其更新；  
 发售公告；  
 成立公告；  
 定期报告；  
 其他临时公告。

### 11.2 存放地点

备查文件存放在本基金管理人和托管人的住所。

### 11.3 查阅方式

上述文件均可到本基金管理人的住所进行查阅,也可在本基金管理人的网站进行查阅,查询网址:  
[www.swsmu.com](http://www.swsmu.com)。

申万菱信基金管理有限公司  
二〇二三年八月三十一日