

中信建投中证 1000 指数增强型证券投资基金

2023 年中期报告

2023 年 06 月 30 日

基金管理人:中信建投基金管理有限公司

基金托管人:中信银行股份有限公司

送出日期:2023 年 08 月 31 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年8月30日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2023年1月1日起至6月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
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	12
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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	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 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产（基金净值）变动表	17
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	51
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细	53
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	69
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	70
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	71
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	71
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	71
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	71
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	71
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	71
7.12 投资组合报告附注	72
§8 基金份额持有人信息	73
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	73
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	73

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	74
§9 开放式基金份额变动	74
§10 重大事件揭示	74
10.1 基金份额持有人大会决议	74
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	75
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	75
10.4 基金投资策略的改变	75
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	75
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	75
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	75
10.8 其他重大事件	77
§11 影响投资者决策的其他重要信息	80
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 的情况	80
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	80
§12 备查文件目录	80
12.1 备查文件目录	80
12.2 存放地点	80
12.3 查阅方式	80

§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	402,411,596.05份	
基金合同存续期	不定期	
下属各类别基金的基金简称	中信建投中证1000指数增强A	中信建投中证1000指数增强C
下属各类别基金的交易代码	015784	015785
报告期末下属各类别基金的份额总额	304,613,215.95份	97,798,380.10份

2.2 基金产品说明

投资目标	<p>本基金为指数增强型基金，在力求对中证1000指数进行有效跟踪的基础上，本基金通过数量化的方法精选个股，在严格控制风险、保持良好流动性的前提下，追求超越业绩比较基准的投资回报。</p>
投资策略	<p>本基金为指数增强型基金，以中证1000指数为标的指数，基金股票投资方面将主要采用指数增强量化投资策略，在严格控制跟踪误差的基础上，力求获得超越标的指数的超额收益。</p> <p>指数增强量化投资策略主要借鉴国内外成熟的组合投资策略，在对标的指数成份股及其他股票基本面的深入研究的基础上，运用多因子分析模型和机器学习模型构建投资组合，同时优化组合交易并严格控制组合风险，实现超额收益。</p>
业绩比较基准	<p>中证1000指数收益率×95%+中证综合债指数收益</p>

	率×5%
风险收益特征	本基金属于股票型基金，其预期收益和预期风险高于混合型基金、债券型基金及货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及其备选成份股，具有与标的指数相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		中信建投基金管理有限公司	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	朱伟	姜敏
	联系电话	010-59100208	4006800000
	电子邮箱	zhuweibj@csc.com.cn	jiangmin@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2号凯恒中心B座17、19层	北京市朝阳区光华路10号院1号楼6-30层、32-42层
邮政编码		100010	100020
法定代表人		黄凌	朱鹤新

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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.cfund108.com
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中信建投基金管理有限公司	北京市东城区朝阳门内大街2号凯恒中心B座17、19层

§3 主要财务指标和基金净值表现

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01月01日-2023年06月30日)	
	中信建投中证1000 指数增强A	中信建投中证1000 指数增强C
本期已实现收益	41,696,373.03	12,105,977.74
本期利润	67,554,734.49	22,475,442.06
加权平均基金份额本期利润	0.1568	0.1573
本期加权平均净值利润率	15.41%	15.53%
本期基金份额净值增长率	9.51%	9.30%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2023年06月30日)	
期末可供分配利润	8,938,192.03	2,465,271.58
期末可供分配基金份额利润	0.0293	0.0252
期末基金资产净值	313,551,407.98	100,263,651.68
期末基金份额净值	1.0293	1.0252
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2023年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	2.93%	2.52%

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

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	1.97%	0.87%	0.61%	0.99%	1.36%	-0.12%
过去三个月	-1.09%	0.83%	-3.69%	0.87%	2.60%	-0.04%
过去六个月	9.51%	0.79%	5.00%	0.84%	4.51%	-0.05%
过去一年	2.93%	0.91%	-5.09%	1.05%	8.02%	-0.14%
自基金合同生效起至今	2.93%	0.90%	-5.18%	1.06%	8.11%	-0.16%

中信建投中证1000指数增强C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	1.94%	0.87%	0.61%	0.99%	1.33%	-0.12%
过去三个月	-1.18%	0.83%	-3.69%	0.87%	2.51%	-0.04%
过去六个月	9.30%	0.79%	5.00%	0.84%	4.30%	-0.05%
过去一年	2.52%	0.91%	-5.09%	1.05%	7.61%	-0.14%
自基金合同生效起至今	2.52%	0.90%	-5.18%	1.06%	7.70%	-0.16%

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

中信建投中证1000指数增强A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2022年06月28日-2023年06月30日)



中信建投中证1000指数增强C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2022年06月28日-2023年06月30日)



§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基金募集、基金销售、特定客户资产管理、资产管理和中国证监会许可的其他业务。

截至报告期末，中信建投基金共管理50只公募证券投资基金。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。

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理） 期限		证券 从业 年限	说明
		任职日期	离任日期		
王鹏	本基金的 基金经理、 指数与量 化投资部 行政负责 人	2022-06-28	-	8年	中国籍，1984年8月生，哥伦比亚大学统计学硕士。曾任中财期货分析师、LCM Commodities 研究员、CIBC World Market 期权交易员、中金基金管理有限公司量化投资副总经理、中金睿投投资管理有限公司量化投资副总经理、中信建投证券股份有限公司量化投资总监。2019年2月加入中信建投基金管理有限公司，曾任权益投资部-指数与量化投资部负责

				<p>人、总监，现任本公司指数与量化投资部行政负责人、基金经理，担任中信建投中证500指数增强型证券投资基金、中信建投量化进取6个月持有期混合型证券投资基金、中信建投量化精选6个月持有期混合型证券投资基金、中信建投中证1000指数增强型证券投资基金、中信建投沪深300指数增强型证券投资基金、中信建投红利智选混合型证券投资基金基金经理。</p>
--	--	--	--	--

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

2、证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》《公开募集证券投资基金销售机构监督管理办法》《公开募集证券投资基金运作管理办法》《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》《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，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本报告期内，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，未发现不同投资组合之间存在不公平交易的情况。

4.3.2 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

上半年A股呈现震荡格局，受益于消费复苏，一季度多数指数走强。二季度经济复苏转弱，市场出现阶段性盘整，后续一系列政策的出台有效提振了资本市场信心，加速了顺周期的行情，非银金融和房地产板块领涨带动了大盘风格的走强。本轮政策出台呈现出一定的“脉冲式”特征，运用的政策工具更加多元、更为注重政策节奏，因而即使在7月初以来已有多项重要政策陆续落地，市场对“活跃资本市场”后续政策的预期或仍乐观。我们认为可以积极期待下半年更多利好政策的进一步出台，市场信心也有望持续得到加强。

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1.0293元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为9.51%，同期业绩比较基准收益率为5.00%；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1.0252元，本报告期内，该类基金份额净值增长率为9.30%，同期业绩比较基准收益率为5.00%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，市场上行行情仍在初期，后续有概率迎来一个政策与基本面共振增强的阶段，且风险偏好不断修复，A股有望逐步转为增量行情。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

本基金管理人已制定基金估值和份额净值计价的业务管理制度，明确基金估值的程序和技术；建立了估值委员会，由公司分管运营领导任估值委员会主任，委员包括权益投资相关部门、固定收益部、研究部、特定资产管理部、稽控合规部、风险管理部、运营管理部的部门负责人。本基金管理人使用可靠的估值业务系统，估值人员熟悉各类投资品种的估值原则和具体估值程序。估值流程中包含风险监测、控制和报告机制。基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在0.25%以上的，对所采用的相关估值

技术、假设及输入值的适当性咨询会计师事务所的专业意见。基金经理可参与估值原则和方法的讨论，但不参与估值价格的最终决策和执行。

本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期内未实施利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对中信建投中证1000指数增强型证券投资基金2023年上半年的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

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

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，中信建投基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的2023年中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§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：中信建投中证1000指数增强型证券投资基金

报告截止日：2023年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	33,241,829.43	65,664,430.38
结算备付金		3,770,980.00	30,574,141.46
存出保证金		627,494.40	-
交易性金融资产	6.4.7.2	377,828,913.12	823,166,910.33
其中：股票投资		376,892,435.13	822,699,182.13
基金投资		-	-
债券投资		936,477.99	467,728.20
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		254,194.08	182,355.32

递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		415,723,411.03	919,587,837.49
负债和净资产	附注号	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		1,381,174.76	2,089,297.73
应付管理人报酬		347,841.77	814,667.96
应付托管费		34,784.15	81,466.84
应付销售服务费		35,792.43	85,923.14
应付投资顾问费		-	-
应交税费		691.72	7.51
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	108,066.54	140,011.66
负债合计		1,908,351.37	3,211,374.84
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	402,411,596.05	975,491,986.58
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	11,403,463.61	-59,115,523.93
净资产合计		413,815,059.66	916,376,462.65
负债和净资产总计		415,723,411.03	919,587,837.49

注：报告截止日2023年6月30日，基金份额总额402,411,596.05份，其中A类基金份额净值1.0293元，基金份额304,613,215.95份；C类基金份额净值1.0252元，基金份额97,798,380.10份。

6.2 利润表

会计主体：中信建投中证1000指数增强型证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年01月01日至 2023年06月30日	上年度可比期间 2022年06月28日（基金 合同生效日）至2022 年06月30日
一、营业总收入		93,658,986.37	77,649.09
1.利息收入		157,933.52	77,649.09
其中：存款利息收入	6.4.7.9	157,933.52	77,649.09
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-” 填列）		57,152,882.76	-
其中：股票投资收益	6.4.7.10	53,425,476.46	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	549,910.46	-
资产支持证券投资 收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.12	20,196.48	-
股利收益	6.4.7.13	3,157,299.36	-
以摊余成本计量的 金融资产终止确认 产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-

3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.14	36,227,825.78	-
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.15	120,344.31	-
减：二、营业总支出		3,628,809.82	89,803.12
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	2,942,622.73	70,913.31
2. 托管费	6.4.10.2.2	294,262.27	7,091.33
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	293,148.82	8,352.47
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. 税金及附加		64.37	-
8. 其他费用	6.4.7.16	98,711.63	3,446.01
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		90,030,176.55	-12,154.03
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		90,030,176.55	-12,154.03
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		90,030,176.55	-12,154.03

6.3 净资产(基金净值)变动表

会计主体：中信建投中证1000指数增强型证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日

	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	975,491,986.58	-	-59,115,523.93	916,376,462.65
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	975,491,986.58	-	-59,115,523.93	916,376,462.65
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-573,080,390.53	-	70,518,987.54	-502,561,402.99
（一）、综合收益总额	-	-	90,030,176.55	90,030,176.55
（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）	-573,080,390.53	-	-19,511,189.01	-592,591,579.54
其中：1.基金申购款	77,257,696.86	-	1,745,264.82	79,002,961.68
2.基金赎回款	-650,338,087.39	-	-21,256,453.83	-671,594,541.22
（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）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	402,411,596.05	-	11,403,463.61	413,815,059.66
项目	上年度可比期间 2022年06月28日（基金合同生效日）至2022年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	1,294,152,423.35	-	-	1,294,152,423.35
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-	-	-12,154.03	-12,154.03
（一）、综合收益总额	-	-	-12,154.03	-12,154.03
（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）	-	-	-	-
其中：1.基金申购款	-	-	-	-

2.基金赎回款	-	-	-	-
(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)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	1,294,152,423.35	-	-12,154.03	1,294,140,269.32

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:

黄凌

谭淼

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

6.4 报表附注

6.4.1 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%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《中信建投中证1000指数增强型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的相关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2023年1月1日至2023年6月30日期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2023年6月30日的财务状况以及2023年1月1日至2023年6月30日期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2023年1月1日至2023年6月30日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产

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

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2)金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3)衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

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

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1)具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2)交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

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变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。对于已开放转换业务的基金，上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

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在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

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

6.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

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并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

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

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发〔2017〕6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日

在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告(2017)13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国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》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

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〔2008〕1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税〔2012〕85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税〔2015〕101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税〔2016〕36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税〔2016〕46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税〔2016〕70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税〔2016〕140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税〔2017〕2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税〔2017〕56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税〔2017〕90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日
活期存款	4,452,906.84
等于：本金	4,452,034.57
加：应计利息	872.27
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	28,788,922.59
等于：本金	28,785,915.93
加：应计利息	3,006.66
减：坏账准备	-
合计	33,241,829.43

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	374,451,044.42	-	376,892,435.13	2,441,390.71	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	936,400.00	77.99	936,477.99	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	936,400.00	77.99	936,477.99	-
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	375,387,444.42	77.99	377,828,913.12	2,441,390.71	

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06月30日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	5,229,120.00	-	-	-

--股指期货	5,229,120.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	5,229,120.00	-	-	-

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	中证1000股指期货 2309合约	4.00	5,229,120.00	-56,000.00
合计				-56,000.00
减：可抵销 期货暂收 款				-56,000.00
净额				0.00

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

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

无余额。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无余额。

6.4.7.5 其他资产

无余额。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日
应付券商交易单元保证金	-

应付赎回费	44.16
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	89,260.15
其他应付	18,762.23
合计	108,066.54

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 中信建投中证1000指数增强A

金额单位：人民币元

项目 (中信建投中证1000指数增强 A)	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	719,647,842.14	719,647,842.14
本期申购	36,777,053.24	36,777,053.24
本期赎回（以“-”号填列）	-451,811,679.43	-451,811,679.43
本期末	304,613,215.95	304,613,215.95

6.4.7.7.2 中信建投中证1000指数增强C

金额单位：人民币元

项目 (中信建投中证1000指数增强 C)	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	255,844,144.44	255,844,144.44
本期申购	40,480,643.62	40,480,643.62
本期赎回（以“-”号填列）	-198,526,407.96	-198,526,407.96
本期末	97,798,380.10	97,798,380.10

6.4.7.8 未分配利润

6.4.7.8.1 中信建投中证1000指数增强A

单位：人民币元

项目 (中信建投中证1000指 数增强A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-22,333,668.75	-20,914,967.83	-43,248,636.58
本期利润	41,696,373.03	25,858,361.46	67,554,734.49
本期基金份额交易产 生的变动数	-7,463,727.20	-7,904,178.68	-15,367,905.88
其中：基金申购款	1,109,884.95	-224,815.97	885,068.98
基金赎回款	-8,573,612.15	-7,679,362.71	-16,252,974.86
本期已分配利润	-	-	-
本期末	11,898,977.08	-2,960,785.05	8,938,192.03

6.4.7.8.2 中信建投中证1000指数增强C

单位：人民币元

项目 (中信建投中证1000指 数增强C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-8,438,971.40	-7,427,915.95	-15,866,887.35
本期利润	12,105,977.74	10,369,464.32	22,475,442.06
本期基金份额交易产 生的变动数	-250,018.09	-3,893,265.04	-4,143,283.13
其中：基金申购款	1,760,402.18	-900,206.34	860,195.84
基金赎回款	-2,010,420.27	-2,993,058.70	-5,003,478.97
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,416,988.25	-951,716.67	2,465,271.58

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期

	2023年01月01日至2023年06月30日
活期存款利息收入	34,928.12
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	54,802.58
结算备付金利息收入	68,201.54
其他	1.28
合计	157,933.52

6.4.7.10 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
卖出股票成交总额	3,381,658,319.72
减：卖出股票成本总额	3,321,707,201.90
减：交易费用	6,525,641.36
买卖股票差价收入	53,425,476.46

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
债券投资收益——利息收入	909.21
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	549,001.25
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	549,910.46

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期

	2023年01月01日至2023年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	2,391,397.88
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,841,200.00
减：应计利息总额	1,090.92
减：交易费用	105.71
买卖债券差价收入	549,001.25

6.4.7.12 衍生工具收益

6.4.7.12.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

6.4.7.12.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2023年01月01日至2023年06月30日
期货投资	20,196.48

6.4.7.13 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
股票投资产生的股利收益	3,157,299.36
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	3,157,299.36

6.4.7.14 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
------	----

	2023年01月01日至2023年06月30日
1.交易性金融资产	36,283,825.78
——股票投资	36,378,322.75
——债券投资	-94,496.97
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-56,000.00
——权证投资	-
——期货投资	-56,000.00
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	36,227,825.78

6.4.7.15 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
基金赎回费收入	120,344.31
合计	120,344.31

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%。

6.4.7.16 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-

汇划手续费	9,451.48
合计	98,711.63

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，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表批准日，本基金无重大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
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
元达信资本管理（北京）有限公司	基金管理人的子公司

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

以下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01月01日至2023年06月30日		上年度可比期间 2022年06月28日（基金合同生效日） 至2022年06月30日	
	成交金额	占当期 股票成 交总额	成交金额	占当期 股票成 交总额

		的比例		的比例
中信建投 证券股份 有限公司	3,987,144,897.74	64.11%	-	-

6.4.10.1.2 权证交易

无。

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01月01日至2023年06月30日		上年度可比期间 2022年06月28日（基金合同生效日） 至2022年06月30日	
	成交金额	占当期 债券买 卖成交 总额的 比例	成交金额	占当期 债券买 卖成交 总额的 比例
中信建投 证券股份 有限公司	1,568,707.30	65.60%	-	-

6.4.10.1.4 债券回购交易

无。

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01月01日至2023年06月30日			
	当期佣金	占当期 佣金总 量的比 例	期末应付佣金余额	占期末应 付佣金总 额的比例
中信建投	1,698,214.00	64.00%	-	-

证券股份 有限公司				
--------------	--	--	--	--

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

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01月01日 至2023年06月30 日	上年度可比期间 2022年06月28日（基金合同 生效日）至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,942,622.73	70,913.31
其中：支付销售机构的客户维护费	1,359,717.32	32,389.02

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日 至2023年06月30 日	上年度可比期间 2022年06月28日（基金合同生 效日）至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	294,262.27	7,091.33

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。

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01月01日至2023年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	中信建投中证1000指数增强 A	中信建投中证1000指数增强 C	合计
中信建投证券股份有限公司	0.00	179,721.60	179,721.60
中信银行股份有限公司	0.00	25,624.94	25,624.94
合计	0.00	205,346.54	205,346.54
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2022年06月28日（基金合同生效日）至2022年06月30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	0.00	487.80	487.80
中信建投证券股份有限公司	0.00	5,816.22	5,816.22
合计	0.00	6,304.02	6,304.02

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。

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

无。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

无。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日		上年度可比期间 2022年06月28日（基金合同生效日） 至2022年06月30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	4,452,906.84	34,928.12	1,294,228,872.44	77,649.09
中信建投证券股份有限公司	12,745,149.17	30,967.54	-	-

注：本基金的银行存款由基金托管人中信银行股份有限公司保管，按约定利率计息。本基金证券户的存款由中信建投证券股份有限公司保管，按约定利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2023年01月01日至2023年06月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张/股）	总金额
中信建投证券股份有限公司	301260	格力博	网下配售	18,123	559,094.55
中信建投	301358	湖南裕能	网下配售	13,204	313,859.08

证券股份 有限公司					
中信建投 证券股份 有限公司	001337	四川黄金	网下配售	795	5,636.55

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

无。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

无。

6.4.12 期末（2023年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券 代码	证券 名称	成功 认购 日	受限 期	流通 受限 类型	认购 价格	期末 估值 单价	数量 （单 位：股）	期末 成本 总额	期末 估值 总额	备注
3013 58	湖南 裕能	2023- 02-01	6个 月以 上	创业 板打 新限 售	23.77	42.89	1,321	31,40 0.17	56,65 7.69	-
3012 60	格力 博	2023- 01-20	6个 月以 上	创业 板打 新限 售	30.85	23.63	1,813	55,93 1.05	42,84 1.19	-
3013 03	真兰 仪表	2023- 02-13	6个 月以 上	创业 板打 新限 售	26.80	22.32	1,058	28,35 4.40	23,61 4.56	-
3013 17	鑫磊 股份	2023- 01-12	6个 月以 上	创业 板打 新限 售	20.67	26.17	694	14,34 4.98	18,16 1.98	-

				售						
301373	凌玮科技	2023-01-20	6个月以上	创业板打新限售	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45	-

注：1、根据中国证监会《关于修改<上市公司证券发行管理办法>的决定》、《关于修改<创业板上市公司证券发行管理暂行办法>的决定》以及《关于修改<上市公司非公开发行股票实施细则>的决定》，本基金所认购的非公开发行股票，自发行结束之日起6个月内不得转让。

2、基金还可作为特定投资者，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。

3、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起6个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后6个月内不得转让。

4、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于6个月的限售期。

5、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。"

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

无。

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

无。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

无。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人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，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，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

无余额。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

无余额。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

无余额。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
AAA	-	-
AAA以下	936,477.99	467,728.20
未评级	-	-
合计	936,477.99	467,728.20

注：以上按长期信用评级的债券投资中不包含国债、政策性金融债及央行票据等。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

无余额。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

无余额。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

于2023年6月30日，除附注6.4.12.3中列示的卖出回购金融资产款余额将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日

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。

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》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的10%。

本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股股票不得超过该上市公司可流通股股票的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股票，不得超过该上市公司可流通股股票的30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。于2023年6月30日，本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计未超过基金资产净值的15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。于2023年6月30日，本基金确认的净赎回申请未超过7个工作日可变现资产的可变现价值。

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、债券投资等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023 年 06 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	33,241,829.43	-	-	-	33,241,829.43
结算备付金	3,770,980.00	-	-	-	3,770,980.00
存出保证金	627,494.40	-	-	-	627,494.40
交易性金融资产	-	-	936,477.99	376,892,435.13	377,828,913.12
应收申购款	-	-	-	254,194.08	254,194.08
资产总计	37,640,303.83	-	936,477.99	377,146,629.21	415,723,411.03
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,381,174.76	1,381,174.76
应付管理人报	-	-	-	347,841.77	347,841.77

酬					
应付托管费	-	-	-	34,784.15	34,784.15
应付销售服务费	-	-	-	35,792.43	35,792.43
应交税费	-	-	-	691.72	691.72
其他负债	-	-	-	108,066.54	108,066.54
负债总计	-	-	-	1,908,351.37	1,908,351.37
利率敏感度缺口	37,640,303.83	-	936,477.99	375,238,277.84	413,815,059.66
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	65,664,430.38	-	-	-	65,664,430.38
结算备付金	30,574,141.46	-	-	-	30,574,141.46
交易性金融资产	-	124,243.97	343,484.23	822,699,182.13	823,166,910.33
应收申购款	-	-	-	182,355.32	182,355.32
资产总计	96,238,571.84	124,243.97	343,484.23	822,881,537.45	919,587,837.49
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,089,297.73	2,089,297.73
应付管理人报酬	-	-	-	814,667.96	814,667.96
应付托管费	-	-	-	81,466.84	81,466.84
应付销售服务费	-	-	-	85,923.14	85,923.14
应交税费	-	-	-	7.51	7.51

其他负债	-	-	-	140,011.66	140,011.66
负债总计	-	-	-	3,211,374.84	3,211,374.84
利率敏感度缺口	96,238,571.84	124,243.97	343,484.23	819,670,162.61	916,376,462.65

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2023年6月30日，本基金持有的交易性债券投资公允价值占基金净资产的比例为0.23%（2022年12月31日：0.05%），因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响（2022年12月31日：同）。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金为指数增强型基金，以中证1000指数为标的指数，基金股票投资方面将主要采用指数增强量化投资策略，在严格控制跟踪误差的基础上，力求获得超越标的指数的超额收益。

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

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06月30日	上年度末 2022年12月31日
----	--------------------	---------------------

	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	376,892,435.13	91.08	822,699,182.13	89.78
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	936,477.99	0.23	467,728.20	0.05
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	377,828,913.12	91.30	823,166,910.33	89.83

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06月30日	上年度末 2022年12月31日
	业绩比较基准上升5%	39,789,426.61	22,461,379.56
	业绩比较基准下降5%	-39,789,426.61	-22,461,379.56

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	376,742,337.26	821,390,536.46
第二层次	936,477.99	385,863.40
第三层次	150,097.87	1,390,510.47
合计	377,828,913.12	823,166,910.33

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2023年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2022年12月31日：同)。

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资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§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	376,892,435.13	90.66
	其中：股票	376,892,435.13	90.66
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	936,477.99	0.23
	其中：债券	936,477.99	0.23
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	37,012,809.43	8.90
8	其他各项资产	881,688.48	0.21
9	合计	415,723,411.03	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	1,473,513.00	0.36
B	采矿业	6,080,010.00	1.47
C	制造业	273,551,395.60	66.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,916,473.72	2.40
E	建筑业	3,094,918.00	0.75
F	批发和零售业	9,289,383.00	2.24
G	交通运输、仓储和邮政业	12,234,190.40	2.96

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	21,771,589.12	5.26
J	金融业	7,726,962.00	1.87
K	房地产业	7,515,464.40	1.82
L	租赁和商务服务业	3,431,907.50	0.83
M	科学研究和技术服务业	7,816,764.50	1.89
N	水利、环境和公共设施管理业	2,404,335.02	0.58
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,861,303.00	0.45
R	文化、体育和娱乐业	5,597,664.00	1.35
S	综合	90,080.00	0.02
	合计	373,855,953.26	90.34

7.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,009,944.00	0.24
C	制造业	1,951,897.87	0.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	74,640.00	0.02
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-

L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,036,481.87	0.73

7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

无余额。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
1	600125	铁龙物流	698,800	4,220,752.00	1.02
2	603027	千禾味业	199,600	4,215,552.00	1.02
3	300457	赢合科技	237,600	4,196,016.00	1.01
4	000951	中国重汽	245,500	4,136,675.00	1.00
5	000811	冰轮环境	261,800	4,125,968.00	1.00
6	000885	城发环境	306,000	4,072,860.00	0.98
7	002126	银轮股份	229,900	4,069,230.00	0.98
8	600098	广州发展	656,100	4,054,698.00	0.98
9	688676	金盘科技	132,200	4,004,338.00	0.97
10	002611	东方精工	683,800	3,925,012.00	0.95

11	600312	平高电气	313,600	3,885,504.00	0.94
12	002612	朗姿股份	162,600	3,866,628.00	0.93
13	300232	洲明科技	422,100	3,857,994.00	0.93
14	605009	豪悦护理	79,600	3,820,800.00	0.92
15	300633	开立医疗	68,900	3,755,050.00	0.91
16	603197	保隆科技	69,200	3,754,100.00	0.91
17	002446	盛路通信	384,800	3,636,360.00	0.88
18	002237	恒邦股份	325,800	3,547,962.00	0.86
19	300856	科思股份	44,800	3,528,896.00	0.85
20	002215	诺普信	462,600	3,474,126.00	0.84
21	002011	盾安环境	248,000	3,429,840.00	0.83
22	600531	豫光金铅	541,900	3,413,970.00	0.82
23	600363	联创光电	90,800	3,368,680.00	0.81
24	002929	润建股份	76,200	3,307,842.00	0.80
25	000913	钱江摩托	180,300	3,286,869.00	0.79
26	603567	珍宝岛	218,400	3,267,264.00	0.79
27	301039	中集车辆	241,100	3,189,753.00	0.77
28	688508	芯朋微	54,800	3,177,852.00	0.77
29	601801	皖新传媒	331,000	3,108,090.00	0.75
30	002085	万丰奥威	442,900	3,069,297.00	0.74
31	688518	联赢激光	109,800	3,059,028.00	0.74
32	300294	博雅生物	84,300	3,058,404.00	0.74
33	002017	东信和平	232,840	3,052,532.40	0.74
34	002344	海宁皮城	639,200	3,023,416.00	0.73
35	000528	柳工	373,300	2,949,070.00	0.71
36	601567	三星医疗	231,600	2,925,108.00	0.71
37	603985	恒润股份	138,900	2,912,733.00	0.70
38	603328	依顿电子	345,500	2,860,740.00	0.69
39	002984	森麒麟	88,500	2,784,210.00	0.67
40	601222	林洋能源	339,900	2,783,781.00	0.67
41	603877	太平鸟	109,200	2,760,576.00	0.67

42	300827	上能电气	76,426	2,755,157.30	0.67
43	688133	泰坦科技	32,100	2,734,599.00	0.66
44	002641	公元股份	476,700	2,688,588.00	0.65
45	300416	苏试试验	122,300	2,636,788.00	0.64
46	300777	中简科技	55,500	2,622,930.00	0.63
47	600639	浦东金桥	208,200	2,583,762.00	0.62
48	600266	城建发展	508,100	2,581,148.00	0.62
49	600320	振华重工	662,500	2,471,125.00	0.60
50	600459	贵研铂业	161,200	2,466,360.00	0.60
51	600916	中国黄金	206,600	2,439,946.00	0.59
52	603979	金诚信	78,000	2,425,800.00	0.59
53	600458	时代新材	195,100	2,339,249.00	0.57
54	688128	中国电研	90,300	2,302,650.00	0.56
55	600562	国睿科技	141,300	2,289,060.00	0.55
56	002782	可立克	147,900	2,261,391.00	0.55
57	002544	普天科技	98,600	2,257,940.00	0.55
58	688578	艾力斯	83,100	2,239,545.00	0.54
59	600864	哈投股份	431,300	2,203,943.00	0.53
60	300775	三角防务	64,900	2,192,322.00	0.53
61	300226	上海钢联	66,680	2,160,432.00	0.52
62	688100	威胜信息	71,900	2,143,339.00	0.52
63	002737	葵花药业	85,700	2,085,938.00	0.50
64	002727	一心堂	76,900	2,030,160.00	0.49
65	600577	精达股份	472,100	1,992,262.00	0.48
66	603466	风语筑	141,300	1,964,070.00	0.47
67	688037	芯源微	11,400	1,948,830.00	0.47
68	300206	理邦仪器	128,800	1,942,304.00	0.47
69	002489	浙江永强	473,000	1,915,650.00	0.46
70	002335	科华数据	52,800	1,898,160.00	0.46
71	601311	骆驼股份	187,700	1,741,856.00	0.42
72	000950	重药控股	255,700	1,720,861.00	0.42

73	600776	东方通信	120,200	1,712,850.00	0.41
74	603439	贵州三力	99,500	1,697,470.00	0.41
75	002038	双鹭药业	167,000	1,685,030.00	0.41
76	301239	普瑞眼科	17,100	1,677,168.00	0.41
77	300737	科顺股份	181,000	1,657,960.00	0.40
78	688106	金宏气体	60,600	1,648,320.00	0.40
79	601619	嘉泽新能	358,900	1,632,995.00	0.39
80	300762	上海瀚讯	138,400	1,628,968.00	0.39
81	301367	怡和嘉业	10,900	1,616,906.00	0.39
82	002675	东诚药业	109,600	1,612,216.00	0.39
83	002204	大连重工	311,400	1,600,596.00	0.39
84	601908	京运通	262,900	1,590,545.00	0.38
85	301031	中熔电气	11,700	1,587,807.00	0.38
86	600581	八一钢铁	389,600	1,577,880.00	0.38
87	000555	神州信息	125,300	1,541,190.00	0.37
88	002060	粤水电	233,200	1,534,456.00	0.37
89	300869	康泰医学	66,700	1,531,432.00	0.37
90	688268	华特气体	18,900	1,525,797.00	0.37
91	002815	崇达技术	117,000	1,456,650.00	0.35
92	601519	大智慧	200,600	1,436,296.00	0.35
93	300811	铂科新材	24,040	1,428,937.60	0.35
94	002402	和而泰	84,100	1,428,018.00	0.35
95	002320	海峡股份	231,300	1,397,052.00	0.34
96	300567	精测电子	14,500	1,379,675.00	0.33
97	002990	盛视科技	37,400	1,376,320.00	0.33
98	002324	普利特	92,900	1,325,683.00	0.32
99	002234	民和股份	71,400	1,300,194.00	0.31
100	600583	海油工程	213,800	1,250,730.00	0.30
101	002918	蒙娜丽莎	80,900	1,249,096.00	0.30
102	002832	比音勒芬	35,227	1,247,388.07	0.30
103	603105	芯能科技	73,700	1,244,793.00	0.30

104	600211	西藏药业	20,700	1,229,580.00	0.30
105	600933	爱柯迪	52,400	1,220,396.00	0.29
106	601515	东风股份	278,200	1,218,516.00	0.29
107	002859	洁美科技	43,700	1,210,490.00	0.29
108	002991	甘源食品	15,700	1,204,190.00	0.29
109	002123	梦网科技	90,400	1,201,416.00	0.29
110	002108	沧州明珠	263,700	1,194,561.00	0.29
111	002768	国恩股份	48,700	1,178,053.00	0.28
112	002635	安洁科技	84,900	1,171,620.00	0.28
113	002839	张家港行	276,600	1,170,018.00	0.28
114	300910	瑞丰新材	23,200	1,166,960.00	0.28
115	002283	天润工业	181,600	1,165,872.00	0.28
116	002233	塔牌集团	150,900	1,164,948.00	0.28
117	002053	云南能投	103,600	1,162,392.00	0.28
118	688389	普门科技	49,300	1,158,057.00	0.28
119	002948	青岛银行	369,400	1,156,222.00	0.28
120	002636	金安国纪	125,200	1,155,596.00	0.28
121	688711	宏微科技	19,800	1,155,132.00	0.28
122	002701	奥瑞金	254,700	1,148,697.00	0.28
123	002048	宁波华翔	85,300	1,143,020.00	0.28
124	000828	东莞控股	124,800	1,141,920.00	0.28
125	688139	海尔生物	22,180	1,141,604.60	0.28
126	002158	汉钟精机	45,700	1,140,672.00	0.28
127	000685	中山公用	150,400	1,138,528.00	0.28
128	600908	无锡银行	212,100	1,136,856.00	0.27
129	603179	新泉股份	25,900	1,136,751.00	0.27
130	600635	大众公用	342,200	1,136,104.00	0.27
131	688166	博瑞医药	51,500	1,132,485.00	0.27
132	002847	盐津铺子	13,300	1,131,165.00	0.27
133	300470	中密控股	24,420	1,128,692.40	0.27
134	603588	高能环境	120,400	1,128,148.00	0.27

135	600210	紫江企业	211,700	1,126,244.00	0.27
136	688033	天宜上佳	58,900	1,126,168.00	0.27
137	000550	江铃汽车	81,200	1,123,808.00	0.27
138	002171	楚江新材	157,800	1,123,536.00	0.27
139	002135	东南网架	173,800	1,122,748.00	0.27
140	002314	南山控股	339,400	1,120,020.00	0.27
141	600502	安徽建工	212,000	1,119,360.00	0.27
142	600821	金开新能	162,400	1,118,936.00	0.27
143	002746	仙坛股份	141,832	1,117,636.16	0.27
144	000921	海信家电	41,400	1,115,730.00	0.27
145	601200	上海环境	117,398	1,114,107.02	0.27
146	000801	四川九洲	152,300	1,111,790.00	0.27
147	002706	良信股份	98,700	1,110,375.00	0.27
148	605008	长鸿高科	77,800	1,109,428.00	0.27
149	688007	光峰科技	53,200	1,109,220.00	0.27
150	603187	海容冷链	55,360	1,106,646.40	0.27
151	603129	春风动力	6,800	1,100,920.00	0.27
152	601126	四方股份	72,300	1,098,237.00	0.27
153	600869	远东股份	197,800	1,091,856.00	0.26
154	603071	物产环能	65,800	1,091,622.00	0.26
155	600688	上海石化	351,000	1,091,610.00	0.26
156	002695	煌上煌	101,800	1,088,242.00	0.26
157	603305	旭升集团	39,020	1,087,487.40	0.26
158	688356	键凯科技	10,200	1,086,810.00	0.26
159	688315	诺禾致源	40,900	1,085,895.00	0.26
160	603043	广州酒家	38,400	1,085,184.00	0.26
161	300224	正海磁材	84,200	1,082,812.00	0.26
162	603279	景津装备	34,500	1,081,920.00	0.26
163	300887	谱尼测试	27,300	1,080,534.00	0.26
164	000969	安泰科技	113,300	1,072,951.00	0.26
165	688278	特宝生物	24,400	1,071,404.00	0.26

166	605111	新洁能	24,600	1,070,592.00	0.26
167	002063	远光软件	123,100	1,068,508.00	0.26
168	603916	苏博特	80,700	1,068,468.00	0.26
169	002895	川恒股份	53,900	1,061,830.00	0.26
170	603718	海利生物	112,500	1,060,875.00	0.26
171	300034	钢研高纳	26,900	1,059,591.00	0.26
172	688018	乐鑫科技	8,066	1,047,128.12	0.25
173	603997	继峰股份	73,200	1,046,760.00	0.25
174	002698	博实股份	59,200	1,035,408.00	0.25
175	300725	药石科技	19,900	963,757.00	0.23
176	603919	金徽酒	40,100	941,548.00	0.23
177	002851	麦格米特	25,400	926,338.00	0.22
178	600477	杭萧钢构	212,900	870,761.00	0.21
179	300185	通裕重工	295,500	824,445.00	0.20
180	000923	河钢资源	56,800	766,800.00	0.19
181	002649	博彦科技	46,600	658,458.00	0.16
182	300109	新开源	26,400	656,568.00	0.16
183	601028	玉龙股份	58,700	631,025.00	0.15
184	300455	航天智装	51,400	588,530.00	0.14
185	601975	招商南油	205,700	588,302.00	0.14
186	002651	利君股份	75,400	585,858.00	0.14
187	300085	银之杰	49,500	582,120.00	0.14
188	601929	吉视传媒	314,500	578,680.00	0.14
189	000560	我爱我家	215,300	570,545.00	0.14
190	601069	西部黄金	44,100	566,244.00	0.14
191	603636	南威软件	38,100	558,927.00	0.14
192	002421	达实智能	156,300	550,176.00	0.13
193	600335	国机汽车	47,800	544,920.00	0.13
194	600717	天津港	122,500	542,675.00	0.13
195	000758	中色股份	112,200	529,584.00	0.13
196	603229	奥翔药业	23,800	499,324.00	0.12

197	601921	浙版传媒	52,800	458,832.00	0.11
198	600201	生物股份	47,700	453,627.00	0.11
199	002413	雷科防务	83,700	437,751.00	0.11
200	601702	华峰铝业	31,800	435,024.00	0.11
201	688277	天智航	21,300	392,772.00	0.09
202	000966	长源电力	65,784	367,074.72	0.09
203	603881	数据港	15,900	359,181.00	0.09
204	605168	三人行	3,875	333,017.50	0.08
205	002537	海联金汇	47,300	318,329.00	0.08
206	600120	浙江东方	80,700	309,081.00	0.07
207	600360	华微电子	42,500	292,400.00	0.07
208	688088	虹软科技	5,800	247,950.00	0.06
209	600572	康恩贝	35,600	243,860.00	0.06
210	300079	数码视讯	38,700	236,070.00	0.06
211	300002	神州泰岳	16,800	235,200.00	0.06
212	002959	小熊电器	2,800	233,800.00	0.06
213	301050	雷电微力	3,200	207,776.00	0.05
214	688383	新益昌	1,400	194,908.00	0.05
215	603345	安井食品	1,300	190,840.00	0.05
216	300123	亚光科技	25,800	187,824.00	0.05
217	300855	图南股份	4,820	170,242.40	0.04
218	600720	祁连山	14,600	166,002.00	0.04
219	000928	中钢国际	15,800	152,470.00	0.04
220	600750	江中药业	6,800	149,124.00	0.04
221	600129	太极集团	2,500	148,725.00	0.04
222	603920	世运电路	7,500	146,475.00	0.04
223	600587	新华医疗	4,100	144,853.00	0.04
224	002697	红旗连锁	23,500	137,240.00	0.03
225	300765	新诺威	10,517	135,564.13	0.03
226	688559	海目星	2,800	131,628.00	0.03
227	002987	京北方	6,000	131,520.00	0.03

228	600285	羚锐制药	7,900	126,874.00	0.03
229	600267	海正药业	11,100	126,318.00	0.03
230	603983	丸美股份	3,900	126,165.00	0.03
231	002006	精工科技	5,800	125,106.00	0.03
232	603368	柳药集团	4,900	121,079.00	0.03
233	688526	科前生物	5,060	120,377.40	0.03
234	301078	孩子王	10,400	118,872.00	0.03
235	003006	百亚股份	6,800	117,504.00	0.03
236	000650	仁和药业	18,600	114,204.00	0.03
237	600971	恒源煤电	14,600	113,734.00	0.03
238	603396	金辰股份	1,700	111,520.00	0.03
239	603690	至纯科技	3,200	111,488.00	0.03
240	002434	万里扬	12,400	110,980.00	0.03
241	600773	西藏城投	8,800	110,880.00	0.03
242	688091	上海谊众	1,500	110,445.00	0.03
243	301207	华兰疫苗	3,300	109,758.00	0.03
244	300674	宇信科技	6,100	107,848.00	0.03
245	688127	蓝特光学	6,000	105,780.00	0.03
246	000829	天音控股	11,700	105,768.00	0.03
247	601137	博威合金	6,700	104,252.00	0.03
248	002610	爱康科技	40,500	103,680.00	0.03
249	603601	再升科技	24,200	103,334.00	0.02
250	300332	天壕环境	9,000	103,230.00	0.02
251	601677	明泰铝业	7,300	101,324.00	0.02
252	603323	苏农银行	23,900	100,619.00	0.02
253	601886	江河集团	11,100	98,679.00	0.02
254	002461	珠江啤酒	11,200	98,672.00	0.02
255	000552	甘肃能化	29,600	98,568.00	0.02
256	600903	贵州燃气	11,300	97,745.00	0.02
257	000735	罗牛山	14,200	92,868.00	0.02
258	688366	昊海生科	1,100	92,642.00	0.02

259	301155	海力风电	1,200	92,496.00	0.02
260	300672	国科微	1,100	91,685.00	0.02
261	605388	均瑶健康	7,200	91,512.00	0.02
262	601528	瑞丰银行	18,800	91,180.00	0.02
263	000860	顺鑫农业	2,700	90,963.00	0.02
264	000035	中国天楹	19,800	90,684.00	0.02
265	600770	综艺股份	16,000	90,080.00	0.02
266	000756	新华制药	4,100	88,478.00	0.02
267	300666	江丰电子	1,300	88,348.00	0.02
268	002539	云图控股	9,800	88,004.00	0.02
269	002913	奥士康	2,300	87,814.00	0.02
270	300263	隆华科技	10,500	87,360.00	0.02
271	002243	力合科创	10,200	86,802.00	0.02
272	000737	北方铜业	16,100	86,779.00	0.02
273	300783	三只松鼠	4,400	85,976.00	0.02
274	000517	荣安地产	28,068	85,607.40	0.02
275	300119	瑞普生物	4,800	85,440.00	0.02
276	600246	万通发展	14,900	85,228.00	0.02
277	003012	东鹏控股	10,500	84,945.00	0.02
278	002967	广电计量	4,200	84,378.00	0.02
279	601918	新集能源	19,800	84,150.00	0.02
280	002837	英维克	2,800	83,832.00	0.02
281	000875	吉电股份	15,300	82,467.00	0.02
282	000006	深振业A	18,600	81,282.00	0.02
283	600055	万东医疗	3,900	81,237.00	0.02
284	688270	臻镭科技	1,240	80,513.20	0.02
285	002367	康力电梯	8,800	80,344.00	0.02
286	000030	富奥股份	15,500	78,120.00	0.02
287	601399	国机重装	24,300	77,274.00	0.02
288	002467	二六三	15,200	75,544.00	0.02
289	000061	农产品	12,600	75,474.00	0.02

290	300366	创意信息	6,100	75,396.00	0.02
291	603298	杭叉集团	3,200	75,360.00	0.02
292	001696	宗申动力	10,600	75,048.00	0.02
293	300900	广联航空	2,600	74,906.00	0.02
294	600929	雪天盐业	9,428	74,858.32	0.02
295	002216	三全食品	4,800	74,784.00	0.02
296	000982	中银绒业	49,100	74,632.00	0.02
297	300039	上海凯宝	10,800	74,520.00	0.02
298	688202	美迪西	870	74,167.50	0.02
299	002617	露笑科技	9,400	74,072.00	0.02
300	300068	南都电源	3,800	73,568.00	0.02
301	603530	神马电力	4,700	73,085.00	0.02
302	002498	汉缆股份	17,900	71,779.00	0.02
303	300738	奥飞数据	7,000	71,400.00	0.02
304	600777	新潮能源	27,700	70,081.00	0.02
305	603871	嘉友国际	4,440	69,752.40	0.02
306	600313	农发种业	8,100	69,741.00	0.02
307	600990	四创电子	2,200	69,608.00	0.02
308	301087	可孚医疗	1,400	69,020.00	0.02
309	600064	南京高科	10,400	68,744.00	0.02
310	002139	拓邦股份	5,200	67,860.00	0.02
311	688190	云路股份	920	67,160.00	0.02
312	600428	中远海特	10,500	66,150.00	0.02
313	000682	东方电子	6,800	66,096.00	0.02
314	600662	外服控股	11,400	65,208.00	0.02
315	603719	良品铺子	2,600	65,026.00	0.02
316	603171	税友股份	1,600	63,968.00	0.02
317	002097	山河智能	9,600	63,840.00	0.02
318	300456	赛微电子	2,600	63,648.00	0.02
319	002051	中工国际	5,300	63,229.00	0.02
320	600510	黑牡丹	10,400	63,128.00	0.02

321	603609	禾丰股份	6,700	60,970.00	0.01
322	600496	精工钢构	16,300	60,799.00	0.01
323	000686	东北证券	8,700	60,378.00	0.01
324	600328	中盐化工	6,530	58,770.00	0.01
325	002219	新里程	12,900	58,308.00	0.01
326	600456	宝钛股份	1,700	57,528.00	0.01
327	002950	奥美医疗	5,500	57,090.00	0.01
328	600984	建设机械	12,600	56,952.00	0.01
329	600835	上海机电	3,300	56,694.00	0.01
330	605589	圣泉集团	2,600	56,524.00	0.01
331	301268	铭利达	1,300	54,431.00	0.01
332	002100	天康生物	6,500	53,625.00	0.01
333	603132	金徽股份	4,700	53,298.00	0.01
334	000036	华联控股	12,900	53,148.00	0.01
335	002724	海洋王	5,800	50,344.00	0.01
336	603959	百利科技	4,300	49,450.00	0.01
337	600751	海航科技	20,700	49,059.00	0.01
338	002254	泰和新材	2,000	48,940.00	0.01
339	301267	华夏眼科	800	48,760.00	0.01
340	301216	万凯新材	2,900	48,227.00	0.01
341	600223	福瑞达	4,700	48,222.00	0.01
342	600400	红豆股份	14,600	47,888.00	0.01
343	300143	盈康生命	4,100	46,494.00	0.01
344	600682	南京新百	5,800	46,458.00	0.01
345	300171	东富龙	2,000	45,500.00	0.01
345	002004	华邦健康	9,100	45,500.00	0.01
347	000718	苏宁环球	16,600	45,318.00	0.01
348	000848	承德露露	5,100	45,135.00	0.01
349	600552	凯盛科技	3,800	44,992.00	0.01
350	002928	华夏航空	5,300	44,785.00	0.01
351	300860	锋尚文化	800	44,352.00	0.01

352	001269	欧晶科技	600	44,118.00	0.01
353	002838	道恩股份	2,600	43,680.00	0.01
354	000652	泰达股份	10,600	43,672.00	0.01
355	000543	皖能电力	6,600	43,560.00	0.01
356	600420	国药现代	3,858	43,556.82	0.01
357	601965	中国汽研	2,100	43,365.00	0.01
358	688425	铁建重工	9,000	43,290.00	0.01
359	301047	义翘神州	500	42,850.00	0.01
360	688148	芳源股份	3,500	42,700.00	0.01
361	300036	超图软件	1,800	42,678.00	0.01
362	600771	广誉远	1,200	42,324.00	0.01
363	301095	广立微	500	41,325.00	0.01
364	600874	创业环保	7,000	41,020.00	0.01
365	600403	大有能源	9,900	40,689.00	0.01
366	300693	盛弘股份	1,100	40,612.00	0.01
367	600996	贵广网络	4,000	39,280.00	0.01
368	000968	蓝焰控股	5,100	38,556.00	0.01
369	002274	华昌化工	5,100	38,199.00	0.01
370	600163	中闽能源	6,700	37,386.00	0.01
371	000672	上峰水泥	4,000	36,520.00	0.01
372	600073	上海梅林	4,900	35,770.00	0.01
373	300267	尔康制药	10,800	34,884.00	0.01
374	300428	立中集团	1,500	34,590.00	0.01
375	688131	皓元医药	600	34,188.00	0.01
376	601963	重庆银行	4,300	34,013.00	0.01
377	002416	爱施德	4,600	33,948.00	0.01
378	002194	武汉凡谷	3,100	33,883.00	0.01
379	300348	长亮科技	3,200	33,408.00	0.01
380	603801	志邦家居	1,000	33,020.00	0.01
381	605338	巴比食品	1,300	32,825.00	0.01
382	300702	天宇股份	1,300	31,551.00	0.01

383	002044	美年健康	4,300	30,573.00	0.01
384	688173	希荻微	1,300	29,744.00	0.01
385	300579	数字认证	1,000	28,900.00	0.01
386	002267	陕天然气	3,600	28,512.00	0.01
387	600789	鲁抗医药	4,100	26,322.00	0.01
388	002545	东方铁塔	3,700	26,122.00	0.01
389	601330	绿色动力	3,400	25,126.00	0.01
390	603299	苏盐井神	2,500	24,950.00	0.01
391	600110	诺德股份	3,300	23,892.00	0.01
392	000025	特力A	1,300	23,751.00	0.01
393	002239	奥特佳	8,800	23,496.00	0.01
394	002020	京新药业	1,800	23,076.00	0.01
395	300894	火星人	900	22,986.00	0.01
396	000813	德展健康	7,700	22,638.00	0.01
397	001301	尚太科技	400	22,524.00	0.01
398	603033	三维股份	1,100	22,385.00	0.01
399	300027	华谊兄弟	8,000	22,320.00	0.01
400	600761	安徽合力	1,100	21,923.00	0.01
401	688235	百济神州	200	21,822.00	0.01
402	600986	浙文互联	3,400	21,760.00	0.01
403	688161	威高骨科	500	21,655.00	0.01
404	605507	国邦医药	1,000	21,270.00	0.01
405	603170	宝立食品	1,000	21,260.00	0.01
406	002130	沃尔核材	2,600	21,112.00	0.01
407	000546	ST金圆	3,300	21,021.00	0.01
408	000016	深康佳A	4,400	20,768.00	0.01
409	002312	川发龙蟒	2,500	20,325.00	0.00
410	605090	九丰能源	900	20,097.00	0.00
411	600643	爱建集团	3,900	19,500.00	0.00
412	002567	唐人神	2,800	18,620.00	0.00
413	002285	世联行	7,200	18,432.00	0.00

414	600037	歌华有线	2,200	18,282.00	0.00
415	300180	华峰超纤	5,000	18,050.00	0.00
416	002993	奥海科技	500	16,960.00	0.00
417	000901	航天科技	1,500	16,050.00	0.00
418	002643	万润股份	900	15,669.00	0.00
419	603363	傲农生物	1,700	15,589.00	0.00
420	002733	雄韬股份	900	15,561.00	0.00
421	600006	东风汽车	2,600	15,366.00	0.00
422	601101	昊华能源	2,600	15,132.00	0.00
423	300352	北信源	3,000	15,120.00	0.00
424	600169	太原重工	6,000	14,880.00	0.00
425	300696	爱乐达	600	14,760.00	0.00
426	300723	一品红	500	14,650.00	0.00
427	002435	长江健康	3,000	14,610.00	0.00
428	000603	盛达资源	1,200	14,508.00	0.00
429	002034	旺能环境	900	14,229.00	0.00
430	000791	甘肃能源	2,700	14,121.00	0.00
431	001213	中铁特货	3,100	13,671.00	0.00
432	605199	葫芦娃	900	13,626.00	0.00
433	002390	信邦制药	3,000	13,290.00	0.00
434	002484	江海股份	600	12,774.00	0.00
435	603057	紫燕食品	500	12,565.00	0.00
436	605222	起帆电缆	600	12,396.00	0.00
437	300602	飞荣达	800	12,392.00	0.00
438	601700	风范股份	2,300	12,213.00	0.00
439	000688	国城矿业	800	12,136.00	0.00
440	603995	甬金股份	500	11,955.00	0.00
441	301301	川宁生物	1,300	11,648.00	0.00
442	600478	科力远	1,600	11,424.00	0.00
443	301219	腾远钴业	300	11,208.00	0.00
444	601212	白银有色	4,100	11,152.00	0.00

445	600993	马应龙	400	11,124.00	0.00
446	600017	日照港	3,700	11,063.00	0.00
447	002573	清新环境	2,000	11,020.00	0.00
448	605296	神农集团	500	10,710.00	0.00
449	002960	青鸟消防	500	9,105.00	0.00
450	601208	东材科技	700	8,890.00	0.00
451	002807	江阴银行	2,400	8,856.00	0.00
452	600523	贵航股份	600	8,616.00	0.00
453	002747	埃斯顿	300	8,400.00	0.00
454	600742	一汽富维	1,000	8,190.00	0.00
455	000566	海南海药	1,000	5,000.00	0.00
456	600305	恒顺醋业	400	4,344.00	0.00
457	600811	东方集团	1,900	4,256.00	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	600	1,014,600.00	0.25
2	601857	中国石油	135,200	1,009,944.00	0.24
3	688502	茂莱光学	4,100	787,200.00	0.19
4	600941	中国移动	800	74,640.00	0.02
5	301358	湖南裕能	1,321	56,657.69	0.01
6	301260	格力博	1,813	42,841.19	0.01
7	301303	真兰仪表	1,058	23,614.56	0.01
8	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.00
9	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600933	爱柯迪	17,460,933.00	1.91
2	000893	亚钾国际	14,260,813.00	1.56
3	300856	科思股份	13,970,279.00	1.52
4	000928	中钢国际	13,693,007.00	1.49
5	603876	鼎胜新材	13,353,509.00	1.46
6	300633	开立医疗	13,268,793.00	1.45
7	002446	盛路通信	12,381,238.00	1.35
8	300226	上海钢联	12,141,767.80	1.32
9	002727	一心堂	12,038,249.00	1.31
10	002895	川恒股份	11,786,977.30	1.29
11	600363	联创光电	11,739,141.41	1.28
12	000921	海信家电	11,428,594.00	1.25
13	603612	索通发展	11,153,809.00	1.22
14	300761	立华股份	11,008,493.00	1.20
15	603305	旭升集团	10,926,747.20	1.19
16	300232	洲明科技	10,788,770.00	1.18
17	000913	钱江摩托	10,778,330.00	1.18
18	002421	达实智能	10,593,251.00	1.16
19	002472	双环传动	10,582,361.00	1.15
20	601702	华峰铝业	10,476,370.00	1.14

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	603876	鼎胜新材	17,428,273.40	1.90
2	600933	爱柯迪	16,700,897.00	1.82

3	300761	立华股份	16,057,289.00	1.75
4	601702	华峰铝业	15,220,480.68	1.66
5	603305	旭升集团	14,859,963.90	1.62
6	000928	中钢国际	14,692,061.00	1.60
7	600508	上海能源	14,512,193.03	1.58
8	000893	亚钾国际	14,002,841.47	1.53
9	300856	科思股份	13,932,019.00	1.52
10	000913	钱江摩托	13,399,003.60	1.46
11	600761	安徽合力	13,392,339.12	1.46
12	002895	川恒股份	13,028,446.82	1.42
13	603179	新泉股份	13,017,514.54	1.42
14	300633	开立医疗	13,014,020.00	1.42
15	002463	沪电股份	12,873,637.28	1.40
16	000811	冰轮环境	12,682,183.55	1.38
17	601137	博威合金	12,655,912.00	1.38
18	002698	博实股份	12,643,883.00	1.38
19	600963	岳阳林纸	12,640,870.72	1.38
20	300130	新国都	12,479,898.78	1.36

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,839,522,132.15
卖出股票收入（成交）总额	3,381,658,319.72

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	-	-
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)	936,477.99	0.23
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	936,477.99	0.23

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	127086	恒邦转债	9,364	936,477.99	0.23

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

无余额。

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

无余额。

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

无余额。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

无。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 报告期内，本基金投资决策程序符合相关法律法规的要求，未发现本基金投资的前十名证券的发行主体出现本期被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.12.2 基金投资的前十名股票未超出基金合同规定的备选股票库。

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	627,494.40
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	254,194.08
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	881,688.48

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

无余额。

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

无余额。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	301358	湖南裕能	56,657.69	0.01	创业板打新限售

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
中信建投中证1000指数增强A	12,448	24,470.86	4,878,074.16	1.6014%	299,735,141.79	98.3986%
中信建投中证1000指数增强C	3,310	29,546.34	10,803,165.26	11.0464%	86,995,214.84	88.9536%
合计	15,633	25,741.16	15,681,239.42	3.8968%	386,730,356.63	96.1032%

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	中信建投中证1000指数增强A	209,961.17	0.0689%
	中信建投中证1000指数增强C	14,875.98	0.0152%
	合计	224,837.15	0.0559%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	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	0~10
	合计	0~10
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	0~10
	合计	0~10

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	中信建投中证1000指数增强A	中信建投中证1000指数增强C
基金合同生效日(2022年06月28日)基金份额总额	913,074,067.12	381,078,356.23
本报告期期初基金份额总额	719,647,842.14	255,844,144.44
本报告期基金总申购份额	36,777,053.24	40,480,643.62
减：本报告期基金总赎回份额	451,811,679.43	198,526,407.96
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	304,613,215.95	97,798,380.10

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，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

本报告期内，高翔先生于2023年1月12日离任基金管理人副总经理、首席信息官，王欢女士于2023年3月31日起担任基金管理人财务负责人；

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

本报告期内，基金托管人中信银行股份有限公司董事会于2023年4月17日收到董事长、非执行董事朱鹤新先生的辞呈。董事会选举党委书记、副董事长、董事方合英先生为董事长，将自中国银行业监管机构核准其董事长任职资格之日起正式就任。

本报告期内，基金托管人中信银行股份有限公司董事会于2023年4月17日收到行长方合英先生的辞呈。董事会聘任党委副书记、董事、常务副行长刘成先生为行长，将自中国银行业监管机构核准其行长任职资格之日起正式就任。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，无涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略未发生改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）为本基金提供审计服务，本报告期内未发生变更。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，基金管理人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期	佣金	占当期	

	单元数量		股票成交总额的比例		佣金总量的比例	
方正证券（券商柜台）	2	1,424,043,352.75	22.90%	606,518.42	22.86%	-
信达证券（券商柜台）	2	808,201,053.03	12.99%	348,620.61	13.14%	-
中信建投证券	4	3,987,144,897.74	64.11%	1,698,214.00	64.00%	-

注：1、根据中国证监会《关于完善证券投资基金交易席位制度有关问题的通知》（证监基金字〔2007〕48号）的规定及本基金管理人的《中信建投基金管理有限公司公募基金交易单元管理办法》，基金管理人制定了提供交易单元的券商的选择标准，具体如下：

（1）证券经纪商的选择由公司权益投资一部负责人根据证券经纪商投资研究服务综合评价，作出交易单元开设或撤销的相关决定。经公司分管领导通过后，方可办理相关的交易单元开设或撤销事宜。

（2）权益投资一部每季度组织公募投研条线人员完成对各往来证券经纪商的研究服务评估。根据评估结果调整确定个别证券经纪商的交易金额及比率限制的参考。

（3）评估实行评分制，具体如下：

分配权重（100分）=基础研究服务（70%）+综合研究服务（20%）+特别研究服务（10%）。基础研究服务占70%权重和综合研究服务占20%权重，由公募投研条线人员进行打分；特别研究服务占10%权重，由系统跟踪股票涨跌幅后生成得分。

2、根据以上标准进行考察后，基金管理人确定券商，与被选择的券商签订委托协议，并报中国证监会备案及通知基金托管人。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		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	成交金额	占当期权证成交总	成交金额	占当期基金成交总

				交总 额的 比例		额 的 比例		额 的 比例
方正 证券 (券 商 柜 台)	578, 137. 18	24. 18%	-	-	-	-	-	-
信达 证券 (券 商 柜 台)	244, 553. 40	10. 23%	-	-	-	-	-	-
中 信 建 投 证 券	1, 568, 707. 30	65. 60%	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

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

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

	季度报告		
17	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金在中信银行股份有限公司开通基金转换业务的公告	规定网站、规定报刊	2023-04-25
18	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加安信证券股份有限公司为代销机构并开通定期定额投资业务及开展费率优惠的公告	规定网站、规定报刊	2023-05-15
19	关于调整中信建投基金管理有限公司旗下部分基金在北京雪球基金销售有限公司最低申购金额、最低赎回份额及最低持有份额限制的公告	规定网站、规定报刊	2023-05-19
20	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加玄元保险代理有限公司为代销机构并开通定期定额投资业务及开展费率优惠的公告	规定网站、规定报刊	2023-05-23
21	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加平安证券股份有限公司为代销机构并开通定期定额投资业务及开展费率优惠的公告	规定网站、规定报刊	2023-06-05
22	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金增加上海华夏财富投资管理有限公司为代销机构并开通定期定额投资业务及开展费率优惠的公告	规定网站、规定报刊	2023-06-06
23	关于中信建投基金管理有限公司旗下部分基金在中信建投证券股份有限公司开通基	规定网站、规定报刊	2023-06-16

	金转换业务的公告		
--	----------	--	--

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

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。

11.2 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。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金注册的文件；
- 2、《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。

12.2 存放地点

基金管理人、基金托管人处。

12.3 查阅方式

投资者可以在营业时间免费查阅，也可按工本费购买复印件。

中信建投基金管理有限公司

二〇二三年八月三十一日