

中信建投中证 1000 指数增强型证券投资基金

2025 年年度报告

2025 年 12 月 31 日

基金管理人:中信建投基金管理有限公司

基金托管人:中信银行股份有限公司

报告送出日期:2026 年 03 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2026年03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。

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

本报告期自2025年01月01日起至2025年12月31日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§ 2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	4
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	5
3.1 主要会计数据和财务指标	5
3.2 基金净值表现	6
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	13
§ 6 审计报告	14
6.1 审计报告基本信息	14
6.2 审计报告的基本内容	14
§ 7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表	16
7.2 利润表	17
7.3 净资产变动表	18
7.4 报表附注	19
§ 8 投资组合报告	46
8.1 期末基金资产组合情况	46
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	46
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	48
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	64
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	69
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	69
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	69

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	70
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	70
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	70
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	70
8.12 投资组合报告附注	70
§ 9 基金份额持有人信息	71
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	71
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	71
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	72
§ 10 开放式基金份额变动	72
§ 11 重大事件揭示	72
11.1 基金份额持有人大会决议	72
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	72
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	73
11.4 基金投资策略的改变	73
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	73
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	73
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	73
11.8 其他重大事件	75
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	76
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	77
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	77
§ 13 备查文件目录	77
13.1 备查文件目录	77
13.2 存放地点	77
13.3 查阅方式	77

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	中信建投中证 1000 指数增强型证券投资基金	
基金简称	中信建投中证 1000 指数增强	
基金主代码	015784	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022 年 06 月 28 日	
基金管理人	中信建投基金管理有限公司	
基金托管人	中信银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	265,291,969.24 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	中信建投中证 1000 指数增强 A	中信建投中证 1000 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	015784	015785
报告期末下属分级基金的份额总额	162,168,362.93 份	103,123,606.31 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为指数增强型基金，在力求对中证 1000 指数进行有效跟踪的基础上，本基金通过数量化的方法精选个股，在严格控制风险、保持良好流动性的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金为指数增强型基金，以中证 1000 指数为标的指数，基金股票投资方面将主要采用指数增强量化投资策略，在严格控制跟踪误差的基础上，力求获得超越标的指数的超额收益。 指数增强量化投资策略主要借鉴国内外成熟的组合投资策略，在对标的指数成份股及其他股票基本面的深入研究的基础上，运用多因子分析模型和机器学习模型构建投资组合，同时优化组合交易并严格控制组合风险，实现超额收益。
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率×95%+中证综合债指数收益率×5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益和预期风险高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	中信建投基金管理有限公司	中信银行股份有限公司

信息披露负责人	姓名	朱伟	滕菲菲
	联系电话	010-59100208	4006800000
	电子邮箱	zhuweibj@csc.com.cn	tengfeifei@citicbank.com
客户服务电话		4009-108-108	95558
传真		010-59100298	010-85230024
注册地址		北京市怀柔区桥梓镇八龙桥雅苑 3 号楼 1 室	北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层
办公地址		北京市东城区朝阳门内大街 188 号鸿安国际大厦 6、8 层	北京市朝阳区光华路 10 号院 1 号楼 6-30 层、32-42 层
邮政编码		100010	100020
法定代表人		黄凌	方合英

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.cfund108.com
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室
注册登记机构	中信建投基金管理有限公司	北京市东城区朝阳门内大街 188 号鸿安国际大厦 6、8 层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2025 年		2024 年		2023 年	
	中信建投中证 1000 指数增强 A	中信建投中证 1000 指数增强 C	中信建投中证 1000 指数增强 A	中信建投中证 1000 指数增强 C	中信建投中证 1000 指数增强 A	中信建投中证 1000 指数增强 C
本期已实现收益	57,468,160.51	30,249,376.98	31,089,985.36	9,408,114.86	23,850,650.50	3,576,760.27
本期利润	67,311,712.81	34,933,645.44	25,400,191.41	8,609,580.40	45,224,669.93	11,992,156.91
加权平均基金份额本期	0.3445	0.3328	0.0891	0.0557	0.1253	0.0854

利润						
本期加权平均净值利润率	29.06%	28.13%	9.91%	6.29%	12.55%	8.64%
本期基金份额净值增长率	33.05%	32.51%	8.93%	8.50%	1.13%	0.72%
3.1.2 期末数据和指标	2025 年末		2024 年末		2023 年末	
期末可供分配利润	61,242,107.58	36,963,462.09	8,475,745.48	2,853,952.00	-15,056,258.69	-9,030,564.81
期末可供分配基金份额利润	0.3776	0.3584	0.0354	0.0251	-0.0495	-0.0552
期末基金资产净值	223,410,470.51	140,087,068.40	247,691,895.78	116,617,642.40	288,975,212.21	154,476,285.47
期末基金份额净值	1.3776	1.3584	1.0354	1.0251	0.9505	0.9448
3.1.3 累计期末指标	2025 年末		2024 年末		2023 年末	
基金份额累计净值增长率	37.76%	35.84%	3.54%	2.51%	-4.95%	-5.52%

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

2、期末可供分配利润的计算方法：如果期末未分配利润的未实现部分为正数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润的已实现部分；如果期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润（已实现部分相抵未实现部分）。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

中信建投中证 1000 指数增强 A 净值表现

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	1.65%	0.91%	0.30%	1.07%	1.35%	-0.16%
过去六个月	18.86%	0.89%	18.46%	1.05%	0.40%	-0.16%
过去一年	33.05%	1.19%	26.15%	1.32%	6.90%	-0.13%
过去三年	46.57%	1.42%	21.08%	1.48%	25.49%	-0.06%

自基金合同生效起至今	37.76%	1.36%	9.34%	1.45%	28.42%	-0.09%
------------	--------	-------	-------	-------	--------	--------

中信建投中证 1000 指数增强 C 净值表现

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	1.54%	0.91%	0.30%	1.07%	1.24%	-0.16%
过去六个月	18.62%	0.89%	18.46%	1.05%	0.16%	-0.16%
过去一年	32.51%	1.19%	26.15%	1.32%	6.36%	-0.13%
过去三年	44.82%	1.42%	21.08%	1.48%	23.74%	-0.06%
自基金合同生效起至今	35.84%	1.36%	9.34%	1.45%	26.50%	-0.09%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



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

(2022年06月28日-2025年12月31日)



3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较





注：基金合同生效当年按实际存续期计算, 不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

无。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

中信建投基金管理有限公司（以下简称“中信建投基金”）于 2013 年 9 月 9 日在北京成立，注册资本 4.5 亿元，中信建投证券股份有限公司全资控股。中信建投基金主要经营公开募集证券投资基金募集、销售、管理，特定客户资产管理以及中国证监会许可的其他业务。

截至报告期末，中信建投基金在管公募证券投资基金共 68 个。

中信建投基金以公募基金为业务本源，以专户业务为服务抓手，加强投研体系建设，注重核心投资人才的积累、培养，不断提升主动投资管理能力。同时，中信建投基金加强客户体系建设，积极拓展渠道，加大与国有大行、股份制银行、证券公司以及保险机构的合作力度。中信建投基金各项业务有序开展，为进一步发展奠定了良好的基础。

中信建投基金作为基金管理公司，秉承“忠于信，健于投”，追求以稳健的投资，回馈于客户的信任；致力于经过长期努力，打造具有影响力的品牌。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经	证	说明
----	----	----------	---	----

		理（助理）期限		券 从 业 年 限	
		任职日期	离任日期		
王鹏	本基金的基金经理	2022-06-28	-	10 年	中国籍，哥伦比亚大学统计学硕士。曾任中财期货分析师、LCM Commodities 研究员、CIBC World Market 期权交易员、中金基金管理有限公司量化投资副总经理、中金睿投投资管理有限公司量化投资副总经理、中信建投证券股份有限公司量化投资总监。2019 年 2 月加入中信建投基金管理有限公司，曾任权益投资部-指数与量化投资部负责人、总监，现任本公司指数与量化投资部基金经理，担任中信建投中证 500 指数增强型证券投资基金、中信建投量化进取 6 个月持有期混合型证券投资基金、中信建投量化精选 6 个月持有期混合型证券投资基金、中信建投中证 1000 指数增强型证券投资基金、中信建投沪深 300 指数增强型证券投资基金、中信建投红利智选混合型证券投资基金、中信建投量化选股股票型证券投资基金、中信建投中证 A500 指数增强型证券投资基金基金经理。

注：1、基金经理/基金经理助理任职日期、离任日期根据基金管理人对外披露的任免日期填写。首任基金经理，任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从行业协会相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》《公开募集证券投资基金运作管理办法》《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》、基金合同和其他有关法律法规，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，没有损害基金份额持有人利益。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法规制定了《中信建投基金管理有限公司公平交易管理办法》。公司通过科学、制衡的投资决策体系，加强交易分配环节的内部控制，并通过工作制度、流程和技术手段保证公平交易原则的实现。同时，通过监察稽核、事后分析和信息披露来保证公平交易过程和结果的监督。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》，完善相应制度及流程，通过系统和人工等各种方式在各业务环节严格控制交易公平执行。公司通过对不同时间窗口下的不同组合间股票和债券的同向交易进行价差分析，交易时机、交易价差和交易数量均可合理解释，未发现不同投资组合之间存在非公平交易的情况。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本报告期内，未出现涉及本基金的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的情况。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2025 年 A 股市场整体呈现震荡运行特征，在宏观经济修复节奏、政策预期变化以及海外流动性环境波动等因素影响下，市场风格出现阶段性轮动。整体来看，个股分化仍然较为明显，为量化选股策略获取超额收益提供了一定空间，但市场波动与风格切换也对模型稳定性提出了更高要求。

报告期内，本基金继续坚持指数增强投资策略，在严格控制组合相对指数跟踪误差的前提下，通过量化选股模型力争获取稳定超额收益。组合整体保持与标的指数较高相关性，同时在风险预算范围内进行适度主动配置。

在选股模型方面，本基金持续运行多因子选股体系，因子主要涵盖盈利质量、成长能力、估值水平以及量价行为等维度。报告期内，管理人结合市场环境变化对部分因子结构进行了适度优化，并加强了对因子稳定性与拥挤度的监测，以提升模型在不同市场环境下的适应能力。

在组合构建方面，本基金通过量化优化方法进行系统化配置，在控制行业偏离、风格暴露及个股权重的前提下，力求提升组合的风险收益比。同时通过适度分散持仓以降低个股波动对组合的影响。

在风险管理方面，本基金持续监控组合行业与风格暴露，动态调整风险预算，在市场波动阶段加强组合回撤控制，整体保持了相对稳健的运行状态。

整体来看，报告期内本基金在保持指数跟踪效果稳定的基础上，通过量化模型获取了一定的超额收益。未来管理人将继续优化模型与组合管理体系，以提升策略的稳定性与持续获取超额收益的

能力。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至报告期末中信建投中证 1000 指数增强 A 基金份额净值为 1.3776 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 33.05%，同期业绩比较基准收益率为 26.15%；截至报告期末中信建投中证 1000 指数增强 C 基金份额净值为 1.3584 元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为 32.51%，同期业绩比较基准收益率为 26.15%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望未来，短期来看，A 股市场预计仍将维持震荡运行格局。宏观经济处于逐步修复阶段，政策环境整体保持稳健，市场风险偏好有望在基本面改善与政策预期推动下逐步修复。但在海外经济周期变化及全球流动性环境仍存在不确定性的背景下，市场波动可能仍将维持在一定水平。

从基本面角度看，随着需求逐步企稳以及部分行业供给结构持续优化，企业盈利有望逐步改善。与此同时，资本市场改革持续推进，长期资金入市及市场制度不断完善，将有助于提升市场定价效率和市场稳定性。

对于量化投资而言，市场结构性分化仍将为量化选股策略提供超额收益来源，但市场风格变化也要求策略持续进行模型优化与风险管理。未来，本基金将继续在严格控制跟踪误差和组合风险暴露的前提下，通过持续优化量化模型与组合管理体系，力争实现稳定的指数增强效果。

中长期来看，在经济结构转型与资本市场制度持续完善的背景下，中国资本市场仍具备较好的配置价值，市场长期发展基础依然稳固。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术；建立了估值委员会，由公司分管运营领导任估值委员会主任，委员包括权益投资相关部门、固定收

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

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

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

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配，符合相关法律及基金合同的规定。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本基金本报告期未发生连续二十个工作日基金份额持有人数量不满 200 人或者基金资产净值低于 5000 万元的情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对中信建投中证 1000 指数增强型证券投资基金报告期的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，中信建投基金管理有限公司在中信建投中证 1000 指数增强型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，中信建投基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的报告期内的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基

金持有人利益的行为。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	安永华明（2026）审字第 70069507_A38 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	中信建投中证 1000 指数增强型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了中信建投中证 1000 指数增强型证券投资基金的财务报表，包括 2025 年 12 月 31 日的资产负债表，2025 年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的中信建投中证 1000 指数增强型证券投资基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则的规定编制，公允反映了中信建投中证 1000 指数增强型证券投资基金 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照《中国注册会计师独立性准则第 1 号——财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》和中国注册会计师职业道德守则，我们独立于中信建投中证 1000 指数增强型证券投资基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们在审计中遵循了对公众利益实体审计的独立性要求。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	中信建投中证 1000 指数增强型证券投资基金管理层对其他信息负责。其他信息包括年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大

	错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	管理层负责按照企业会计准则的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，管理层负责评估中信建投中证 1000 指数增强型证券投资基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非计划进行清算、终止运营或别无其他现实的选择。 治理层负责监督中信建投中证 1000 指数增强型证券投资基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： （1）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 （2）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 （3）评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 （4）对管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对中信建投中证 1000 指数增强型证券投资基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致中信建投中证 1000 指数增强型证券投资基金不能持续经营。 （5）评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。

会计师事务所的名称	安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）	
注册会计师的姓名	王珊珊	朱燕
会计师事务所的地址	北京市东城区东长安街 1 号东方广场安永大楼 17 层 01-12 室	
审计报告日期	2026-03-30	

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：中信建投中证 1000 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	7.4.7.1	53,811,366.36	27,512,201.55
结算备付金		3,305,155.84	437,594.56
存出保证金		4,149,849.60	-
交易性金融资产	7.4.7.2	304,996,868.97	337,931,329.44
其中：股票投资		304,996,868.97	337,931,329.44
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		300,666.00	1,151,154.69
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		366,563,906.77	367,032,280.24
负 债 和 净 资 产	附注号	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		2,489,185.14	2,170,193.12

应付管理人报酬		312,828.45	322,255.37
应付托管费		31,282.84	32,225.54
应付销售服务费		49,225.70	39,862.90
应付投资顾问费		-	-
应交税费		45,322.14	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	138,523.59	158,205.13
负债合计		3,066,367.86	2,722,742.06
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	265,291,969.24	352,979,840.70
未分配利润	7.4.7.8	98,205,569.67	11,329,697.48
净资产合计		363,497,538.91	364,309,538.18
负债和净资产总计		366,563,906.77	367,032,280.24

注：报告截止日 2025 年 12 月 31 日，基金份额总额 265,291,969.24 份，其中中信建投中证 1000 指数增强 A 类基金份额净值 1.3776 元，基金份额 162,168,362.93 份；中信建投中证 1000 指数增强 C 类基金份额净值 1.3584 元，基金份额 103,123,606.31 份。

7.2 利润表

会计主体：中信建投中证 1000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
一、营业总收入		106,796,205.70	39,049,913.45
1. 利息收入		108,388.45	172,081.92
其中：存款利息收入	7.4.7.9	108,388.45	172,081.92
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）		91,576,397.55	44,865,106.93
其中：股票投资收益	7.4.7.10	86,690,331.95	39,410,311.56
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	94,571.60	168,454.74
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.12	-789.85	-
股利收益	7.4.7.13	4,792,283.85	5,286,340.63
其他投资收益		-	-

3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.14	14,527,820.76	-6,488,328.41
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.15	583,598.94	501,053.01
减：二、营业总支出		4,550,847.45	5,040,141.64
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	3,556,076.48	3,935,725.10
2. 托管费	7.4.10.2.2	355,607.71	393,572.52
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	495,519.03	547,908.03
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	7.4.7.16	-	-
7. 税金及附加		0.12	1.59
8. 其他费用	7.4.7.17	143,644.11	162,934.40
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		102,245,358.25	34,009,771.81
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		102,245,358.25	34,009,771.81
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		102,245,358.25	34,009,771.81

7.3 净资产变动表

会计主体：中信建投中证 1000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项 目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	352,979,840.70	11,329,697.48	364,309,538.18
二、本期期初净资产	352,979,840.70	11,329,697.48	364,309,538.18
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-87,687,871.46	86,875,872.19	-811,999.27
（一）、综合收益总额	-	102,245,358.25	102,245,358.25
（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）	-87,687,871.46	-15,369,486.06	-103,057,357.52
其中：1. 基金申购款	295,869,205.43	58,092,195.40	353,961,400.83
2. 基金赎回款	-383,557,076.89	-73,461,681.46	-457,018,758.35
（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	265,291,969.24	98,205,569.67	363,497,538.91
项 目	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日		

	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	467,538,321.18	-24,086,823.50	443,451,497.68
二、本期期初净资产	467,538,321.18	-24,086,823.50	443,451,497.68
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-114,558,480.48	35,416,520.98	-79,141,959.50
(一)、综合收益总额	-	34,009,771.81	34,009,771.81
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-114,558,480.48	1,406,749.17	-113,151,731.31
其中: 1. 基金申购款	289,329,215.40	-23,454,079.23	265,875,136.17
2. 基金赎回款	-403,887,695.88	24,860,828.40	-379,026,867.48
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	352,979,840.70	11,329,697.48	364,309,538.18

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署:

黄凌	张欣宇	谭保民
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

中信建投中证 1000 指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可(2022)913 号《关于准予中信建投中证 1000 指数增强型证券投资基金注册的批复》核准,由中信建投基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《中信建投中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币 1,293,974,558.36 元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2022)第 0480 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《中信建投中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2022 年 6 月 28 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 1,294,152,423.35 份基金份额,其中认购资金利息折合 177,864.99 份基金份额。本基金的基金管理人为中信建投基金管理有限公司,基金托管人为中信银行股份有限公司。

根据《中信建投中证 1000 指数增强型证券投资基金招募说明书》,本基金根据认购费、申购费、销售服务费收取方式等的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购时收取认购、申购费用而不收取销售服务费的基金份额,称为 A 类基金份额;从本类别基金资产中计提销售服务费而不收取认购、申购费用的基金份额,称为 C 类基金份额。本基金 A 类、C 类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同,本基金 A 类基金份额和 C 类基金份额将分别计算基金份额净值,计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《中信建投中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金主要投资于标的指数的成份股、备选成份股(含存托凭证)。为更好地实现投资目标，本基金的投资范围还可包括国内依法发行上市的其他股票(含创业板及其他经中国证监会允许上市的其他股票、存托凭证)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、证券公司短期公司债券、公开发行的次级债券、政府支持债券、政府支持机构债券、地方政府债券、可转换债券(含分离交易可转债)、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、债券回购、同业存单、银行存款(包括协议存款、定期存款及其他银行存款)、货币市场工具、股指期货、国债期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会相关规定)。本基金可以根据有关法律法规的规定参与融资及转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金的投资组合比例为：本基金股票(含存托凭证)资产占基金资产的比例为 80%-95%，投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于非现金基金资产的 80%。每个交易日日终在扣除股指期货合约、国债期货合约需缴纳的交易保证金以后，本基金保持的现金(不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等)或投资于到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为：中证 1000 指数收益率×95%+中证综合债指数收益率×5%。

7.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金于 2025 年 12 月 31 日的财务状况以及 2025 年度的经营成果和净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

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

7.4.4.2 记账本位币

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

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

（1）金融资产分类

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

（2）金融负债分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

本基金于成为金融工具合同的一方时确认一项金融资产或金融负债。

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

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

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

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

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

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

本基金计量金融工具预期信用损失的方法反映的因素包括：通过评价一系列可能的结果而确定

的无偏概率加权平均金额、货币时间价值，以及在估值日无须付出不必要的额外成本或努力即可获得有关过去事项、当前状况以及未来经济状况预测的合理且有依据的信息；

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

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

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

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

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

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

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

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

（1）存在活跃市场的金融工具，按照估值日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价作为公允价值；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，应采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，应对报价进行调整，确定公允价值。

与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值

技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

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

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

(4) 如有新增事项，按国家最新规定估值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

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

(2) 交易性金融资产在买入/卖出的成交日发生的交易费用，计入投资收益；

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

处置交易性金融资产的投资收益于成交日确认，并按成交金额与该交易性金融资产的账面余额

的差额扣除适用情况下的相关税费后的净额入账，同时转出已确认的公允价值变动收益；

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

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

（5）买入返售金融资产收入，按实际利率法确认利息收入，在回购期内逐日计提；

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 分部报告

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：

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

如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期无会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

7.4.6 税项

(1) 印花税

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

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

(2) 增值税

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

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

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

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

根据财政部、国家税务总局财税〔2017〕56 号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，自 2018 年 1 月 1 日起，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为（以下简称“资管产品运营业务”），暂适用简易计税方法，按照 3% 的征收率缴纳增值税，资管产品管理人未分别核算资管产品运营业务和其他业务的销售额和增值税应纳税额的除外。资管产品管理人可选择分别或汇总核算资管产品运营业务销售额和增值税应纳税额。对资管产品在 2018 年 1 月 1 日前运营过程

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，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减；

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

根据财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期；

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

（3）企业所得税

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

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

（4）个人所得税

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

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

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
活期存款	2,638,442.41	5,326,250.90
等于：本金	2,637,660.14	5,325,185.85
加：应计利息	782.27	1,065.05
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	51,172,923.95	22,185,950.65
等于：本金	51,168,403.41	22,184,258.10
加：应计利息	4,520.54	1,692.55
减：坏账准备	-	-
合计	53,811,366.36	27,512,201.55

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2025 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		302,379,673.48	-	304,996,868.97	2,617,195.49
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		302,379,673.48	-	304,996,868.97	2,617,195.49
项目		上年度末 2024 年 12 月 31 日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		348,472,676.85	-	337,931,329.44	-10,541,347.41
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-

资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	348,472,676.85	-	337,931,329.44	-10,541,347.41

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 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	33,167,480.00	-	-	-
——股指期货	33,167,480.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	33,167,480.00	-	-	-
项目	上年度末 2024 年 12 月 31 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	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-

7.4.7.3.2 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
IM2606	中证 1000 股指期货 2606 合约	24	34,582,080.00	1,414,600.00
合计				1,414,600.00
减：可抵销期货暂收款				1,414,600.00
净额				-

注：在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持国债期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的国债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。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

7.4.7.5 其他资产

无余额。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	523.59	205.13
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	138,000.00	158,000.00
合计	138,523.59	158,205.13

7.4.7.7 实收基金

中信建投中证 1000 指数增强 A

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	239,216,150.30	239,216,150.30
本期申购	111,743,257.92	111,743,257.92
本期赎回（以“-”号填列）	-188,791,045.29	-188,791,045.29
本期末	162,168,362.93	162,168,362.93

中信建投中证 1000 指数增强 C

金额单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	113,763,690.40	113,763,690.40
本期申购	184,125,947.51	184,125,947.51
本期赎回（以“-”号填列）	-194,766,031.60	-194,766,031.60
本期末	103,123,606.31	103,123,606.31

注：申购含红利再投、转换入、级别调整入份额；赎回含转换出、级别调整出份额（如适用）。

7.4.7.8 未分配利润

中信建投中证 1000 指数增强 A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	24,974,216.73	-16,498,471.25	8,475,745.48
本期期初	24,974,216.73	-16,498,471.25	8,475,745.48
本期利润	57,468,160.51	9,843,552.30	67,311,712.81
本期基金份额交易产生的变动数	-16,551,515.70	2,006,164.99	-14,545,350.71
其中：基金申购款	25,231,508.77	-2,846,075.08	22,385,433.69
基金赎回款	-41,783,024.47	4,852,240.07	-36,930,784.40
本期已分配利润	-	-	-
本期末	65,890,861.54	-4,648,753.96	61,242,107.58

中信建投中证 1000 指数增强 C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	10,645,520.58	-7,791,568.58	2,853,952.00
本期期初	10,645,520.58	-7,791,568.58	2,853,952.00
本期利润	30,249,376.98	4,684,268.46	34,933,645.44
本期基金份额交易产生的变动数	-980,009.50	155,874.15	-824,135.35
其中：基金申购款	40,708,913.49	-5,002,151.78	35,706,761.71
基金赎回款	-41,688,922.99	5,158,025.93	-36,530,897.06
本期已分配利润	-	-	-
本期末	39,914,888.06	-2,951,425.97	36,963,462.09

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
活期存款利息收入	31,069.32	39,188.84
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	72,680.40	86,690.69
结算备付金利息收入	3,600.73	45,117.60
其他	1,038.00	1,084.79
合计	108,388.45	172,081.92

7.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
卖出股票成交总额	3,640,399,578.16	4,402,683,226.97
减：卖出股票成本总额	3,550,067,066.08	4,357,786,912.64
减：交易费用	3,642,180.13	5,486,002.77
买卖股票差价收入	86,690,331.95	39,410,311.56

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
债券投资收益——利息收入	43.91	510.10
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	94,527.69	167,944.64
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	94,571.60	168,454.74

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	337,586.42	786,073.33
减：卖出债券（债转股及债券到	243,000.00	617,500.00

期兑付) 成本总额		
减: 应计利息总额	45. 14	596. 53
减: 交易费用	13. 59	32. 16
买卖债券差价收入	94, 527. 69	167, 944. 64

7.4.7.12 衍生工具收益

7.4.7.12.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

7.4.7.12.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位: 人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
期货投资	-789. 85	-

7.4.7.13 股利收益

单位: 人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	4, 792, 283. 85	5, 286, 340. 63
其中: 证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	4, 792, 283. 85	5, 286, 340. 63

7.4.7.14 公允价值变动收益

单位: 人民币元

项目名称	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	13, 158, 542. 90	-6, 488, 328. 41
——股票投资	13, 158, 542. 90	-6, 479, 933. 47
——债券投资	-	-8, 394. 94
——资产支持证券投资	-	-
——基金投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	1, 414, 600. 00	-
——权证投资	-	-
——期货投资	1, 414, 600. 00	-
3. 其他	-	-
减: 应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	45, 322. 14	-

合计	14,527,820.76	-6,488,328.41
----	---------------	---------------

7.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	580,690.35	492,941.48
转换费收入	2,908.59	8,111.53
合计	583,598.94	501,053.01

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额中归入基金资产的比例按持有期间递减且不低于 25%。

7.4.7.16 信用减值损失

无。

7.4.7.17 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
审计费用	18,000.00	38,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
汇划手续费	5,644.11	4,934.40
合计	143,644.11	162,934.40

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无重大资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
中信建投基金管理有限公司	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
中信银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
中信建投证券股份有限公司	基金管理人的股东、基金销售机构
中信建投利信资本管理（北京）有限公司	基金管理人的子公司
中信建投期货有限公司	与基金管理人同一控股股东、基金销售机构

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中信建投证券股份有限公司	5,589,629,858.85	78.25%	6,089,163,166.39	69.98%

7.4.10.1.2 权证交易

无。

7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
中信建投证券股份有限公司	260,935.76	77.29%	413,464.26	52.60%

7.4.10.1.4 债券回购交易

无。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中信建投证券股份有限公司	1,074,635.77	78.13%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
中信建投证券股份有限公司	1,817,643.47	66.66%	-	-

注：1、上述佣金按本基金的基金管理人与对方协商确定的佣金率计算，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司代收的证管费和经手费的净额列示。

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

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的管理费	3,556,076.48	3,935,725.10
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,464,050.81	1,698,024.16
应支付基金管理人的净管理费	2,092,025.67	2,237,700.94

注：支付基金管理人中信建投基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.00%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日管理人报酬＝前一日基金资产净值×1.00%/当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日
当期发生的基金应支付的托管费	355,607.71	393,572.52

注：支付基金托管人中信银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值 0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：

日托管费＝前一日基金资产净值×0.10%/当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中信建投中证 1000 指数增强 A	中信建投中证 1000 指数增强 C	合计
中信建投基金管理有限公司	-	2,743.94	2,743.94

中信建投证券股份有限公司	-	271,463.17	271,463.17
中信银行股份有限公司	-	22,989.76	22,989.76
合计	-	297,196.87	297,196.87
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中信建投中证 1000 指数增强 A	中信建投中证 1000 指数增强 C	合计
中信银行股份有限公司	-	42,812.45	42,812.45
中信建投基金管理有限公司	-	20,136.99	20,136.99
中信建投证券股份有限公司	-	208,179.68	208,179.68
合计	-	271,129.12	271,129.12

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日 C 类基金份额的基金资产净值 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给中信建投基金管理有限公司，再由中信建投基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费 = 前一日 C 类的基金资产净值 × 0.40% / 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

无。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

无。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日		上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中信银行股份有限公司-托管户	2,638,442.41	31,069.32	5,326,250.90	39,188.84
中信建投证券股份有限公司-证券户	27,648,409.15	46,701.88	14,821,840.82	43,019.25

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

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
中信建投证券股份有限公司	601026	道生天合	网下配售	4,503	26,927.94
上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：股/张）	总金额
-	-	-	-	-	-

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

7.4.11 利润分配情况

无。

7.4.12 期末（2025 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：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
301656	联合动力	2025 年 09 月 17 日	6 个月	创业板新股限售	12.48	25.46	2,699	33,683.52	68,716.54	-
301638	南网数字	2025 年 11 月 11 日	6 个月	创业板新股限售	5.69	14.21	1,598	9,092.62	22,707.58	-
001386	马可波罗	2025 年 10 月 15 日	6 个月	股票流通受限	13.75	18.53	1,064	14,630.00	19,715.92	-
688807	优迅股	2025 年 12 月 10 日	6 个月	科创板新股限售	51.66	135.56	131	6,767.46	17,758.36	-

	份			售						
688796	百奥赛图	2025 年 12 月 02 日	6 个月	科创板新股限售	26.68	42.25	378	10,085.04	15,970.50	-
001233	海安集团	2025 年 11 月 18 日	6 个月	股票流通受限	48.00	51.88	263	12,624.00	13,644.44	-
301687	新广益	2025 年 12 月 24 日	6 个月	创业板新股限售	21.93	54.39	195	4,276.35	10,606.05	-
301667	纳百川	2025 年 12 月 10 日	6 个月	创业板新股限售	22.63	57.07	151	3,417.13	8,617.57	-
688805	健信超导	2025 年 12 月 17 日	6 个月	科创板新股限售	18.58	32.37	265	4,923.70	8,578.05	-
001369	双欣环保	2025 年 12 月 23 日	6 个月	股票流通受限	6.85	12.89	665	4,555.25	8,571.85	-
601026	道生天合	2025 年 10 月 09 日	6 个月	股票流通受限	5.98	14.28	451	2,696.98	6,440.28	-
001285	瑞立科密	2025 年 09 月 23 日	6 个月	股票流通受限	42.28	56.08	101	4,270.28	5,664.08	-
603248	锡华科技	2025 年 12 月 16 日	6 个月	股票流通受限	10.10	16.30	260	2,626.00	4,238.00	-
001396	誉帆科技	2025 年 12 月 23 日	6 个月	股票流通受限	22.29	35.39	69	1,538.01	2,441.91	-

注：1、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股中需要限售的部分或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市

后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

2、基金参与上市公司向特定对象发行股票所获得的股票，自发行结束之日起 6 个月内不得转让。

3、基金作为特定投资者，认购首次公开发行股票时公司股东公开发售股份，所认购的股份自发行结束之日起 12 个月内不得转让。

4、基金通过询价转让受让的科创板股份，在受让后 6 个月内不得转让。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

无。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常经营活动中涉及的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金管理人的风险管理机构由董事会下属的公司风险控制与合规委员会、督察长、公司风险管理委员会、风险管理部以及各个业务部门组成。公司实行全面、系统的风险管理，风险管理覆盖公司所有战略环节、业务环节和操作环节。同时制定了系统化的风险管理程序，对风险管理的整个流程进行评估和改进。本基金的基金管理人在董事会下设立风险控制与合规委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面，由风险管理部负责协调并与各部门合作完成运作风险管理。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性和定量相结合的分析方法去评估各种风险发生的可能性及其发生可能给基金资产造成的损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制可在承受的范围之内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

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

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

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无余额。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无余额。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无余额。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

无余额。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无余额。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无余额。

7.4.13.3 流动性风险

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

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

于本期末，除附注 7.4.12.3 中列示的卖出回购金融资产款余额（如有）将在一个月以内到期且计息（该利息金额不重大）外，本基金所承担的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（净资产）无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2025 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	53,811,366.36	-	-	-	53,811,366.36
结算备付金	3,305,155.84	-	-	-	3,305,155.84
存出保证金	-	-	-	4,149,849.60	4,149,849.60

交易性金融资产	-	-	-	304,996,868.97	304,996,868.97
应收申购款	-	-	-	300,666.00	300,666.00
资产总计	57,116,522.20	-	-	309,447,384.57	366,563,906.77
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,489,185.14	2,489,185.14
应付管理人报酬	-	-	-	312,828.45	312,828.45
应付托管费	-	-	-	31,282.84	31,282.84
应付销售服务费	-	-	-	49,225.70	49,225.70
应交税费	-	-	-	45,322.14	45,322.14
其他负债	-	-	-	138,523.59	138,523.59
负债总计	-	-	-	3,066,367.86	3,066,367.86
利率敏感度缺口	57,116,522.20	-	-	306,381,016.71	363,497,538.91
上年度末 2024 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	27,512,201.55	-	-	-	27,512,201.55
结算备付金	437,594.56	-	-	-	437,594.56
交易性金融资产	-	-	-	337,931,329.44	337,931,329.44
应收申购款	-	-	-	1,151,154.69	1,151,154.69
资产总计	27,949,796.11	-	-	339,082,484.13	367,032,280.24
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,170,193.12	2,170,193.12
应付管理人报酬	-	-	-	322,255.37	322,255.37
应付托管费	-	-	-	32,225.54	32,225.54
应付销售服务费	-	-	-	39,862.90	39,862.90
其他负债	-	-	-	158,205.13	158,205.13
负债总计	-	-	-	2,722,742.06	2,722,742.06
利率敏感度缺口	27,949,796.11	-	-	336,359,742.07	364,309,538.18

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于本期末及上年度末，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金净资产的比例并不重大，

因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025 年 12 月 31 日		上年度末 2024 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	304,996,868.97	83.91	337,931,329.44	92.76
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	304,996,868.97	83.91	337,931,329.44	92.76

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
	业绩比较基准上升 5%	16,021,761.77	17,669,893.53
	业绩比较基准下降 5%	-16,021,761.77	-17,669,893.53

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

- 第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。
- 第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。
- 第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025 年 12 月 31 日	上年度末 2024 年 12 月 31 日
第一层次	304,783,197.84	337,931,329.44
第二层次	-	-
第三层次	213,671.13	-
合计	304,996,868.97	337,931,329.44

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

对于公开市场交易的证券、基金等投资，若出现交易不活跃（包括重大事项停牌、境内股票涨跌停等导致的交易不活跃）和非公开发行等情况，本基金不会于交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2025 年 01 月 01 日至 2025 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	115,186.34	115,186.34
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	98,484.79	98,484.79
其中：计入损益的利得或损失	-	98,484.79	98,484.79
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	213,671.13	213,671.13
期末仍持有的第三层	-	98,484.79	98,484.79

次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益			
项目	上年度可比期间 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 12 月 31 日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	-	-
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	-	-
其中：计入损益的利得或损失	-	-	-
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	-	-
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-	-

注：于 2025 年 12 月 31 日，本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。于 2025 年度，本基金从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资。

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

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

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
流通受限股票	213,671.13	平均价格 亚式期权模型	预期波动率	33.77%-303.23%	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

本基金本报告期末及上年度末均未持有非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

7.4.15.1 承诺事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的承诺事项。

7.4.15.2 其他事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的其他重要事项。

7.4.15.3 财务报表的批准

本财务报表已于 2026 年 3 月 30 日经本基金的基金管理人批准。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	304,996,868.97	83.20
	其中：股票	304,996,868.97	83.20
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	57,116,522.20	15.58
8	其他各项资产	4,450,515.60	1.21
9	合计	366,563,906.77	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	2,537,608.40	0.70
C	制造业	183,382,061.30	50.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,532,788.00	3.45

E	建筑业	2,799,799.00	0.77
F	批发和零售业	8,573,641.00	2.36
G	交通运输、仓储和邮政业	11,057,555.00	3.04
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	28,111,967.73	7.73
J	金融业	11,983,124.11	3.30
K	房地产业	4,799,685.00	1.32
L	租赁和商务服务业	7,541,747.00	2.07
M	科学研究和技术服务业	2,227,483.00	0.61
N	水利、环境和公共设施管理业	3,047,573.00	0.84
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,586,585.00	0.44
R	文化、体育和娱乐业	3,045,845.00	0.84
S	综合	-	-
	合计	283,227,462.54	77.92

8.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	285,656.00	0.08
B	采矿业	71,604.00	0.02
C	制造业	15,862,757.30	4.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	807,693.00	0.22
E	建筑业	294,412.00	0.08
F	批发和零售业	512,113.00	0.14
G	交通运输、仓储和邮政业	220,908.00	0.06
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,416,257.72	0.39
J	金融业	367,962.00	0.10
K	房地产业	810,307.00	0.22
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	378,690.41	0.10
N	水利、环境和公共设施管理业	72,750.00	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	143,767.00	0.04
Q	卫生和社会工作	84,366.00	0.02
R	文化、体育和娱乐业	440,163.00	0.12
S	综合	-	-
	合计	21,769,406.43	5.99

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无余额。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600478	科力远	344,500	2,373,605.00	0.65
2	000600	建投能源	277,200	2,364,516.00	0.65
3	600114	东睦股份	76,700	2,343,185.00	0.64
4	002004	华邦健康	473,200	2,261,896.00	0.62
5	600782	新钢股份	573,400	2,224,792.00	0.61
6	002073	软控股份	269,900	2,199,685.00	0.61
7	600986	浙文互联	281,000	2,197,420.00	0.60
8	000686	东北证券	232,083	2,163,013.56	0.60
9	600458	时代新材	161,700	2,145,759.00	0.59
10	600335	国机汽车	324,400	2,111,844.00	0.58
11	600361	创新新材	494,700	2,097,528.00	0.58
12	000672	上峰水泥	160,800	2,088,792.00	0.57
13	000589	贵州轮胎	403,000	2,087,540.00	0.57
14	000990	诚志股份	260,500	2,063,160.00	0.57
15	601677	明泰铝业	137,600	2,035,104.00	0.56
16	002010	传化智联	345,500	2,007,355.00	0.55
17	002807	江阴银行	437,300	1,998,461.00	0.55
18	600273	嘉化能源	225,100	1,967,374.00	0.54
19	300224	正海磁材	126,400	1,954,144.00	0.54
20	300415	伊之密	74,700	1,946,682.00	0.54
21	000927	中国铁物	744,800	1,943,928.00	0.53
22	002101	广东鸿图	157,700	1,942,864.00	0.53
23	600120	浙江东方	314,800	1,942,316.00	0.53
24	002668	TCL 智家	186,800	1,938,984.00	0.53
25	000612	焦作万方	175,522	1,934,252.44	0.53
26	600572	康恩贝	430,200	1,918,692.00	0.53
27	600933	爱柯迪	95,400	1,917,540.00	0.53
28	300409	道氏技术	84,700	1,904,903.00	0.52
29	002354	天娱数科	298,800	1,903,356.00	0.52
30	000555	神州信息	114,500	1,894,975.00	0.52
31	000597	东北制药	361,900	1,889,118.00	0.52
32	300319	麦捷科技	161,300	1,885,597.00	0.52
33	002048	宁波华翔	59,800	1,881,308.00	0.52
34	002091	江苏国泰	208,200	1,880,046.00	0.52
35	002545	东方铁塔	101,800	1,878,210.00	0.52
36	600022	山东钢铁	1,241,200	1,874,212.00	0.52

37	601678	滨化股份	441,000	1,869,840.00	0.51
38	002588	史丹利	186,800	1,864,264.00	0.51
39	600315	上海家化	82,600	1,860,152.00	0.51
40	000422	湖北宜化	130,800	1,858,668.00	0.51
41	000778	新兴铸管	444,200	1,856,756.00	0.51
42	600575	淮河能源	544,600	1,851,640.00	0.51
43	300850	新强联	44,600	1,845,102.00	0.51
44	000848	承德露露	214,860	1,826,310.00	0.50
45	000012	南玻A	409,282	1,813,119.26	0.50
46	600094	大名城	434,100	1,805,856.00	0.50
47	002011	盾安环境	141,200	1,790,416.00	0.49
48	000810	创维数字	151,400	1,783,492.00	0.49
49	300113	顺网科技	85,300	1,726,472.00	0.47
50	300296	利亚德	272,100	1,719,672.00	0.47
51	000059	华锦股份	315,300	1,686,855.00	0.46
52	002292	奥飞娱乐	187,700	1,661,145.00	0.46
53	000035	中国天楹	294,400	1,625,088.00	0.45
54	002839	张家港行	354,700	1,620,979.00	0.45
55	300428	立中集团	69,400	1,620,490.00	0.45
56	300257	开山股份	114,400	1,607,320.00	0.44
57	601975	招商南油	531,400	1,604,828.00	0.44
58	600789	鲁抗医药	177,100	1,600,984.00	0.44
59	600125	铁龙物流	248,400	1,599,696.00	0.44
60	002015	协鑫能科	160,500	1,596,975.00	0.44
61	600507	方大特钢	270,900	1,595,601.00	0.44
62	300244	迪安诊断	100,100	1,586,585.00	0.44
63	300171	东富龙	99,500	1,562,150.00	0.43
64	002468	申通快递	114,900	1,541,958.00	0.42
65	002023	海特高新	113,300	1,534,082.00	0.42
66	002434	万里扬	160,800	1,532,424.00	0.42
67	001914	招商积余	142,700	1,524,036.00	0.42
68	000543	皖能电力	190,500	1,514,475.00	0.42
69	000935	四川双马	60,700	1,507,788.00	0.41
70	000650	仁和药业	266,400	1,505,160.00	0.41
71	000791	甘肃能源	232,400	1,498,980.00	0.41
72	000899	赣能股份	150,700	1,491,930.00	0.41
73	600100	同方股份	160,400	1,430,768.00	0.39
74	002063	远光软件	233,700	1,418,559.00	0.39
75	000581	威孚高科	66,900	1,379,478.00	0.38
76	002079	苏州固锝	142,800	1,363,740.00	0.38
77	300682	朗新科技	89,200	1,356,732.00	0.37
78	600328	中盐化工	158,700	1,307,688.00	0.36
79	603866	桃李面包	247,100	1,299,746.00	0.36

80	600158	中体产业	148,500	1,296,405.00	0.36
81	000966	长源电力	300,600	1,283,562.00	0.35
82	002127	南极电商	378,200	1,274,534.00	0.35
83	002216	三全食品	112,600	1,271,254.00	0.35
84	000923	河钢资源	59,620	1,262,155.40	0.35
85	603218	日月股份	94,900	1,257,425.00	0.35
86	002649	博彦科技	90,200	1,189,738.00	0.33
87	601311	骆驼股份	127,800	1,171,926.00	0.32
88	002612	朗姿股份	56,700	1,158,948.00	0.32
89	002174	游族网络	92,900	1,137,096.00	0.31
90	300861	美畅股份	73,400	1,095,862.00	0.30
91	603220	中贝通信	51,300	1,092,690.00	0.30
92	000767	晋控电力	386,100	1,081,080.00	0.30
93	600017	日照港	349,900	1,049,700.00	0.29
94	300008	天海防务	128,700	1,015,443.00	0.28
95	688700	东威科技	28,200	994,896.00	0.27
96	601890	亚星锚链	96,600	994,014.00	0.27
97	301029	怡合达	37,200	986,544.00	0.27
98	688372	伟测科技	8,600	938,174.00	0.26
99	603118	共进股份	80,760	928,740.00	0.26
100	300130	新国都	33,400	926,182.00	0.25
101	600710	苏美达	84,800	916,688.00	0.25
102	300357	我武生物	30,600	867,510.00	0.24
103	600552	凯盛科技	69,800	865,520.00	0.24
104	600064	南京高科	98,600	855,848.00	0.24
105	600686	金龙汽车	47,700	846,198.00	0.23
106	002258	利尔化学	64,523	842,025.15	0.23
107	600810	神马股份	93,100	836,969.00	0.23
108	600667	太极实业	104,000	828,880.00	0.23
109	600718	东软集团	82,000	825,740.00	0.23
110	000928	中钢国际	123,800	818,318.00	0.23
111	600502	安徽建工	168,300	789,327.00	0.22
112	002239	奥特佳	262,900	783,442.00	0.22
113	600186	莲花控股	128,400	767,832.00	0.21
114	300738	奥飞数据	41,300	763,637.00	0.21
115	688088	虹软科技	15,400	762,300.00	0.21
116	301015	百洋医药	31,800	750,480.00	0.21
117	603876	鼎胜新材	49,900	748,999.00	0.21
118	300323	华灿光电	92,700	739,746.00	0.20
119	002993	奥海科技	16,800	734,328.00	0.20
120	002110	三钢闽光	167,000	733,130.00	0.20
121	301095	广立微	10,200	731,442.00	0.20
122	002897	意华股份	13,300	719,131.00	0.20

123	600643	爱建集团	124,600	689,038.00	0.19
124	603588	高能环境	88,800	685,536.00	0.19
125	601003	柳钢股份	135,000	679,050.00	0.19
126	688612	威迈斯	20,200	665,994.00	0.18
127	601375	中原证券	154,600	664,780.00	0.18
128	600480	凌云股份	53,700	659,973.00	0.18
129	300953	震裕科技	3,900	655,278.00	0.18
130	002396	星网锐捷	21,600	654,480.00	0.18
131	002815	崇达技术	47,800	652,948.00	0.18
132	300134	大富科技	52,000	650,000.00	0.18
133	600388	龙净环保	39,700	647,507.00	0.18
134	600320	振华重工	125,500	646,325.00	0.18
135	603236	移远通信	6,700	639,247.00	0.18
136	600490	鹏欣资源	82,500	637,725.00	0.18
137	600446	金证股份	40,000	636,800.00	0.18
138	600963	岳阳林纸	130,700	610,369.00	0.17
139	300232	洲明科技	85,500	606,195.00	0.17
140	603005	晶方科技	21,900	605,754.00	0.17
141	688185	康希诺	9,600	603,360.00	0.17
142	300925	法本信息	28,200	598,968.00	0.16
143	300226	上海钢联	23,800	597,856.00	0.16
144	002635	安洁科技	42,900	594,594.00	0.16
145	002518	科士达	12,200	591,944.00	0.16
146	688177	百奥泰	25,296	585,349.44	0.16
147	688262	国芯科技	19,100	579,685.00	0.16
148	002895	川恒股份	15,600	571,896.00	0.16
149	601126	四方股份	19,000	571,520.00	0.16
150	688123	聚辰股份	4,544	570,635.52	0.16
151	688591	泰凌微	13,400	570,304.00	0.16
152	605020	永和股份	21,100	567,379.00	0.16
153	688001	华兴源创	18,683	563,852.94	0.16
154	688639	华恒生物	17,200	560,376.00	0.15
155	600116	三峡水利	85,500	559,170.00	0.15
156	600155	华创云信	84,200	557,404.00	0.15
157	300573	兴齐眼药	7,900	555,291.00	0.15
158	002345	潮宏基	44,200	552,500.00	0.15
159	688352	颀中科技	43,741	551,574.01	0.15
160	603317	天味食品	43,900	549,628.00	0.15
161	605599	菜百股份	33,500	548,395.00	0.15
162	688522	纳睿雷达	13,719	547,799.67	0.15
163	600717	天津港	121,400	542,658.00	0.15
164	601020	华钰矿业	20,100	539,886.00	0.15
165	600057	厦门象屿	63,200	538,464.00	0.15

166	688153	唯捷创芯	14,200	534,488.00	0.15
167	002276	万马股份	31,600	534,356.00	0.15
168	601636	旗滨集团	88,800	526,584.00	0.14
169	688182	灿勤科技	17,596	519,433.92	0.14
170	688779	五矿新能	68,875	515,873.75	0.14
171	002399	海普瑞	43,400	511,686.00	0.14
172	600210	紫江企业	68,700	504,945.00	0.14
173	600649	城投控股	112,900	502,405.00	0.14
174	688515	裕太微	4,880	500,444.00	0.14
175	300613	富瀚微	10,800	497,448.00	0.14
176	600269	赣粤高速	94,900	492,531.00	0.14
177	601369	陕鼓动力	49,100	491,491.00	0.14
178	002690	美亚光电	23,400	481,338.00	0.13
179	600020	中原高速	110,900	472,434.00	0.13
180	000049	德赛电池	17,500	470,400.00	0.13
181	603009	北特科技	9,700	467,152.00	0.13
182	300031	宝通科技	20,300	461,419.00	0.13
183	688208	道通科技	11,592	426,585.60	0.12
184	600577	精达股份	33,000	410,190.00	0.11
185	002967	广电计量	18,400	404,984.00	0.11
186	688107	安路科技	14,862	403,949.16	0.11
187	000030	富奥股份	70,200	402,948.00	0.11
188	688380	中微半导	12,158	390,879.70	0.11
189	688403	汇成股份	23,303	381,703.14	0.11
190	000917	电广传媒	36,600	376,248.00	0.10
191	300088	长信科技	61,900	375,114.00	0.10
192	000676	智度股份	43,400	374,542.00	0.10
193	688498	源杰科技	580	372,354.20	0.10
194	688321	微芯生物	12,741	372,292.02	0.10
195	688252	天德钰	17,500	370,475.00	0.10
196	001308	康冠科技	17,700	369,222.00	0.10
197	600331	宏达股份	28,600	365,794.00	0.10
198	688062	迈威生物	9,500	365,465.00	0.10
199	000829	天音控股	33,400	364,394.00	0.10
200	688686	奥普特	2,900	359,977.00	0.10
201	301339	通行宝	24,400	354,776.00	0.10
202	600006	东风股份	49,200	353,256.00	0.10
203	688209	英集芯	17,674	352,419.56	0.10
204	300674	宇信科技	14,500	351,770.00	0.10
205	688127	蓝特光学	9,100	350,259.00	0.10
206	002516	旷达科技	52,800	347,952.00	0.10
207	688739	成大生物	13,400	345,184.00	0.09
208	688362	甬矽电子	10,576	342,768.16	0.09

209	600827	百联股份	38,100	342,519.00	0.09
210	300580	贝斯特	12,900	339,141.00	0.09
211	688484	南芯科技	8,300	337,478.00	0.09
212	002698	博实股份	19,900	334,519.00	0.09
213	688091	上海谊众	7,100	333,700.00	0.09
214	300693	盛弘股份	8,700	333,036.00	0.09
215	603678	火炬电子	9,400	332,008.00	0.09
216	301087	可孚医疗	7,400	330,558.00	0.09
217	301606	绿联科技	5,600	328,944.00	0.09
218	300687	赛意信息	14,300	328,471.00	0.09
219	603456	九洲药业	18,300	327,570.00	0.09
220	000682	东方电子	27,600	327,336.00	0.09
221	002237	恒邦股份	24,300	326,106.00	0.09
222	300065	海兰信	17,900	325,243.00	0.09
223	603025	大豪科技	18,100	325,076.00	0.09
224	300131	英唐智控	22,100	323,986.00	0.09
225	002245	蔚蓝锂芯	18,200	323,960.00	0.09
226	601528	瑞丰银行	56,500	322,050.00	0.09
227	603323	苏农银行	63,651	321,437.55	0.09
228	002979	雷赛智能	7,600	319,732.00	0.09
229	002539	云图控股	27,000	319,140.00	0.09
230	600252	中恒集团	116,300	318,662.00	0.09
231	300602	飞荣达	9,600	318,336.00	0.09
232	603328	依顿电子	29,000	317,840.00	0.09
233	300463	迈克生物	28,400	317,796.00	0.09
234	603043	广州酒家	18,000	317,340.00	0.09
235	688206	概伦电子	9,100	316,953.00	0.09
236	600596	新安股份	27,500	315,425.00	0.09
237	688584	上海合晶	14,300	313,742.00	0.09
238	300185	通裕重工	110,400	313,536.00	0.09
239	600908	无锡银行	52,800	313,104.00	0.09
240	688567	孚能科技	20,000	313,000.00	0.09
241	603915	国茂股份	17,000	312,970.00	0.09
242	300183	东软载波	21,100	312,913.00	0.09
243	300068	南都电源	20,000	310,800.00	0.09
244	002268	电科网安	15,100	310,154.00	0.09
245	688063	派能科技	5,458	310,123.56	0.09
246	688443	智翔金泰	11,374	309,827.76	0.09
247	601096	宏盛华源	74,100	307,515.00	0.08
248	600869	远东股份	38,200	307,510.00	0.08
249	601900	南方传媒	22,800	305,748.00	0.08
250	600428	中远海特	43,000	305,300.00	0.08
251	600866	星湖科技	43,600	303,020.00	0.08

252	002906	华阳集团	9,900	302,742.00	0.08
253	002408	齐翔腾达	62,000	302,560.00	0.08
254	000761	本钢板材	90,100	301,835.00	0.08
255	301153	中科江南	12,200	301,584.00	0.08
256	600531	豫光金铅	25,500	299,625.00	0.08
257	600459	贵研铂业	16,100	299,621.00	0.08
258	601163	三角轮胎	20,900	298,661.00	0.08
259	002456	欧菲光	27,900	296,298.00	0.08
260	002948	青岛银行	65,900	295,232.00	0.08
261	300027	华谊兄弟	135,500	294,035.00	0.08
262	300098	高新兴	47,900	292,190.00	0.08
263	601609	金田股份	27,000	291,600.00	0.08
264	002536	飞龙股份	9,800	291,060.00	0.08
265	600894	广日股份	31,400	290,450.00	0.08
266	002006	精工科技	12,500	289,500.00	0.08
267	600063	皖维高新	49,000	288,610.00	0.08
268	600556	天下秀	47,400	287,718.00	0.08
269	603612	索通发展	12,200	286,700.00	0.08
270	601222	林洋能源	52,300	286,081.00	0.08
271	601963	重庆银行	26,400	285,912.00	0.08
272	600750	华润江中	12,300	284,991.00	0.08
273	600550	保变电气	27,000	284,850.00	0.08
274	688351	微电生理	12,300	284,745.00	0.08
275	688439	振华风光	4,400	284,240.00	0.08
276	603556	海兴电力	7,800	283,920.00	0.08
277	000403	派林生物	20,700	283,383.00	0.08
278	600993	马应龙	10,100	282,800.00	0.08
279	300352	北信源	46,100	282,593.00	0.08
280	688106	金宏气体	14,400	282,096.00	0.08
281	300702	天宇股份	11,900	280,840.00	0.08
282	002511	中顺洁柔	32,800	280,768.00	0.08
283	600461	洪城环境	30,200	279,954.00	0.08
284	600654	中安科	74,200	279,734.00	0.08
285	300036	超图软件	15,400	279,664.00	0.08
286	300363	博腾股份	12,000	278,880.00	0.08
287	600185	珠免集团	40,800	277,848.00	0.08
288	000156	华数传媒	36,600	277,062.00	0.08
289	300438	鹏辉能源	5,200	276,744.00	0.08
290	002043	兔宝宝	19,200	276,672.00	0.08
291	600409	三友化工	44,400	274,836.00	0.08
292	600888	新疆众和	33,500	274,365.00	0.08
293	600996	贵广网络	27,300	274,092.00	0.08
294	603027	千禾味业	27,800	273,274.00	0.08

295	688232	新点软件	11,000	273,020.00	0.08
296	600420	国药现代	27,000	272,700.00	0.08
297	688660	电气风电	16,000	272,160.00	0.07
298	002215	诺普信	25,600	271,104.00	0.07
299	603055	台华新材	28,700	270,928.00	0.07
300	688016	心脉医疗	2,950	270,397.00	0.07
301	603279	景津装备	16,000	269,920.00	0.07
302	301031	中熔电气	2,400	269,256.00	0.07
303	603663	三祥新材	7,600	268,660.00	0.07
304	002233	塔牌集团	29,700	267,597.00	0.07
305	601200	上海环境	33,240	267,582.00	0.07
306	688313	仕佳光子	3,000	266,340.00	0.07
307	600623	华谊集团	34,500	265,995.00	0.07
308	002489	浙江永强	69,300	265,419.00	0.07
309	000930	中粮科技	45,900	264,843.00	0.07
310	600597	光明乳业	32,700	264,543.00	0.07
311	301127	武汉天源	17,300	262,787.00	0.07
312	601500	通用股份	54,400	262,208.00	0.07
313	600757	长江传媒	29,500	261,960.00	0.07
314	002099	海翔药业	41,700	260,208.00	0.07
315	601619	嘉泽新能	58,500	259,740.00	0.07
316	601969	海南矿业	21,800	258,984.00	0.07
317	300079	数码视讯	48,000	258,720.00	0.07
318	000552	甘肃能化	111,700	258,027.00	0.07
319	603713	密尔克卫	4,600	256,542.00	0.07
320	601038	一拖股份	18,100	256,477.00	0.07
321	000712	锦龙股份	21,100	253,622.00	0.07
322	601952	苏垦农发	27,700	252,624.00	0.07
323	000719	中原传媒	21,400	251,664.00	0.07
324	603733	仙鹤股份	10,400	251,368.00	0.07
325	600586	金晶科技	44,500	250,535.00	0.07
326	301215	中汽股份	36,500	250,025.00	0.07
327	000557	西部创业	50,100	249,498.00	0.07
328	002747	埃斯顿	10,500	248,850.00	0.07
329	000498	山东路桥	41,200	248,436.00	0.07
330	301177	迪阿股份	8,600	248,282.00	0.07
331	002791	坚朗五金	11,700	248,157.00	0.07
332	600662	外服控股	49,300	247,486.00	0.07
333	002936	郑州银行	128,200	247,426.00	0.07
334	603567	珍宝岛	27,600	246,468.00	0.07
335	688289	圣湘生物	13,000	245,830.00	0.07
336	301219	腾远钴业	3,600	245,808.00	0.07
337	600621	华鑫股份	16,100	245,364.00	0.07

338	002275	桂林三金	17,400	245,340.00	0.07
339	301508	中机认检	7,800	243,828.00	0.07
340	300182	捷成股份	44,100	243,432.00	0.07
341	688390	固德威	3,900	242,307.00	0.07
342	301571	国科天成	4,200	242,256.00	0.07
343	000813	德展健康	62,700	240,768.00	0.07
344	601033	永兴股份	15,900	240,567.00	0.07
345	603057	紫燕食品	11,800	240,012.00	0.07
346	600726	华电能源	100,200	239,478.00	0.07
347	688083	中望软件	3,515	239,406.65	0.07
348	300083	创世纪	25,900	238,539.00	0.07
349	601083	锦江航运	21,300	237,708.00	0.07
350	600389	江山股份	9,300	235,104.00	0.06
351	688333	铂力特	2,100	234,171.00	0.06
352	600729	重庆百货	9,000	234,000.00	0.06
353	603103	横店影视	14,100	233,778.00	0.06
354	300624	万兴科技	3,300	233,145.00	0.06
355	300294	博雅生物	10,300	232,780.00	0.06
356	002928	华夏航空	21,000	232,050.00	0.06
357	002222	福晶科技	4,100	230,994.00	0.06
358	300475	香农芯创	1,600	230,944.00	0.06
359	605118	力鼎光电	7,600	228,836.00	0.06
360	600323	瀚蓝环境	8,000	228,800.00	0.06
361	002544	普天科技	6,600	227,634.00	0.06
362	600787	中储股份	40,200	225,924.00	0.06
363	605099	共创草坪	6,300	224,847.00	0.06
364	300047	天源迪科	17,900	224,645.00	0.06
365	300809	华辰装备	5,900	224,613.00	0.06
366	002572	索菲亚	16,500	224,565.00	0.06
367	301035	润丰股份	3,300	224,433.00	0.06
368	603496	恒为科技	8,200	223,696.00	0.06
369	002867	周大生	18,300	222,894.00	0.06
370	002373	千方科技	18,900	222,453.00	0.06
371	688146	中船特气	5,500	222,200.00	0.06
372	600056	中国医药	21,500	222,095.00	0.06
373	301297	富乐德	6,200	221,960.00	0.06
374	600867	通化东宝	27,100	221,407.00	0.06
375	300870	欧陆通	1,000	221,000.00	0.06
376	300598	诚迈科技	4,800	220,656.00	0.06
377	300910	瑞丰新材	3,900	220,545.00	0.06
378	301665	泰禾股份	7,800	220,272.00	0.06
379	000902	新洋丰	14,100	220,242.00	0.06
380	002563	森马服饰	40,400	218,968.00	0.06

381	002847	盐津铺子	3,200	218,592.00	0.06
382	603505	金石资源	11,700	218,556.00	0.06
383	300127	银河磁体	7,200	218,376.00	0.06
384	688141	杰华特	5,000	217,150.00	0.06
385	301000	肇民科技	5,500	216,535.00	0.06
386	301363	美好医疗	9,000	216,450.00	0.06
387	603162	海通发展	17,900	215,516.00	0.06
388	600728	佳都科技	31,300	209,084.00	0.06
389	688690	纳微科技	7,624	196,775.44	0.05
390	688536	思瑞浦	1,206	192,815.28	0.05
391	688097	博众精工	4,745	179,123.75	0.05
392	301381	赛维时代	8,600	177,074.00	0.05
393	600075	新疆天业	35,600	176,220.00	0.05
394	688798	艾为电子	2,200	167,442.00	0.05
395	605376	博迁新材	2,400	156,960.00	0.04
396	688003	天准科技	2,610	153,729.00	0.04
397	301268	铭利达	8,100	147,663.00	0.04
398	688007	光峰科技	7,800	144,846.00	0.04
399	600961	株冶集团	8,600	138,460.00	0.04
400	688382	益方生物	5,000	136,200.00	0.04
401	603267	鸿远电子	2,400	130,632.00	0.04
402	688300	联瑞新材	2,100	130,389.00	0.04
403	688766	普冉股份	1,000	127,210.00	0.03
404	688048	长光华芯	1,000	125,350.00	0.03
405	688205	德科立	900	123,732.00	0.03
406	688068	热景生物	746	120,852.00	0.03
407	300080	易成新能	23,900	116,154.00	0.03
408	002761	浙江建投	13,400	114,838.00	0.03
409	600266	城建发展	22,000	111,540.00	0.03
410	002100	天康生物	15,000	110,550.00	0.03
411	000089	深圳机场	15,300	106,947.00	0.03
412	600812	华北制药	19,000	105,070.00	0.03
413	688158	优刻得	3,600	101,124.00	0.03
414	688131	皓元医药	1,400	100,912.00	0.03
415	002643	万润股份	6,700	100,433.00	0.03
416	000690	宝新能源	23,900	100,141.00	0.03
417	688503	聚和材料	1,600	97,600.00	0.03
418	603013	亚普股份	3,900	96,213.00	0.03
419	002777	久远银海	5,300	95,082.00	0.03
420	688630	芯碁微装	700	94,171.00	0.03
421	688559	海目星	1,943	93,380.58	0.03
422	688543	国科军工	1,500	93,105.00	0.03
423	688800	瑞可达	1,120	92,960.00	0.03

424	688110	东芯股份	700	91,945.00	0.03
425	688270	臻镭科技	721	88,012.47	0.02
426	603383	顶点软件	2,400	86,664.00	0.02
427	601949	中国出版	13,300	85,785.00	0.02
428	002368	太极股份	3,400	83,266.00	0.02
429	002705	新宝股份	5,800	82,708.00	0.02
430	688596	正帆科技	2,600	82,238.00	0.02
431	300926	博俊科技	2,500	81,950.00	0.02
432	688652	京仪装备	800	78,648.00	0.02
433	000550	江铃汽车	4,100	76,260.00	0.02
434	600216	浙江医药	5,500	76,230.00	0.02
435	300634	彩讯股份	2,900	73,167.00	0.02
436	601801	皖新传媒	11,100	73,038.00	0.02
437	688586	江航装备	5,600	73,024.00	0.02
438	000099	中信海直	3,500	72,625.00	0.02
439	000680	山推股份	6,000	71,820.00	0.02
440	001309	德明利	300	69,567.00	0.02
441	688698	伟创电气	700	69,216.00	0.02
442	603888	新华网	3,560	69,170.80	0.02
443	002745	木林森	7,200	68,904.00	0.02
444	688717	艾罗能源	1,100	67,760.00	0.02
445	301047	义翘神州	1,000	67,600.00	0.02
446	603083	剑桥科技	500	67,190.00	0.02
447	002985	北摩高科	2,100	66,633.00	0.02
448	000727	冠捷科技	25,700	65,278.00	0.02
449	002096	易普力	4,900	65,268.00	0.02
450	688658	悦康药业	2,800	63,308.00	0.02
451	600864	哈投股份	9,500	62,985.00	0.02
452	688519	南亚新材	740	59,836.40	0.02
453	688150	莱特光电	190	5,135.70	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688256	寒武纪	200	271,110.00	0.07
2	301007	德迈仕	5,800	235,016.00	0.06
3	688512	慧智微	21,000	234,360.00	0.06
4	688371	菲沃泰	12,500	230,875.00	0.06
5	600226	亨通股份	43,000	229,190.00	0.06
6	603660	苏州科达	20,600	227,218.00	0.06
7	601319	中国人保	25,200	225,540.00	0.06

8	600637	东方明珠	22,800	224,580.00	0.06
9	601061	中信金属	15,500	223,200.00	0.06
10	600606	绿地控股	134,200	222,772.00	0.06
11	601588	北辰实业	128,000	222,720.00	0.06
12	600162	香江控股	120,300	222,555.00	0.06
13	688055	龙腾光电	61,415	221,094.00	0.06
14	601872	招商轮船	24,600	220,908.00	0.06
15	600977	中国电影	14,000	220,080.00	0.06
16	600383	金地集团	71,900	220,014.00	0.06
17	603077	和邦生物	97,000	219,220.00	0.06
18	000709	河钢股份	94,500	218,295.00	0.06
19	600021	上海电力	10,900	218,218.00	0.06
20	603906	龙蟠科技	10,900	218,109.00	0.06
21	600141	兴发集团	6,300	217,854.00	0.06
22	600884	杉杉股份	16,100	217,511.00	0.06
23	600096	云天化	6,500	217,165.00	0.06
24	300490	华自科技	18,100	217,019.00	0.06
25	688449	联芸科技	4,800	216,864.00	0.06
26	605319	无锡振华	10,300	216,712.00	0.06
27	603185	弘元绿能	7,100	216,550.00	0.06
28	600078	澄星股份	22,500	215,775.00	0.06
29	600795	国电电力	42,700	215,208.00	0.06
30	603978	深圳新星	7,600	214,624.00	0.06
31	603890	春秋电子	13,300	214,529.00	0.06
32	000988	华工科技	2,700	214,191.00	0.06
33	601118	海南橡胶	36,600	214,110.00	0.06
34	688223	晶科能源	37,960	214,094.40	0.06
35	688472	阿特斯	14,300	213,213.00	0.06
36	002384	东山精密	2,500	211,625.00	0.06
37	688556	高测股份	18,438	210,561.96	0.06
38	688148	芳源股份	23,918	209,760.86	0.06
39	600497	驰宏锌锗	27,300	199,563.00	0.05
40	605358	立昂微	4,400	153,208.00	0.04
41	301687	新广益	1,942	135,202.09	0.04
42	688609	九联科技	9,490	96,892.90	0.03
43	688004	博汇科技	3,978	92,011.14	0.03
44	688329	艾隆科技	4,300	91,547.00	0.03
45	301321	翰博高新	4,800	91,440.00	0.03
46	688689	银河微电	3,000	85,140.00	0.02
47	603444	吉比特	200	84,770.00	0.02
48	301103	何氏眼科	4,300	84,366.00	0.02
49	300162	雷曼光电	10,300	83,739.00	0.02
50	000925	众合科技	8,800	79,024.00	0.02

51	300615	欣天科技	5,900	78,352.00	0.02
52	301198	喜悦智行	6,200	77,872.00	0.02
53	301186	超达装备	1,600	77,696.00	0.02
54	688015	交控科技	3,400	77,452.00	0.02
55	301223	中荣股份	4,200	77,154.00	0.02
56	605001	威奥股份	10,000	76,300.00	0.02
57	002841	视源股份	1,900	75,297.00	0.02
58	688113	联测科技	1,900	75,107.00	0.02
59	300219	鸿利智汇	10,400	74,984.00	0.02
60	002367	康力电梯	9,300	74,958.00	0.02
61	301528	多浦乐	1,100	74,800.00	0.02
62	603700	宁水集团	5,500	74,745.00	0.02
63	301518	长华化学	2,100	74,697.00	0.02
64	600332	白云山	2,900	74,646.00	0.02
65	301032	新柴股份	6,200	74,586.00	0.02
66	605577	龙版传媒	5,700	74,499.00	0.02
67	301512	智信精密	1,700	74,358.00	0.02
68	300417	南华仪器	5,300	74,147.00	0.02
69	688356	键凯科技	900	73,980.00	0.02
70	603050	科林电气	4,100	73,882.00	0.02
71	002999	天禾股份	10,800	73,764.00	0.02
72	001256	炜冈科技	3,300	73,722.00	0.02
73	002111	威海广泰	7,000	73,640.00	0.02
74	603661	恒林股份	2,300	73,623.00	0.02
75	301555	惠柏新材	2,200	73,546.00	0.02
76	300826	测绘股份	4,300	73,530.00	0.02
77	300566	激智科技	4,000	73,400.00	0.02
78	300971	博亚精工	3,000	73,380.00	0.02
79	000733	振华科技	1,400	73,374.00	0.02
80	603231	索宝蛋白	4,000	73,280.00	0.02
81	300845	捷安高科	6,500	73,255.00	0.02
82	001215	千味央厨	1,900	73,150.00	0.02
83	300973	立高食品	1,700	73,100.00	0.02
84	603153	上海建科	4,300	73,100.00	0.02
85	688819	天能股份	2,200	73,084.00	0.02
86	300645	正元智慧	3,900	73,047.00	0.02
87	603466	风语筑	7,800	73,008.00	0.02
88	688312	燕麦科技	2,200	72,996.00	0.02
89	002410	广联达	5,800	72,964.00	0.02
90	600469	风神股份	10,500	72,870.00	0.02
91	603170	宝立食品	5,100	72,828.00	0.02
92	603190	亚通精工	2,700	72,819.00	0.02
93	603602	纵横通信	5,000	72,800.00	0.02

94	600661	昂立教育	7,100	72,775.00	0.02
95	603903	中持股份	5,000	72,750.00	0.02
96	300515	三德科技	3,700	72,742.00	0.02
97	300802	矩子科技	3,800	72,732.00	0.02
98	605186	健麾信息	3,700	72,705.00	0.02
99	003030	祖名股份	3,600	72,684.00	0.02
100	301170	锡南科技	2,600	72,670.00	0.02
101	000576	甘化科工	6,900	72,657.00	0.02
102	688600	皖仪科技	2,900	72,645.00	0.02
103	600748	上实发展	13,400	72,628.00	0.02
104	605567	春雪食品	6,600	72,600.00	0.02
105	601019	山东出版	8,400	72,576.00	0.02
106	000421	南京公用	10,500	72,555.00	0.02
107	001258	立新能源	10,200	72,522.00	0.02
108	300407	凯发电气	6,400	72,448.00	0.02
109	300719	安达维尔	4,000	72,440.00	0.02
110	301608	博实结	800	72,432.00	0.02
111	300791	仙乐健康	2,800	72,408.00	0.02
112	002314	南山控股	25,400	72,390.00	0.02
113	688309	恒誉环保	3,000	72,390.00	0.02
114	605299	舒华体育	6,300	72,387.00	0.02
115	002441	众业达	7,700	72,380.00	0.02
116	300717	华信新材	3,800	72,352.00	0.02
117	300851	交大思诺	2,700	72,333.00	0.02
118	603856	东宏股份	5,800	72,326.00	0.02
119	300625	三雄极光	6,100	72,285.00	0.02
120	603697	有友食品	5,900	72,275.00	0.02
121	301097	天益医疗	1,400	72,268.00	0.02
122	300452	山河药辅	5,400	72,252.00	0.02
123	603519	立霸股份	6,000	72,180.00	0.02
124	603006	联明股份	5,500	72,160.00	0.02
125	688115	思林杰	1,100	72,138.00	0.02
126	600479	千金药业	7,100	72,136.00	0.02
127	300110	华仁药业	22,900	72,135.00	0.02
128	603681	永冠新材	3,800	72,124.00	0.02
129	301503	智迪科技	2,000	72,120.00	0.02
130	301190	善水科技	3,400	72,114.00	0.02
131	300858	科拓生物	4,300	72,111.00	0.02
132	300800	力合科技	6,200	72,106.00	0.02
133	300735	光弘科技	2,900	72,094.00	0.02
134	002950	奥美医疗	6,600	72,072.00	0.02
135	002722	物产金轮	4,800	72,048.00	0.02
136	688285	高铁电气	8,300	72,044.00	0.02

137	603309	维力医疗	5,300	72,027.00	0.02
138	688070	纵横股份	1,300	72,020.00	0.02
139	300711	广哈通信	3,100	71,982.00	0.02
140	300931	通用电梯	6,500	71,955.00	0.02
141	603937	丽岛新材	6,000	71,940.00	0.02
142	601388	怡球资源	23,900	71,939.00	0.02
143	600288	大恒科技	4,800	71,904.00	0.02
144	300888	稳健医疗	1,900	71,896.00	0.02
145	688410	山外山	4,800	71,856.00	0.02
146	300823	建科智能	4,600	71,852.00	0.02
147	003025	思进智能	5,000	71,850.00	0.02
148	300999	金龙鱼	2,500	71,850.00	0.02
149	301059	金三江	5,700	71,820.00	0.02
150	301027	华蓝集团	3,900	71,799.00	0.02
151	605151	西上海	3,800	71,782.00	0.02
152	003015	日久光电	4,600	71,760.00	0.02
153	000783	长江证券	8,800	71,720.00	0.02
154	688728	格科微	4,800	71,712.00	0.02
155	000586	汇源通信	5,300	71,709.00	0.02
156	688450	光格科技	2,600	71,708.00	0.02
157	300838	浙江力诺	4,700	71,675.00	0.02
158	301283	聚胶股份	1,500	71,670.00	0.02
159	002606	大连电瓷	8,200	71,668.00	0.02
160	600039	四川路桥	7,200	71,640.00	0.02
161	300206	理邦仪器	5,600	71,624.00	0.02
162	601808	中海油服	5,100	71,604.00	0.02
163	002452	长高电新	8,700	71,601.00	0.02
164	002054	德美化工	9,700	71,586.00	0.02
165	002234	民和股份	8,300	71,546.00	0.02
166	603365	水星家纺	3,400	71,536.00	0.02
167	300283	温州宏丰	9,500	71,535.00	0.02
168	301273	瑞晨环保	2,700	71,523.00	0.02
169	002758	浙农股份	7,100	71,497.00	0.02
170	605268	王力安防	6,700	71,489.00	0.02
171	300358	楚天科技	7,300	71,467.00	0.02
172	603282	亚光股份	3,600	71,424.00	0.02
173	001319	铭科精技	2,600	71,422.00	0.02
174	603073	彩蝶实业	3,800	71,402.00	0.02
175	603161	科华控股	5,200	71,396.00	0.02
176	002687	乔治白	14,800	71,336.00	0.02
177	002556	辉隆股份	11,800	71,272.00	0.02
178	300824	北鼎股份	6,300	71,253.00	0.02
179	601717	中创智领	2,900	71,195.00	0.02

180	688179	阿拉丁	5,700	71,193.00	0.02
181	301303	真兰仪表	4,700	71,158.00	0.02
182	603029	天鹅股份	3,900	71,136.00	0.02
183	603115	海星股份	3,800	71,098.00	0.02
184	002552	宝鼎科技	4,300	70,993.00	0.02
185	605098	行动教育	1,700	70,992.00	0.02
186	002440	闰土股份	9,500	70,965.00	0.02
187	002293	罗莱生活	6,900	70,863.00	0.02
188	605305	中际联合	1,700	70,822.00	0.02
189	002380	科远智慧	2,600	70,720.00	0.02
190	301580	爱迪特	1,600	70,720.00	0.02
191	600906	财达证券	10,600	70,702.00	0.02
192	603816	顾家家居	2,300	70,702.00	0.02
193	688046	药康生物	4,600	70,656.00	0.02
194	001218	丽臣实业	3,100	70,618.00	0.02
195	605208	永茂泰	5,200	70,616.00	0.02
196	688310	迈得医疗	4,600	70,518.00	0.02
197	600690	海尔智家	2,700	70,443.00	0.02
198	688681	科汇股份	4,000	70,320.00	0.02
199	002866	传艺科技	3,900	70,239.00	0.02
200	600067	冠城新材	16,900	70,135.00	0.02
201	688678	福立旺	2,900	70,122.00	0.02
202	688132	邦彦技术	3,800	69,996.00	0.02
203	301108	洁雅股份	2,100	69,846.00	0.02
204	301138	华研精机	1,800	69,840.00	0.02
205	603917	合力科技	4,700	69,513.00	0.02
206	688618	三旺通信	2,600	69,316.00	0.02
207	688255	凯尔达	1,890	69,230.70	0.02
208	688597	煜邦电力	8,426	69,177.46	0.02
209	300454	深信服	600	69,096.00	0.02
210	300852	四会富仕	1,800	68,724.00	0.02
211	301656	联合动力	2,699	68,716.54	0.02
212	688557	兰剑智能	1,883	68,597.69	0.02
213	688551	科威尔	1,805	66,478.15	0.02
214	688308	欧科亿	2,100	66,444.00	0.02
215	688084	晶品特装	780	64,584.00	0.02
216	688002	睿创微纳	625	63,000.00	0.02
217	301638	南网数字	1,598	22,707.58	0.01
218	001386	马可波罗	1,064	19,715.92	0.01
219	688807	优迅股份	131	17,758.36	0.00
220	688796	百奥赛图	378	15,970.50	0.00
221	001233	海安集团	263	13,644.44	0.00
222	301667	纳百川	151	8,617.57	0.00

223	688805	健信超导	265	8,578.05	0.00
224	001369	双欣环保	665	8,571.85	0.00
225	601026	道生天合	451	6,440.28	0.00
226	001285	瑞立科密	101	5,664.08	0.00
227	603248	锡华科技	260	4,238.00	0.00
228	001396	誉帆科技	69	2,441.91	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002649	博彦科技	16,749,616.00	4.60
2	601677	明泰铝业	14,271,934.00	3.92
3	600933	爱柯迪	12,582,364.00	3.45
4	600986	浙文互联	12,574,226.00	3.45
5	002396	星网锐捷	12,501,921.00	3.43
6	600273	嘉化能源	12,475,876.00	3.42
7	601311	骆驼股份	12,419,685.00	3.41
8	002839	张家港行	12,396,000.40	3.40
9	002434	万里扬	12,316,708.00	3.38
10	000600	建投能源	12,244,957.00	3.36
11	300415	伊之密	12,232,327.00	3.36
12	600718	东软集团	11,871,548.00	3.26
13	000686	东北证券	11,834,549.00	3.25
14	300232	洲明科技	11,257,326.00	3.09
15	300319	麦捷科技	11,187,147.00	3.07
16	603588	高能环境	11,116,168.00	3.05
17	300113	顺网科技	11,020,086.00	3.02
18	600710	苏美达	10,909,061.00	2.99
19	301029	怡合达	10,880,690.00	2.99
20	002668	TCL 智家	10,848,412.52	2.98
21	300133	华策影视	10,810,206.00	2.97
22	002174	游族网络	10,729,325.01	2.95
23	300777	中简科技	10,700,917.00	2.94
24	001914	招商积余	10,697,612.00	2.94
25	600552	凯盛科技	10,565,140.00	2.90
26	300303	聚飞光电	10,487,805.00	2.88
27	600459	贵研铂业	10,356,728.00	2.84
28	600063	皖维高新	10,291,131.00	2.82
29	600335	国机汽车	10,090,791.00	2.77
30	002061	浙江交科	10,079,774.00	2.77
31	603766	隆鑫通用	10,077,705.00	2.77

32	002091	江苏国泰	10,052,925.49	2.76
33	300036	超图软件	10,039,226.00	2.76
34	688209	英集芯	9,725,993.65	2.67
35	600114	东睦股份	9,648,486.00	2.65
36	002011	盾安环境	9,641,710.00	2.65
37	000657	中钨高新	9,630,493.00	2.64
38	002545	东方铁塔	9,618,510.00	2.64
39	300850	新强联	9,558,504.26	2.62
40	600850	电科数字	9,521,364.00	2.61
41	002010	传化智联	9,482,823.00	2.60
42	002948	青岛银行	9,369,252.00	2.57
43	000928	中钢国际	9,321,553.00	2.56
44	002063	远光软件	9,242,188.00	2.54
45	002698	博实股份	9,240,846.00	2.54
46	002015	协鑫能科	9,161,733.00	2.51
47	002139	拓邦股份	9,126,219.00	2.51
48	601678	滨化股份	9,008,517.00	2.47
49	600963	岳阳林纸	8,968,377.00	2.46
50	000676	智度股份	8,931,818.00	2.45
51	688208	道通科技	8,879,209.37	2.44
52	600073	光明肉业	8,869,211.00	2.43
53	300596	利安隆	8,864,114.00	2.43
54	603118	共进股份	8,854,741.00	2.43
55	002100	天康生物	8,842,763.00	2.43
56	002239	奥特佳	8,841,378.00	2.43
57	000927	中国铁物	8,806,866.00	2.42
58	002171	楚江新材	8,796,609.00	2.41
59	002705	新宝股份	8,784,353.00	2.41
60	600782	新钢股份	8,782,634.00	2.41
61	300244	迪安诊断	8,741,263.00	2.40
62	000682	东方电子	8,740,395.07	2.40
63	600478	科力远	8,722,513.00	2.39
64	603636	南威软件	8,661,048.00	2.38
65	603236	移远通信	8,652,265.20	2.37
66	002597	金禾实业	8,632,473.00	2.37
67	600158	中体产业	8,618,677.00	2.37
68	600667	太极实业	8,618,216.00	2.37
69	600210	紫江企业	8,532,629.00	2.34
70	000811	冰轮环境	8,514,305.00	2.34
71	002807	江阴银行	8,497,864.00	2.33
72	603876	鼎胜新材	8,460,455.00	2.32
73	002745	木林森	8,422,673.07	2.31
74	002249	大洋电机	8,369,725.00	2.30

75	000680	山推股份	8,361,109.00	2.30
76	300428	立中集团	8,269,531.00	2.27
77	600507	方大特钢	8,251,948.00	2.27
78	300101	振芯科技	8,206,076.00	2.25
79	002101	广东鸿图	8,195,431.00	2.25
80	000829	天音控股	8,186,544.00	2.25
81	002079	苏州固锝	8,154,980.00	2.24
82	600729	重庆百货	8,152,907.00	2.24
83	600138	中青旅	8,130,629.00	2.23
84	300602	飞荣达	8,101,569.44	2.22
85	002081	金螳螂	8,100,107.00	2.22
86	300443	金雷股份	7,999,247.99	2.20
87	002004	华邦健康	7,995,176.00	2.19
88	300035	中科电气	7,972,505.00	2.19
89	600961	株冶集团	7,854,414.13	2.16
90	300682	朗新科技	7,820,303.00	2.15
91	300088	长信科技	7,819,627.00	2.15
92	002993	奥海科技	7,778,852.00	2.14
93	600728	佳都科技	7,756,413.00	2.13
94	002967	广电计量	7,728,621.00	2.12
95	002701	奥瑞金	7,683,499.00	2.11
96	000049	德赛电池	7,678,166.10	2.11
97	300257	开山股份	7,585,830.00	2.08
98	688088	虹软科技	7,576,932.79	2.08
99	600338	西藏珠峰	7,564,684.00	2.08
100	600572	康恩贝	7,559,627.00	2.08
101	688372	伟测科技	7,532,843.69	2.07
102	601137	博威合金	7,467,982.00	2.05
103	300772	运达股份	7,457,592.50	2.05
104	600531	豫光金铅	7,449,058.00	2.04
105	688502	茂莱光学	7,363,641.97	2.02

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002649	博彦科技	16,746,930.50	4.60
2	002396	星网锐捷	15,067,416.00	4.14
3	300415	伊之密	13,673,240.00	3.75
4	300232	洲明科技	13,007,365.12	3.57
5	601677	明泰铝业	12,985,291.00	3.56
6	603588	高能环境	12,886,361.00	3.54
7	601311	骆驼股份	12,651,394.00	3.47

8	600718	东软集团	12,628,676.00	3.47
9	002061	浙江交科	12,501,806.00	3.43
10	000657	中钨高新	11,875,405.60	3.26
11	300777	中简科技	11,863,502.00	3.26
12	002100	天康生物	11,740,160.00	3.22
13	600273	嘉化能源	11,687,274.00	3.21
14	300133	华策影视	11,560,887.00	3.17
15	002434	万里扬	11,542,662.00	3.17
16	603766	隆鑫通用	11,404,823.50	3.13
17	002249	大洋电机	11,340,313.00	3.11
18	600459	贵研铂业	11,338,015.00	3.11
19	002139	拓邦股份	11,232,358.00	3.08
20	000600	建投能源	11,202,165.00	3.07
21	600063	皖维高新	11,183,552.00	3.07
22	000686	东北证券	11,150,379.56	3.06
23	600552	凯盛科技	11,148,490.00	3.06
24	002091	江苏国泰	11,094,480.00	3.05
25	600933	爱柯迪	11,070,952.00	3.04
26	603118	共进股份	11,044,894.00	3.03
27	688209	英集芯	10,926,354.54	3.00
28	002839	张家港行	10,895,319.60	2.99
29	600850	电科数字	10,883,237.00	2.99
30	600986	浙文互联	10,672,562.60	2.93
31	600710	苏美达	10,623,658.00	2.92
32	300303	聚飞光电	10,616,660.00	2.91
33	300035	中科电气	10,614,469.00	2.91
34	301029	怡合达	10,465,111.73	2.87
35	002668	TCL 智家	10,182,395.00	2.79
36	002745	木林森	10,138,412.75	2.78
37	688372	伟测科技	10,134,853.99	2.78
38	600073	光明肉业	10,048,757.00	2.76
39	300113	顺网科技	10,010,115.00	2.75
40	002174	游族网络	9,998,935.00	2.74
41	000680	山推股份	9,963,803.00	2.73
42	002948	青岛银行	9,948,562.50	2.73
43	300036	超图软件	9,940,148.00	2.73
44	300596	利安隆	9,801,653.00	2.69
45	002967	广电计量	9,798,069.00	2.69
46	002545	东方铁塔	9,726,986.00	2.67
47	002698	博实股份	9,690,027.00	2.66
48	000928	中钢国际	9,620,685.00	2.64
49	002705	新宝股份	9,589,422.00	2.63
50	600728	佳都科技	9,584,619.00	2.63

51	000682	东方电子	9,584,028.76	2.63
52	600138	中青旅	9,444,558.00	2.59
53	300319	麦捷科技	9,407,758.00	2.58
54	600667	太极实业	9,400,716.00	2.58
55	300101	振芯科技	9,394,652.00	2.58
56	002171	楚江新材	9,335,026.00	2.56
57	688208	道通科技	9,331,616.27	2.56
58	600338	西藏珠峰	9,328,970.00	2.56
59	000811	冰轮环境	9,233,395.00	2.53
60	300443	金雷股份	9,101,105.00	2.50
61	600531	豫光金铅	9,085,577.00	2.49
62	002063	远光软件	9,083,752.00	2.49
63	603876	鼎胜新材	9,051,159.20	2.48
64	001914	招商积余	9,038,930.00	2.48
65	000049	德赛电池	8,971,826.56	2.46
66	600961	株冶集团	8,969,910.00	2.46
67	603636	南威软件	8,808,232.35	2.42
68	688183	生益电子	8,772,417.00	2.41
69	300083	创世纪	8,730,342.00	2.40
70	600729	重庆百货	8,649,995.00	2.37
71	688127	蓝特光学	8,623,904.50	2.37
72	000676	智度股份	8,599,984.00	2.36
73	300772	运达股份	8,598,407.50	2.36
74	601137	博威合金	8,553,983.55	2.35
75	600210	紫江企业	8,544,120.00	2.35
76	603236	移远通信	8,471,095.00	2.33
77	002597	金禾实业	8,428,048.00	2.31
78	600266	城建发展	8,426,370.00	2.31
79	600158	中体产业	8,390,848.00	2.30
80	002011	盾安环境	8,340,107.00	2.29
81	300088	长信科技	8,330,291.00	2.29
82	002239	奥特佳	8,261,492.00	2.27
83	600963	岳阳林纸	8,260,777.00	2.27
84	300602	飞荣达	8,258,318.16	2.27
85	600064	南京高科	8,247,968.00	2.26
86	600335	国机汽车	8,178,012.00	2.24
87	300682	朗新科技	8,159,246.00	2.24
88	600114	东睦股份	8,114,991.00	2.23
89	000927	中国铁物	8,087,646.00	2.22
90	688502	茂莱光学	8,018,942.77	2.20
91	000829	天音控股	7,978,670.00	2.19
92	002081	金螳螂	7,968,747.00	2.19
93	603025	大豪科技	7,940,519.20	2.18

94	002701	奥瑞金	7,905,134.00	2.17
95	002015	协鑫能科	7,894,152.00	2.17
96	300181	佐力药业	7,859,122.90	2.16
97	300850	新强联	7,839,898.80	2.15
98	002895	川恒股份	7,790,939.00	2.14
99	002332	仙琚制药	7,785,206.50	2.14
100	002010	传化智联	7,760,209.00	2.13
101	300525	博思软件	7,746,369.00	2.13
102	600478	科力远	7,742,192.50	2.13
103	300151	昌红科技	7,728,829.65	2.12
104	002906	华阳集团	7,704,020.00	2.11
105	603612	索通发展	7,670,021.00	2.11
106	600420	国药现代	7,562,300.00	2.08
107	300768	迪普科技	7,530,529.00	2.07
108	000528	柳 工	7,462,789.00	2.05
109	002928	华夏航空	7,440,489.00	2.04
110	300244	迪安诊断	7,394,912.76	2.03
111	300685	艾德生物	7,394,143.60	2.03
112	600428	中远海特	7,379,330.00	2.03
113	300428	立中集团	7,375,477.00	2.02
114	002706	良信股份	7,374,959.00	2.02
115	300627	华测导航	7,372,330.00	2.02
116	688400	凌云光	7,331,189.26	2.01
117	002245	蔚蓝锂芯	7,295,337.00	2.00
118	002993	奥海科技	7,294,362.00	2.00
119	688088	虹软科技	7,290,135.35	2.00

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	3,503,974,062.71
卖出股票收入（成交）总额	3,640,399,578.16

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

无余额。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

无余额。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

无余额。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

无余额。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

无余额。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金管理人根据风险管理的原则，以套期保值为目的，充分考虑股指期货的收益性、流动性及风险特征，通过资产配置、品种选择，谨慎进行投资，旨在通过股指期货实现基金的套期保值。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

无。

8.12 投资组合报告附注

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

报告期内，本基金投资的前十名证券的发行主体中，新余钢铁股份有限公司在报告编制日前一年内曾受到新余市交通运输综合行政执法支队的处罚。

本基金对上述主体所发行证券的投资决策程序符合相关法律法规、基金合同及公司制度的规定。除上述主体外，基金管理人未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

8.12.2 基金投资的前十名股票超出基金合同规定的备选股票库情况的说明

基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	4,149,849.60
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	300,666.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	4,450,515.60
---	----	--------------

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无余额。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

无余额。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

无余额。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数（户）	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
中信建投 中证 1000 指 数增强 A	16,043	10,108.36	46,078,030.77	28.4137%	116,090,332.16	71.5863%
中信建投 中证 1000 指 数增强 C	7,506	13,738.82	4,154,526.51	4.0287%	98,969,079.80	95.9713%
合计	23,336	11,368.36	50,232,557.28	18.9348%	215,059,411.96	81.0652%

注：持有人户数合计数少于各分项之和，系部分基金持有人持有多个份额类别基金所致。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	中信建投中证 1000 指数增强 A	36,159.86	0.0223%

	中信建投中证 1000 指数增强 C	2,000.50	0.0019%
	合计	38,160.36	0.0144%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	中信建投中证 1000 指数增强 A	0
	中信建投中证 1000 指数增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	中信建投中证 1000 指数增强 A	0
	中信建投中证 1000 指数增强 C	0
	合计	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

	中信建投中证 1000 指数增强 A	中信建投中证 1000 指数增强 C
基金合同生效日（2022 年 06 月 28 日）基金份额总额	913,074,067.12	381,078,356.23
本报告期期初基金份额总额	239,216,150.30	113,763,690.40
本报告期基金总申购份额	111,743,257.92	184,125,947.51
减：本报告期基金总赎回份额	188,791,045.29	194,766,031.60
本报告期基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
本报告期期末基金份额总额	162,168,362.93	103,123,606.31

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，基金管理人无重大人事变动。

本报告期内，基金托管人中信银行股份有限公司发生以下重大人事变更：

2025 年 4 月，经国家金融监督管理总局核准，芦苇先生正式就任中信银行行长。

2025 年 12 月，芦苇先生因工作调整，辞去中信银行执行董事、行长、董事会风险管理委员会主席及委员、董事会战略与可持续发展委员会委员职务。同日，中信银行董事会审议通过由方合英先生代为履行行长职责。上述事项对中信银行公募基金托管业务无影响。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为其审计的会计师事务所。报告期内本基金应支付审计机构安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）审计费用 18,000.00 元整，其已提供审计服务的连续年限为 2 年。

11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，管理人未受调查或处罚。

11.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，管理人相关从业人员未受调查或处罚。

11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，托管人未因托管业务受调查或处罚。

11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，托管人相关从业人员未受调查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	

中信建投证券股份有限公司	4	5,589,629,858.85	78.25%	1,074,635.77	78.13%	—
方正证券股份有限公司	2	1,150,308,856.20	16.10%	221,085.76	16.07%	—
信达证券股份有限公司	2	403,690,824.92	5.65%	79,774.70	5.80%	—

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

2、本报告期内，本基金办理证券投资委托的证券公司未发生变更。

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

（1）选择证券公司参与证券交易的标准

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

（2）选择证券公司参与证券交易的程序

基金管理人指定专人负责参与证券交易的证券公司的准入评估，并根据评估结果完成与证券公司的协议签订及交易佣金费率的确定等工作。基金管理人建立了“证券研究报告质量评分机制”“证券综合研究服务评分体系”等，每季度组织公募投研部门完成对已合作证券公司的研究服务打分评价，评价结果是确定/调整证券公司股票交易成交金额及佣金比例限制的参考。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的

								比例
中信建投证券股份有限公司	260,935.76	77.29%	-	-	-	-	-	-
方正证券股份有限公司	57,354.53	16.99%	-	-	-	-	-	-
信达证券股份有限公司	19,296.13	5.72%	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	中信建投基金管理有限公司旗下全部基金 2024 年第 4 季度报告提示性公告	规定报刊	2025-01-22
2	中信建投中证 1000 指数增强型证券投资基金 2024 年第 4 季度报告	规定网站	2025-01-22
3	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分基金增加中邮证券有限责任公司为代销机构并开通定期定额投资业务及开展费率优惠的公告	规定网站、规定报刊	2025-03-31
4	中信建投基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024 年度）	规定网站	2025-03-31
5	中信建投基金管理有限公司旗下全部基金 2024 年年度报告提示性公告	规定报刊	2025-03-31
6	中信建投中证 1000 指数增强型证券投资基金 2024 年年度报告	规定网站	2025-03-31
7	中信建投基金管理有限公司关于运用固有资金投资旗下权益类公募基金的公告	规定网站、规定报刊	2025-04-11
8	中信建投基金管理有限公司旗下全部基金 2025 年第 1 季度报告提示性公告	规定报刊	2025-04-22

9	中信建投中证 1000 指数增强型证券投资基金 2025 年第 1 季度报告	规定网站	2025-04-22
10	中信建投中证 1000 指数增强型证券投资基金招募说明书（更新）	规定网站	2025-07-04
11	中信建投中证 1000 指数增强型证券投资基金（A 类份额）基金产品资料概要更新	规定网站	2025-07-04
12	中信建投中证 1000 指数增强型证券投资基金（C 类份额）基金产品资料概要更新	规定网站	2025-07-04
13	中信建投基金管理有限公司旗下部分基金 2025 年第 2 季度报告提示性公告	规定报刊	2025-07-21
14	中信建投中证 1000 指数增强型证券投资基金 2025 年第 2 季度报告	规定网站	2025-07-21
15	中信建投基金管理有限公司旗下部分基金 2025 年中期报告提示性公告	规定报刊	2025-08-29
16	中信建投中证 1000 指数增强型证券投资基金 2025 年中期报告	规定网站	2025-08-29
17	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分基金在中国农业银行股份有限公司开通基金转换业务的公告	规定网站、规定报刊	2025-09-23
18	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分基金投资关联方承销证券的公告	规定网站、规定报刊	2025-10-10
19	中信建投基金管理有限公司旗下部分基金 2025 年第 3 季度报告提示性公告	规定报刊	2025-10-28
20	中信建投中证 1000 指数增强型证券投资基金 2025 年第 3 季度报告	规定网站	2025-10-28
21	中信建投基金管理有限公司关于旗下部分基金在中国农业银行股份有限公司开通基金转换业务的公告	规定网站、规定报刊	2025-12-23

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

本报告期内，未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，无影响投资者决策的其他重要信息。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金注册的文件；
- 2、《中信建投中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《中信建投中证 1000 指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 4、法律意见书；
- 5、基金管理人业务资格批件、营业执照；
- 6、基金托管人业务资格批件、营业执照；
- 7、中国证监会要求的其他文件。

13.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

13.3 查阅方式

投资者可在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

中信建投基金管理有限公司
二〇二六年三月三十一日