

# 明亚中证 1000 指数增强型证券投资基金 2023 年中期报告

2023 年 6 月 30 日

基金管理人：明亚基金管理有限责任公司

基金托管人：招商证券股份有限公司

送出日期：2023 年 8 月 30 日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 8 月 17 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 4 月 25 日起至 6 月 30 日止。

## 1.2 目录

<b>§ 1 重要提示及目录</b>	<b>2</b>
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
<b>§ 2 基金简介</b>	<b>5</b>
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	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
<b>§ 3 主要财务指标和基金净值表现</b>	<b>6</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 其他指标	9
<b>§ 4 管理人报告</b>	<b>9</b>
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	10
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	10
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>12</b>
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	12
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	12
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	12
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>12</b>
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	14
6.3 净资产（基金净值）变动表	15
6.4 报表附注	17
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>41</b>
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	49
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50

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 .....	50
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细 .....	50
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 .....	50
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 .....	50
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	50
7.12 投资组合报告附注 .....	50
<b>§ 8 基金份额持有人信息 .....</b>	<b>51</b>
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 .....	51
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 .....	52
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 .....	52
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>53</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>53</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	53
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 .....	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	53
10.4 基金投资策略的改变 .....	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	53
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 .....	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	54
10.8 其他重大事件 .....	54
<b>§ 11 影响投资者决策的其他重要信息 .....</b>	<b>55</b>
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 .....	55
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 .....	55
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>55</b>
12.1 备查文件目录 .....	55
12.2 存放地点 .....	56
12.3 查阅方式 .....	56

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	明亚中证 1000 指数增强型证券投资基金	
基金简称	明亚中证 1000 指数增强	
基金主代码	017505	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 4 月 25 日	
基金管理人	明亚基金管理有限责任公司	
基金托管人	招商证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	51,281,396.17 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	明亚中证 1000 指数增强 A	明亚中证 1000 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	017505	017506
报告期末下属分级基金的份额总额	50,843,142.62 份	438,253.55 份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票指数增强型基金,在力求对中证 1000 指数进行有效跟踪的基础上,通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制,力争实现超越目标指数的投资收益,谋求基金资产的长期增值;力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%,年化跟踪误差不超过 7.75%。
投资策略	1、大类资产配置策略;2、股票投资策略:(1)指数投资策略;(2)量化增强策略(量化多因子模型、结构化风险模型、行业轮动模型、组合优化模型);3、债券投资策略;4、衍生品投资策略(股指期货交易策略、股票期权投资策略、国债期货交易策略);5、资产支持证券投资策略;6、可转换债券、可交换债券投资策略;7、参与融资及转融通证券出借业务投资策略。
业绩比较基准	中证 1000 指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。
风险收益特征	R4

### 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	明亚基金管理有限责任公司	招商证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	杨丽冰
	联系电话	韩鑫普 0755-82943666
	0755-23626585	

	电子邮箱	compliance@mingyafunds.com	tgb@cmschina.com.cn
客户服务电话		4008-785-795	95565
传真		0755-23626574	
注册地址		深圳市前海深港合作区南山街道前海大道前海嘉里商务中心四期 T1 写字楼 1804、1803B	0755-82960794
办公地址		深圳市前海深港合作区南山街道前海大道前海嘉里商务中心四期 T1 写字楼 1804、1803B	深圳市福田区福田街道福华一路 111 号
邮政编码		518000	518000
法定代表人		丁玥	霍达

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.mingyafunds.com
基金中期报告备置地点	深圳市前海深港合作区南山街道前海大道前海嘉里商务中心四期 T1 写字楼 1804、1803B

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	明亚基金管理有限责任公司	深圳市前海深港合作区南山街道前海大道前海嘉里商务中心四期 T1 写字楼 1804、1803B

## § 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	2023 年 4 月 25 日（基金合同生效日）-2023 年 6 月 30 日	
和指标	明亚中证 1000 指数增强 A	明亚中证 1000 指数增强 C
本期已实现收益	302,901.32	12,173.39
本期利润	374,080.33	12,813.05

加权平均基金份额本期利润	0.0026	0.0010
本期加权平均净值利润率	0.26%	0.10%
本期基金份额净值增长率	0.50%	0.51%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2023 年 6 月 30 日)	
期末可供分配利润	153,411.72	1,341.50
期末可供分配基金份额利润	0.0030	0.0031
期末基金资产净值	51,098,989.85	440,477.03
期末基金份额净值	1.0050	1.0051
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2023 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	0.50%	0.51%

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

3、以上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（例如基金申购赎回费、基金转换费等），计入费用后实际利润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

明亚中证 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	0.39%	0.75%	0.59%	0.99%	-0.20%	-0.24%
自基金合同生效起	0.50%	0.50%	-1.73%	0.87%	2.23%	-0.37%

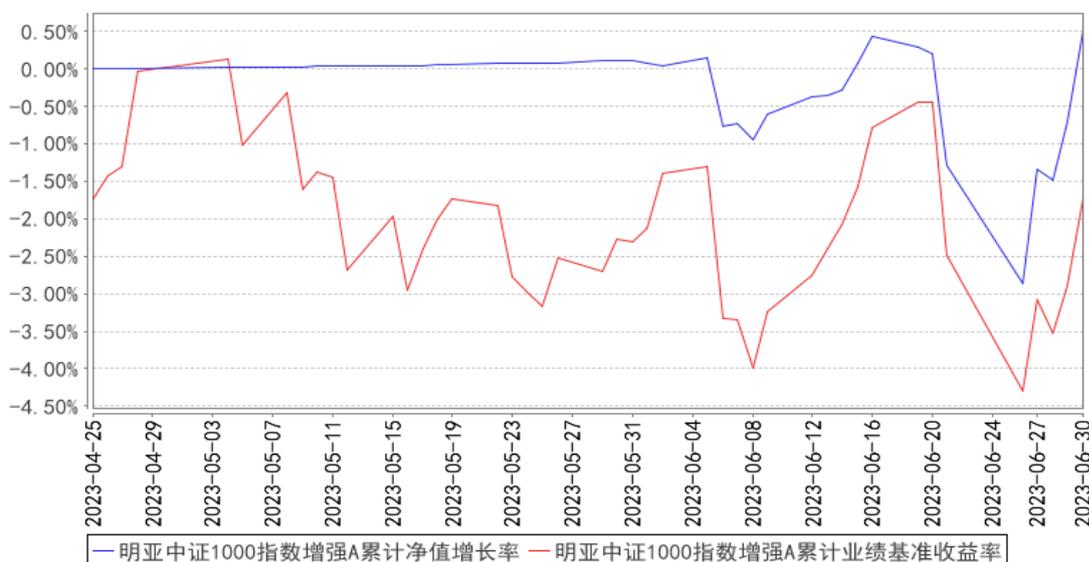
至今						
----	--	--	--	--	--	--

明亚中证 1000 指数增强 C

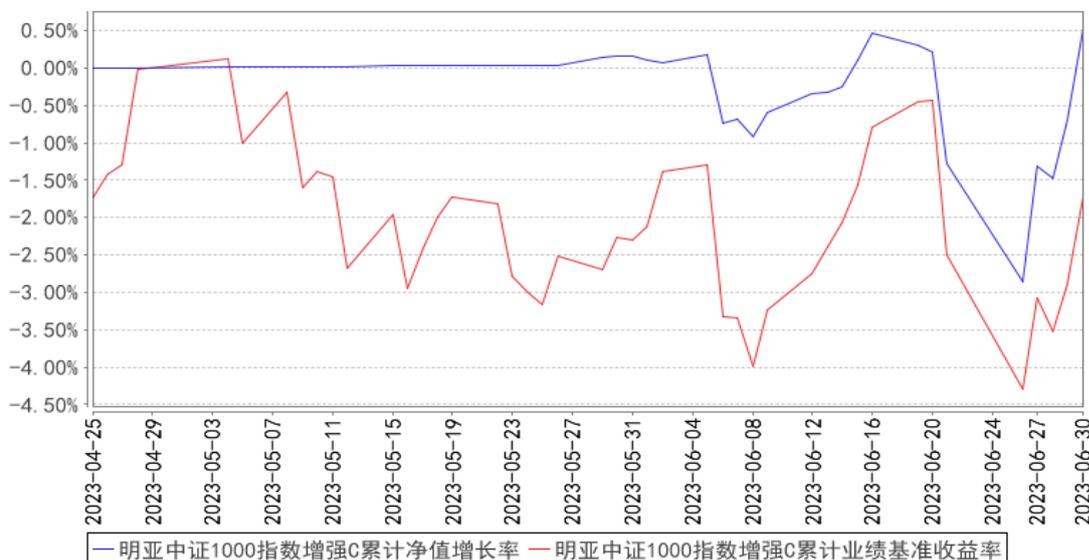
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①—③	②—④
过去一个月	0.35%	0.75%	0.59%	0.99%	-0.24%	-0.24%
自基金合同生效起至今	0.51%	0.50%	-1.73%	0.87%	2.24%	-0.37%

### 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

明亚中证1000指数增强A累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



明亚中证1000指数增强C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



### 3.3 其他指标

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

基金管理人：明亚基金管理有限责任公司于 2019 年 2 月 11 日获得中国证监会核准设立，2019 年 11 月 18 日取得中华人民共和国经营证券期货业务许可证，实缴资本 10980 万元人民币，注册地为深圳前海。明亚基金管理有限责任公司目前管理明亚价值长青混合型证券投资基金以及明亚中证 1000 指数增强型证券投资基金。明亚基金管理有限责任公司股东均为资产管理业专业人士，核心管理团队成员拥有二十多年的管理经验，将“基本面研究”和“量化策略”有效结合，秉持为投资者创造价值的坚定信念，致力于为投资者的长期利益服务。

#### 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		
何明	本基金的基金经理、研究部总监	2023 年 4 月 25 日	-	28 年	国际金融硕士、MBA，曾任国投瑞银基金管理有限公司研究部研究员、研究部总监、基金经理，2020 年 7 月加入明亚基金管理有限责任公司，现任研究部总监、权益投资部基金经理。
孔令伟	投资经理	2023 年 6 月 19 日	-	2 年	上海交通大学硕士研究生。曾先后任职于德勤永华会计师事务所（特殊普通合伙），平安资产管理有限责任公司，上海系数投资管理合伙企业（有限合伙）。2022 年 7 月加入明亚基金管理有限责任公司，历任量化投资部总监助理、投资经理。2023 年 6 月起任明亚中证 1000 指数增强型证券投资基金基金经理。

注：

- 1、本处基金经理的“任职日期”指中国证券投资基金业协会核准任职注册的日期；
- 2、证券从业年限计算标准遵从《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

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

报告期内不存在基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

报告期内，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销售机构监督管理办法》和《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》等有关法律法规及各项实施准则的规定以及《明亚中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》等基金法律文件的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。

报告期内，基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的情况。

#### 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

报告期内，基金管理人严格按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司内部相关制度等规定，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，公平对待旗下管理的所有基金和投资组合，未发现违反公平交易原则的情况。

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

#### 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

本基金为股票指数增强型基金，在力求对中证 1000 指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。

本基金运用了多因子选股模型、风险模型等量化模型，在组合构建中控制与中证 1000 指数的行业偏离度、风格偏离度、个股偏离度等，同时，股票组合中 80%以上的权重为中证 1000 指数的成分股，以在与中证 1000 指数保持较小的跟踪误差前提下，追求较为稳定的超额收益。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末明亚中证 1000 指数增强 A 的基金份额净值为 1.0050 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.50%，同期业绩比较基准收益率为 -1.73%；截至本报告期末明亚中证 1000 指数增强 C 的基金份额净值为 1.0051 元，本报告期基金份额净值增长率为 0.51%，同期业绩比较基准收益率为 -1.73%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们对下半年谨慎乐观。上半年经济增长差强人意，但商品、人民币汇率等多项金融资产价格已经逼近 2022 年 10 月低点，经济增长存在压力已基本成为市场共识，盈利预测进一步下修的空间有限，市场在当前位置上有望逐步企稳。

考虑到经济转型的长期目标和债务约束的短期现实，对强刺激政策不应有过高预期，下半年总量相关的资产有估值修复的动能，但弹性和空间相对有限，市场可能依旧以结构性机会为主。在国企改革方面，可能存在企业间通过并购重组做大、做强、做精、做优的投资机会；在产业趋势推动的方向上，市场可能由单一的事件驱动，转为关注能在商业化、产业化方面取得重大进展的领域。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格遵守《企业会计准则》、《证券投资基金会计核算业务指引》以及中国证券监督管理委员会颁布的《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》等相关规定和基金合同的约定。日常估值由本基金管理人同本基金托管人一同进行，基金份额净值由本基金管理人完成估值后，经本基金托管人复核无误后由本基金管理人对外公布。月末、年中和年末估值复核与基金会计账务的核对同时进行。

本基金管理人由总经理和投资部门、研究部、交易部、基金运营部、合规风控部负责人组成了估值委员会，负责组织制定和适时修订基金估值政策和程序，指导和监督整个估值流程。估值委员会成员均为公司各部门人员，均具有基金从业资格、专业胜任能力和相关工作经历。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。

本基金本报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金收益分配原则：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相应类别的基金份额进行再投资，且基金份额持有人可对 A 类、C 类基金份额分别选择不同的分红方式；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金收益分配后任一类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的任一类基金份额净值减去该类别的每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值。

本基金本报告期末未实施利润分配。

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

报告期内，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万的情形。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，招商证券股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

#### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

### § 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：明亚中证 1000 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2023 年 6 月 30 日
-----	-----	------------------------

<b>资产：</b>		
银行存款	6.4.7.1	5,991,932.11
结算备付金		1,900,058.25
存出保证金		473,385.60
交易性金融资产	6.4.7.2	43,286,341.90
其中：股票投资		43,286,341.90
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	6.4.7.3	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-
债权投资	6.4.7.5	-
其中：债券投资		-
资产支持证券投资		-
其他投资		-
其他债权投资	6.4.7.6	-
其他权益工具投资	6.4.7.7	-
应收清算款		-
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.8	-
资产总计		51,651,717.86
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年6月30日</b>
<b>负 债：</b>		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	6.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		-
应付赎回款		29,272.68
应付管理人报酬		43,564.68
应付托管费		6,534.70
应付销售服务费		157.21
应付投资顾问费		-
应交税费		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.9	32,721.71
负债合计		112,250.98

<b>净资产：</b>		
实收基金	6.4.7.10	51,281,396.17
其他综合收益	6.4.7.11	-
未分配利润	6.4.7.12	258,070.71
净资产合计		51,539,466.88
负债和净资产总计		51,651,717.86

注：报告截止日 2023 年 6 月 30 日，基金份额总额 51,281,396.17 份，其中明亚中证 1000 指数增强 A 基金份额净值 1.0050 元，份额总额 50,843,142.62 份；明亚中证 1000 指数增强 C 基金份额净值 1.0051 元，份额总额 438,253.55 份。

## 6.2 利润表

会计主体：明亚中证 1000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2023 年 4 月 25 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2023 年 4 月 25 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
<b>一、营业总收入</b>		750,340.78
1. 利息收入		547,022.97
其中：存款利息收入	6.4.7.13	509,925.76
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		37,097.21
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		127,965.47
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-51,938.06
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.15	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.16	-
贵金属投资收益	6.4.7.17	-
衍生工具收益	6.4.7.18	-99.52
股利收益	6.4.7.19	180,003.05
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）	6.4.7.20	71,818.67
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.21	3,533.67
<b>减：二、营业总支出</b>		363,447.40
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	283,429.53

2. 托管费	6.4.10.2.2	42,514.43
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	9,075.33
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失	6.4.7.22	-
7. 税金及附加		-
8. 其他费用	6.4.7.23	28,428.11
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		386,893.38
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		386,893.38
<b>五、其他综合收益的税后净额</b>		-
<b>六、综合收益总额</b>		386,893.38

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：明亚中证 1000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2023 年 4 月 25 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期			
	2023 年 4 月 25 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日			
	实收基金	其他综合收益	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)	270,893,303.84	-	-	270,893,303.84
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-219,611,907.67	-	258,070.71	-219,353,836.96

(一)、 综合收益总额	-	-	386,893.38	386,893.38
(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)	-219,611,907.67	-	-128,822.67	-219,740,730.34
其中:1. 基金申购款	4,351.17	-	-13.19	4,337.98
2. 基金赎回款	-219,616,258.84	-	-128,809.48	-219,745,068.32
(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)	51,281,396.17	-	258,070.71	51,539,466.88

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：

丁玥

基金管理人负责人

杨飞

主管会计工作负责人

李晓妹

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

明亚中证 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]2917 号《关于准予明亚中证 1000 指数增强型证券投资基金注册的批复》核准,由明亚基金管理有限责任公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《明亚中证 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 270,879,781.82 元,已经上会会计师事务所(特殊普通合伙)上会师报验字(2023)第 6284 号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《明亚中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》于 2023 年 4 月 25 日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为 270,893,303.84 份基金份额,其中认购资金利息折合 13,522.02 份基金份额。本基金的基金管理人为明亚基金管理有限责任公司,基金托管人为招商证券股份有限公司。

本基金根据认购/申购费用与销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取前端认购/申购费用,且不从本类别基金资产净值中计提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,且不收取认购/申购费用的基金份额,称为 C 类基金份额。本基金 A 类和 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《明亚中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围包括国内依法发行上市的股票(包括创业板及其他经中国证监会注册或核准上市的股票、存托凭证)、债券(包括国债、地方政府债券、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、次级债券、可转换债券(含可分离交易可转债)、可交换债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券等中国证监会允许投资的债券)、资产支持证券、货币市场工具(含同业存单、债券回购等)、银行存款(包括银行定期存款、银行协议存款、银行通知存款等)、衍生工具(股指期货、股票期权、国债期货)及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。

基金的投资组合比例为：本基金投资于股票的资产占基金资产的比例不低于 80%，投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产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、国债期货、股票期权合约需缴纳的交易保证金后保持不低于基金资产净值 5%的现金或者到期日在一年以内的政府债券。其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金业绩比较基准：中证 1000 指数收益率\*95%+银行活期存款利率（税后\*5%）。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则-基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、应用指南、解释以及其他相关规定（以下统称“企业会计准则”）编制，同时，对于在具体会计核算和信息披露方面，也参考了中国证监会制定的《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》、《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度和中期报告>》、中国证券投资基金业协会发布的《证券投资基金会计核算业务指引》、其他中国证监会及中国证券投资基金业协会颁布的相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 6.4.3 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 2023 年 6 月 30 日的财务状况以及 2023 年 4 月 25 日至 2022 年 6 月 30 日止期间的经营成果和净值变动情况。

#### 6.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 6.4.4.1 会计年度

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

##### 6.4.4.2 记账本位币

本基金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业务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业务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，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。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

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和债券投资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。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基金净值比例计算的金额。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，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扣除相关交易费用后的净额确认为投资收益，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。

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

其他费用根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额计入当期费用。

#### 6.4.4.11 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所有者权益转出。

#### 6.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

外币货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入汇兑损益科目。以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

#### 6.4.4.13 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。

#### 6.4.4.14 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，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[2022]566号《关于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(《关于固定收益品种的估值处理标准》另有规定的除外)、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

本基金本报告期末发生会计政策变更。

##### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末发生会计估计变更。

##### 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

[2014]81 号《财政部国家税务总局证监会关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[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]127 号《财政部国家税务总局证监会关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[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。

对基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市 H 股取得的股息红利，H 股公司应向中国证券登记结算有限责任公司(以下简称“中国结算”)提出申请，由中国结算向 H 股公司提供内地个人投资者名册，H 股公司按照 20% 的税率代扣个人所得税。基金通过沪港通或深港通投资香港联交所上市的非 H 股取得的股息红利，由中国结算按照 20% 的税率代扣个人所得税。

(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。基金通过沪港通或深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴

纳印花税。

(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 6 月 30 日
活期存款	2,953,755.45
等于：本金	2,952,076.07
加：应计利息	1,679.38
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	3,038,176.66
等于：本金	3,037,968.69
加：应计利息	207.97
减：坏账准备	-
合计	5,991,932.11

注：本基金持有的其他存款为存放在证券经纪商资金账户的证券交易结算资金。

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	43,186,803.23	-	43,286,341.90	99,538.67
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	43,186,803.23	-	43,286,341.90	99,538.67

## 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

## 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日			备注
	合同/名义 金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	
货币衍生工具	-	-	-	
权益衍生工具	3,972,600.00	-	-	
其中：股指期货投资	3,972,600.00	-	-	
其他衍生工具	-	-	-	
合计	3,972,600.00	-	-	

## 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
IM2307	中证1000股指期货 2307	3.00	3,944,880.00	-27,720.00
合计				-27,720.00
减：可抵销期货暂收款				-27,720.00
净额				-

## 6.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

本基金本期末未持有黄金衍生品。

## 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。

## 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

无。

## 6.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

无。

## 6.4.7.5 债权投资

## 6.4.7.5.1 债权投资情况

无。

## 6.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

无。

## 6.4.7.6 其他债权投资

## 6.4.7.6.1 其他债权投资情况

无。

## 6.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

无。

## 6.4.7.7 其他权益工具投资

## 6.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

无。

## 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

无。

## 6.4.7.8 其他资产

无。

## 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
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	-
其他	4,693.60
预提审计费	6,673.20
预提信息披露费	21,354.91
合计	32,721.71

## 6.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

明亚中证 1000 指数增强 A

项目	本期 2023 年 4 月 25 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	243,697,121.18	243,697,121.18
本期申购	883.67	883.67
本期赎回（以“-”号填列）	-192,854,862.23	-192,854,862.23
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	50,843,142.62	50,843,142.62

## 明亚中证 1000 指数增强 C

项目	本期 2023 年 4 月 25 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	27,196,182.66	27,196,182.66
本期申购	3,467.50	3,467.50
本期赎回（以“-”号填列）	-26,761,396.61	-26,761,396.61
基金拆分/份额折算前	-	-
基金拆分/份额折算调整	-	-
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
本期末	438,253.55	438,253.55

## 6.4.7.11 其他综合收益

无。

## 6.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

## 明亚中证 1000 指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	302,901.32	71,179.01	374,080.33
本期基金份额交易产生的变动数	-149,489.60	31,256.50	-118,233.10
其中：基金申购款	1.06	-5.75	-4.69
基金赎回款	-149,490.66	31,262.25	-118,228.41
本期已分配利润	-	-	-
本期末	153,411.72	102,435.51	255,847.23

## 明亚中证 1000 指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	12,173.39	639.66	12,813.05

本期基金份额交易产生的变动数	-10,831.89	242.32	-10,589.57
其中：基金申购款	6.35	-14.85	-8.50
基金赎回款	-10,838.24	257.17	-10,581.07
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,341.50	881.98	2,223.48

#### 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2023 年 4 月 25 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日	
活期存款利息收入		109,538.30
定期存款利息收入		-
其他存款利息收入		5,124.09
结算备付金利息收入		395,263.37
其他		-
合计		509,925.76

#### 6.4.7.14 股票投资收益

##### 6.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2023 年 4 月 25 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日	
股票投资收益——买卖股票差价收入		-51,938.06
股票投资收益——赎回差价收入		-
股票投资收益——申购差价收入		-
股票投资收益——证券出借差价收入		-
合计		-51,938.06

##### 6.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2023 年 4 月 25 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日	
卖出股票成交总额		-
减：卖出股票成本总额		-
减：交易费用		51,938.06
买卖股票差价收入		-51,938.06

##### 6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

无。

6.4.7.15 债券投资收益

6.4.7.15.1 债券投资收益项目构成

无。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

无。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.16 资产支持证券投资收益

6.4.7.16.1 资产支持证券投资收益项目构成

无。

6.4.7.16.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

无。

6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

无。

6.4.7.17 贵金属投资收益

6.4.7.17.1 贵金属投资收益项目构成

无。

6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

无。

6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

无。

6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入

无。

## 6.4.7.18 衍生工具收益

## 6.4.7.18.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

无。

## 6.4.7.18.2 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 4 月 25 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
股指期货投资收益	-99.52

## 6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 4 月 25 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	180,003.05
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	180,003.05

## 6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023 年 4 月 25 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	99,538.67
股票投资	99,538.67
债券投资	-
资产支持证券投资	-
基金投资	-
贵金属投资	-
其他	-
2. 衍生工具	-27,720.00
权证投资	-
期货投资	-27,720.00
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	71,818.67

## 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 4 月 25 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日

基金赎回费收入	3,533.67
合计	3,533.67

#### 6.4.7.22 信用减值损失

无。

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 4 月 25 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
审计费用	6,673.20
信息披露费	21,354.91
证券出借违约金	-
账户维护费	400.00
合计	28,428.11

#### 6.4.7.24 分部报告

无。

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金无需要说明的重大或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金无其他需要披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

- 2023 年 2 月 3 日，公司总经理及法定代表人由徐岱变更未丁玥；
- 2023 年 3 月 21 日，公司新增股东屠建宗（490 万元，占比 4.4627%）、丁玥（490 万元，占比 4.4627%）；
- 2023 年 5 月 9 日，公司股东孙超（490 万元，占比 4.4627%）退出，新增股东杨飞（490 万元，占比 4.4627%）。

##### 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
明亚基金管理有限责任公司	基金管理人
招商证券股份有限公司	基金托管人

丁玥	基金管理人的股东
杨飞	基金管理人的股东
屠建宗	基金管理人的股东

注：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

无

##### 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4月25日（基金合同生效日）至2023年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比例（%）
招商证券股份有限公司	43,186,803.23	100.00

###### 6.4.10.1.2 债券交易

无。

###### 6.4.10.1.3 债券回购交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年4月25日（基金合同生效日）至2023年6月30日	
	成交金额	占当期债券回购 成交总额的比例（%）
招商证券股份有限公司	100,030,000.00	100.00

###### 6.4.10.1.4 权证交易

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4月25日（基金合同生效日）至2023年6月30日			
	当期 佣金	占当期佣金总量 的比例（%）	期末应付佣金余额	占期末应付佣金 总额的比例（%）
招商证券股份有限公司	49,534.86	100.00	-	-

## 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 4 月 25 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的管理费	283,429.53
其中：支付销售机构的客户维护费	110,925.81

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1% 年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。

其计算公式如下：日管理人报酬=前一日基金资产净值×1%/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 4 月 25 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日
当期发生的基金应支付的托管费	42,514.43

注：支付基金托管人招商证券股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值的 0.15% 的年费率计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×0.15%/当年天数。

### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2023 年 4 月 25 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	明亚中证 1000 指数增强 A	明亚中证 1000 指数增强 C	合计
明亚基金管理有限责任公司	-	1,863.48	1,863.48
招商证券股份有限公司	-	7,201.75	7,201.75
合计	-	9,065.23	9,065.23

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费；C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%，按前一日 C 类基金资产净值计提，逐日累计至每月月末，按月支付。其计算公式为：日基金销售服务费=前一日 C 类基金资产净值 × 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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明****6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

无。

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

无。

**6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况****6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

无。

**6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况**

份额单位：份

明亚中证 1000 指数增强 A

关联方名称	本期末 2023 年 6 月 30 日	
	持有的 基金份额	持有的基金份额 占基金总份额的比例 (%)
丁玥	9.99	0.0000
杨飞	99.01	0.0002
屠建宗	9.99	0.0000

注：丁玥、杨飞、屠建宗为公司股东，其投资本基金的费率标准与其他相同条件的投资者使用的费率标准相一致。

**6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入**

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 4 月 25 日（基金合同生效日）至 2023 年 6 月 30 日	
	期末余额	当期利息收入
招商证券股份有限公司	2,953,755.45	109,538.30

**6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况**

本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销证券。

**6.4.10.8 其他关联交易事项的说明**

无。

**6.4.11 利润分配情况**

本基金本报告期末进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2023 年 6 月 30 日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

###### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

本基金本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

###### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

本基金本报告期末无因交易所市场债券正回购交易而抵押的债券。

##### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

#### 6.4.13 金融工具风险及管理

本基金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等。基金成立以来，本基金管理人坚持一切从规范运作、防范风险、保护基金持有人利益出发，依照公司内部控制的整体要求，致力于内控机制的建立和完善，公司内部管理制度及业务规范流程的制定和完善，加强内部风险的控制与有效防范，以保证各项法规和管理制度的落实，保证基金合同得到严格履行。

##### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是股票型基金，其预期风险和收益水平高于债券型基金及货币市场基金。本基金投资的金融工具主要包括股票投资和债券投资等。本基金在日常投资管理中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金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。

##### 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均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对

手进行信用评估并对证券交割方式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。

于本报告期末，本基金未持有债券和资产支持证券。

#### **6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资**

无。

#### **6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

无。

#### **6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

无。

#### **6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

无。

#### **6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

无。

#### **6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

无。

### **6.4.13.3 流动性风险**

流动性风险是指基金管理人未能以合理价格及时变现基金资产以支付投资者赎回款项的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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。

#### **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按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》、《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》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组合的流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金主要投资于上市交易的证券，报告期末本基金所持的证券均能及时变现，资产变现能

力强。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%。本基金持有的其他资产主要为银行存款等期限短、流动性强的品种。本基金的负债水平也严格按照基金合同及中国证监会相关规定进行管理。

本报告期内，未发生重大流动性风险事件。

#### 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、存出保证金、债券投资和买入返售金融资产等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年6月30日	1个月以内	1-3个月	3个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产							
银行存款	5,991,932.11	-	-	-	-	-	5,991,932.11
结算备付金	1,900,058.25	-	-	-	-	-	1,900,058.25
存出保证金	473,385.60	-	-	-	-	-	473,385.60
交易性金融资产	-	-	-	-	-	-43,286,341.90	43,286,341.90
资产总计	8,365,375.96	-	-	-	-	-43,286,341.90	51,651,717.86
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	29,272.68	29,272.68
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	43,564.68	43,564.68
应付托管费	-	-	-	-	-	6,534.70	6,534.70
应付销售服务费	-	-	-	-	-	157.21	157.21
其他负债	-	-	-	-	-	32,721.71	32,721.71
负债总计	-	-	-	-	-	112,250.98	112,250.98
利率敏感度缺口	8,365,375.96	-	-	-	-	-43,174,090.92	51,539,466.88

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

无。

#### 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。本基金未持有不以记账本位币计价的资产，因此不存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

##### 6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

无。

##### 6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

无。

#### 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。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 6 月 30 日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	43,286,341.90	83.99
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	43,286,341.90	83.99

##### 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	
	相关风险变量的变	对资产负债表日基金资产净值的

	动	影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2023 年 6 月 30 日）
分析	业绩比较基准上升 5%	866,393.50
	业绩比较基准下降 5%	-866,393.50

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

#### 6.4.14 公允价值

##### 6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值；

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### 6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

###### 6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 6 月 30 日
第一层次	43,286,341.90
第二层次	-
第三层次	-
合计	43,286,341.90

###### 6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

**6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明**

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。

**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	43,286,341.90	83.80
	其中：股票	43,286,341.90	83.80
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	7,891,990.36	15.28
8	其他各项资产	473,385.60	0.92
9	合计	51,651,717.86	100.00

**7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合****7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合**

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	827,224.00	1.61
C	制造业	25,363,590.60	49.21
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,236,568.00	2.40
E	建筑业	484,712.00	0.94
F	批发和零售业	1,849,085.00	3.59
G	交通运输、仓储和邮政业	619,279.00	1.20

H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,360,922.00	4.58
J	金融业	384,770.00	0.75
K	房地产业	1,101,937.00	2.14
L	租赁和商务服务业	135,720.00	0.26
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	545,735.00	1.06
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	98,080.00	0.19
R	文化、体育和娱乐业	618,874.00	1.20
S	综合	-	-
	合计	35,626,496.60	69.12

### 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	102,505.00	0.20
B	采矿业	225,954.50	0.44
C	制造业	4,473,588.00	8.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	516,552.20	1.00
F	批发和零售业	659,111.00	1.28
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	615,693.00	1.19
J	金融业	464,513.60	0.90
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	118,592.00	0.23
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	483,336.00	0.94
S	综合	-	-
	合计	7,659,845.30	14.86

### 7.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

#### 7.3.1 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	600129	太极集团	6,000	356,940.00	0.69
2	002139	拓邦股份	25,300	330,165.00	0.64
3	000921	海信家电	12,200	328,790.00	0.64
4	300777	中简科技	6,600	311,916.00	0.61
5	600612	老凤祥	4,400	307,472.00	0.60
6	002698	博实股份	17,400	304,326.00	0.59
7	600583	海油工程	51,400	300,690.00	0.58
8	002484	江海股份	14,100	300,189.00	0.58
9	603678	火炬电子	8,700	299,802.00	0.58
10	600557	康缘药业	10,500	288,330.00	0.56
11	300775	三角防务	8,500	287,130.00	0.56
12	000811	冰轮环境	18,100	285,256.00	0.55
13	603368	柳药集团	11,500	284,165.00	0.55
14	601567	三星医疗	22,400	282,912.00	0.55
15	300294	博雅生物	7,700	279,356.00	0.54
16	600211	西藏药业	4,700	279,180.00	0.54
17	301039	中集车辆	21,100	279,153.00	0.54
18	601908	京运通	45,800	277,090.00	0.54
19	300224	正海磁材	21,500	276,490.00	0.54
20	600478	科力远	38,400	274,176.00	0.53
21	002335	科华数据	7,600	273,220.00	0.53
22	601975	招商南油	94,000	268,840.00	0.52
23	300638	广和通	11,800	267,624.00	0.52
24	600320	振华重工	71,500	266,695.00	0.52
25	002446	盛路通信	28,100	265,545.00	0.52
26	601311	骆驼股份	28,600	265,408.00	0.51
27	300674	宇信科技	15,000	265,200.00	0.51
28	002611	东方精工	46,200	265,188.00	0.51
29	002367	康力电梯	28,900	263,857.00	0.51
30	000902	新洋丰	25,600	263,168.00	0.51

31	002283	天润工业	40,800	261,936.00	0.51
32	600458	时代新材	21,800	261,382.00	0.51
33	605123	派克新材	2,400	260,760.00	0.51
34	601619	嘉泽新能	57,300	260,715.00	0.51
35	601519	大智慧	36,400	260,624.00	0.51
36	600210	紫江企业	48,900	260,148.00	0.50
37	002004	华邦健康	52,000	260,000.00	0.50
38	600888	新疆众和	32,800	259,776.00	0.50
39	600929	雪天盐业	32,600	258,844.00	0.50
40	002204	大连重工	50,300	258,542.00	0.50
41	002737	葵花药业	10,600	258,004.00	0.50
42	603187	海容冷链	12,900	257,871.00	0.50
43	600328	中盐化工	28,530	256,770.00	0.50
44	300109	新开源	10,300	256,161.00	0.50
45	002929	润建股份	5,900	256,119.00	0.50
46	002312	川发龙蟒	31,500	256,095.00	0.50
47	002539	云图控股	28,500	255,930.00	0.50
48	002017	东信和平	19,500	255,645.00	0.50
49	002216	三全食品	16,400	255,512.00	0.50
50	600459	贵研铂业	16,700	255,510.00	0.50
51	600420	国药现代	22,600	255,154.00	0.50
52	001696	宗申动力	36,000	254,880.00	0.49
53	002233	塔牌集团	32,900	253,988.00	0.49
54	000685	中山公用	33,300	252,081.00	0.49
55	601028	玉龙股份	23,200	249,400.00	0.48
56	300232	洲明科技	27,200	248,608.00	0.48
57	002635	安洁科技	18,000	248,400.00	0.48
58	300206	理邦仪器	16,400	247,312.00	0.48
59	603328	依顿电子	29,800	246,744.00	0.48
60	688711	宏微科技	4,220	246,194.80	0.48
61	002163	海南发展	24,500	245,000.00	0.48
62	000048	京基智农	12,500	244,000.00	0.47
63	603567	珍宝岛	16,300	243,848.00	0.47
64	601515	东风股份	55,600	243,528.00	0.47
65	002782	可立克	15,900	243,111.00	0.47
66	002215	诺普信	32,200	241,822.00	0.47
67	600742	一汽富维	29,500	241,605.00	0.47
68	301087	可孚医疗	4,900	241,570.00	0.47
69	600502	安徽建工	45,400	239,712.00	0.47
70	002987	京北方	10,900	238,928.00	0.46
71	600073	上海梅林	32,400	236,520.00	0.46
72	600510	黑牡丹	38,900	236,123.00	0.46
73	603989	艾华集团	11,200	235,872.00	0.46

74	603103	横店影视	14,000	235,760.00	0.46
75	603071	物产环能	14,200	235,578.00	0.46
76	603439	贵州三力	13,700	233,722.00	0.45
77	688425	铁建重工	47,500	228,475.00	0.44
78	002990	盛视科技	6,200	228,160.00	0.44
79	300131	英唐智控	42,300	222,075.00	0.43
80	301089	拓新药业	3,400	210,596.00	0.41
81	300185	通裕重工	74,700	208,413.00	0.40
82	688556	高测股份	3,400	180,676.00	0.35
83	000951	中国重汽	10,100	170,185.00	0.33
84	600761	安徽合力	8,500	169,405.00	0.33
85	601677	明泰铝业	12,200	169,336.00	0.33
86	603298	杭叉集团	7,000	164,850.00	0.32
87	601222	林洋能源	19,800	162,162.00	0.31
88	603588	高能环境	17,100	160,227.00	0.31
89	002011	盾安环境	11,500	159,045.00	0.31
90	600572	康恩贝	23,200	158,920.00	0.31
91	600312	平高电气	12,800	158,592.00	0.31
92	600641	万业企业	8,300	158,447.00	0.31
93	601137	博威合金	10,100	157,156.00	0.30
94	300726	宏达电子	3,500	156,520.00	0.30
95	300083	创世纪	21,300	155,703.00	0.30
96	603979	金诚信	5,000	155,500.00	0.30
97	002851	麦格米特	4,100	149,527.00	0.29
98	002038	双鹭药业	14,800	149,332.00	0.29
99	600323	瀚蓝环境	7,800	147,654.00	0.29
100	688568	中科星图	1,800	145,044.00	0.28
101	002123	梦网科技	10,700	142,203.00	0.28
102	002324	普利特	9,900	141,273.00	0.27
103	600483	福能股份	12,200	140,910.00	0.27
104	600977	中国电影	10,000	140,500.00	0.27
105	300332	天壕环境	12,200	139,934.00	0.27
106	002108	沧州明珠	30,700	139,071.00	0.27
107	605090	九丰能源	6,200	138,446.00	0.27
108	002697	红旗连锁	23,700	138,408.00	0.27
109	603599	广信股份	5,100	138,108.00	0.27
110	603027	千禾味业	6,500	137,280.00	0.27
111	002649	博彦科技	9,700	137,061.00	0.27
112	603299	苏盐井神	13,700	136,726.00	0.27
113	600285	羚锐制药	8,500	136,510.00	0.26
114	600057	厦门象屿	15,600	135,720.00	0.26
115	002258	利尔化学	10,500	135,555.00	0.26
116	002612	朗姿股份	5,700	135,546.00	0.26

117	000028	国药一致	3,100	135,191.00	0.26
118	002402	和而泰	7,900	134,142.00	0.26
119	002895	川恒股份	6,800	133,960.00	0.26
120	600710	苏美达	15,400	131,824.00	0.26
121	002489	浙江永强	32,300	130,815.00	0.25
122	600100	同方股份	16,100	130,732.00	0.25
123	300602	飞荣达	8,400	130,116.00	0.25
124	300319	麦捷科技	15,200	130,112.00	0.25
125	002815	崇达技术	10,400	129,480.00	0.25
126	300348	长亮科技	12,400	129,456.00	0.25
127	688389	普门科技	5,500	129,195.00	0.25
128	603877	太平鸟	5,100	128,928.00	0.25
129	000560	我爱我家	48,600	128,790.00	0.25
130	688100	威胜信息	4,300	128,183.00	0.25
131	603601	再升科技	29,600	126,392.00	0.25
132	002421	达实智能	35,900	126,368.00	0.25
133	300226	上海钢联	3,900	126,360.00	0.25
134	688366	昊海生科	1,500	126,330.00	0.25
135	600007	中国国贸	6,800	125,936.00	0.24
136	688239	航宇科技	1,800	125,910.00	0.24
137	601019	山东出版	13,700	125,629.00	0.24
138	300672	国科微	1,500	125,025.00	0.24
139	002034	旺能环境	7,900	124,899.00	0.24
140	600562	国睿科技	7,700	124,740.00	0.24
141	603093	南华期货	11,400	124,146.00	0.24
142	000829	天音控股	13,700	123,848.00	0.24
143	301050	雷电微力	1,900	123,367.00	0.24
144	688128	中国电研	4,800	122,400.00	0.24
145	600508	上海能源	8,300	121,844.00	0.24
146	002746	仙坛股份	15,400	121,352.00	0.24
147	603871	嘉友国际	7,700	120,967.00	0.23
148	300773	拉卡拉	6,900	120,336.00	0.23
149	000969	安泰科技	12,700	120,269.00	0.23
150	601609	金田股份	18,500	120,065.00	0.23
151	002053	云南能投	10,700	120,054.00	0.23
152	605388	均瑶健康	9,300	118,203.00	0.23
153	600639	浦东金桥	9,500	117,895.00	0.23
154	002274	华昌化工	15,700	117,593.00	0.23
155	002267	陕天然气	14,800	117,216.00	0.23
156	600635	大众公用	35,300	117,196.00	0.23
157	000885	城发环境	8,800	117,128.00	0.23
158	300133	华策影视	16,500	116,985.00	0.23
159	000517	荣安地产	38,300	116,815.00	0.23

160	000552	靖远煤电	35,000	116,550.00	0.23
161	600480	凌云股份	14,800	116,328.00	0.23
162	688578	艾力斯	4,300	115,885.00	0.22
163	000758	中色股份	24,500	115,640.00	0.22
164	600308	华泰股份	30,900	114,948.00	0.22
165	000550	江铃汽车	8,300	114,872.00	0.22
166	000848	承德露露	12,900	114,165.00	0.22
167	600531	豫光金铅	18,100	114,030.00	0.22
168	000030	富奥股份	22,600	113,904.00	0.22
169	603609	禾丰股份	12,500	113,750.00	0.22
170	002768	国恩股份	4,700	113,693.00	0.22
171	600811	东方集团	50,700	113,568.00	0.22
172	300634	彩讯股份	4,300	113,520.00	0.22
173	603229	奥翔药业	5,400	113,292.00	0.22
174	002573	清新环境	20,500	112,955.00	0.22
175	000652	泰达股份	27,400	112,888.00	0.22
176	002537	海联金汇	16,700	112,391.00	0.22
177	600125	铁龙物流	18,600	112,344.00	0.22
178	600340	华夏幸福	50,700	112,047.00	0.22
179	002556	辉隆股份	15,400	111,804.00	0.22
180	002237	恒邦股份	10,100	109,989.00	0.21
181	688318	财富趋势	1,100	109,967.00	0.21
182	688190	云路股份	1,500	109,500.00	0.21
183	002063	远光软件	12,500	108,500.00	0.21
184	603301	振德医疗	3,600	106,632.00	0.21
185	000036	华联控股	25,700	105,884.00	0.21
186	000851	高鸿股份	19,100	103,904.00	0.20
187	301239	普瑞眼科	1,000	98,080.00	0.19
188	002318	久立特材	5,500	93,665.00	0.18
189	301367	怡和嘉业	600	89,004.00	0.17
190	600789	鲁抗医药	12,400	79,608.00	0.15
191	688033	天宜上佳	4,100	78,392.00	0.15
192	000875	吉电股份	13,000	70,070.00	0.14
193	601929	吉视传媒	31,600	58,144.00	0.11
194	000917	电广传媒	7,600	55,556.00	0.11
195	000737	北方铜业	10,100	54,439.00	0.11
196	300457	赢合科技	2,800	49,448.00	0.10
197	003006	百亚股份	1,800	31,104.00	0.06
198	601918	新集能源	4,000	17,000.00	0.03
199	300502	新易盛	140	9,515.80	0.02

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

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	600481	双良节能	21,300	297,774.00	0.58
2	605599	莱百股份	18,200	240,422.00	0.47
3	002478	常宝股份	30,800	229,460.00	0.45
4	002600	领益智造	32,900	227,339.00	0.44
5	688599	天合光能	5,200	221,572.00	0.43
6	603878	武进不锈	26,200	221,390.00	0.43
7	601717	郑煤机	17,600	219,120.00	0.43
8	000822	山东海化	32,000	217,920.00	0.42
9	600919	江苏银行	29,000	213,150.00	0.41
10	002422	科伦药业	7,000	207,760.00	0.40
11	600050	中国联通	42,700	204,960.00	0.40
12	603508	思维列控	11,600	197,780.00	0.38
13	002518	科士达	3,800	152,038.00	0.29
14	002129	TCL 中环	4,000	132,800.00	0.26
15	002371	北方华创	400	127,060.00	0.25
16	600546	山煤国际	8,700	125,889.00	0.24
17	002179	中航光电	2,700	122,445.00	0.24
18	603757	大元泵业	4,100	122,344.00	0.24
19	600362	江西铜业	6,300	119,574.00	0.23
20	002033	丽江股份	10,900	118,592.00	0.23
21	600251	冠农股份	12,900	116,487.00	0.23
22	300389	艾比森	5,700	116,109.00	0.23
23	002373	千方科技	8,500	115,940.00	0.22
24	601168	西部矿业	11,000	115,610.00	0.22
25	601838	成都银行	9,300	113,553.00	0.22
26	601618	中国中冶	28,400	112,748.00	0.22
27	600348	华阳股份	13,950	110,344.50	0.21
28	000719	中原传媒	9,300	108,810.00	0.21
29	600271	航天信息	7,900	108,151.00	0.21
30	600039	四川路桥	10,920	107,125.20	0.21
31	603230	内蒙新华	8,300	107,070.00	0.21
32	603283	赛腾股份	2,400	106,800.00	0.21
33	601728	中国电信	18,700	105,281.00	0.20
34	002885	京泉华	4,800	104,832.00	0.20
35	300861	美畅股份	2,400	104,088.00	0.20
36	603367	辰欣药业	6,800	103,224.00	0.20
37	600582	天地科技	17,700	103,191.00	0.20
38	002458	益生股份	8,300	102,505.00	0.20
39	300314	戴维医疗	4,800	101,472.00	0.20
40	002739	万达电影	8,000	100,320.00	0.19
41	600089	特变电工	4,500	100,305.00	0.19
42	601117	中国化学	12,000	99,360.00	0.19
43	600820	隧道股份	16,500	99,165.00	0.19

44	000906	浙商中拓	11,100	99,012.00	0.19
45	601669	中国电建	17,100	98,154.00	0.19
46	600704	物产中大	19,800	97,812.00	0.19
47	000012	南玻 A	16,300	97,148.00	0.19
48	002912	中新赛克	2,200	96,822.00	0.19
49	300434	金石亚药	7,100	96,134.00	0.19
50	600755	厦门国贸	12,400	95,976.00	0.19
51	601336	新华保险	2,600	95,602.00	0.19
52	002131	利欧股份	40,300	92,690.00	0.18
53	002852	道道全	7,100	91,803.00	0.18
54	688186	广大特材	2,800	91,084.00	0.18
55	600373	中文传媒	6,300	83,916.00	0.16
56	601928	凤凰传媒	7,300	83,220.00	0.16
57	688002	睿创微纳	1,600	71,680.00	0.14
58	300146	汤臣倍健	2,400	57,552.00	0.11
59	600901	江苏租赁	10,220	42,208.60	0.08
60	688390	固德威	200	33,372.00	0.06
61	000933	神火股份	2,100	27,300.00	0.05
62	605077	华康股份	1,000	26,480.00	0.05

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	600129	太极集团	376,014.22	0.73
2	600583	海油工程	310,700.00	0.60
3	300777	中简科技	309,023.00	0.60
4	000921	海信家电	302,236.00	0.59
5	002335	科华数据	292,675.74	0.57
6	601975	招商南油	287,977.00	0.56
7	002139	拓邦股份	287,925.00	0.56
8	002484	江海股份	286,939.00	0.56
9	300294	博雅生物	284,733.00	0.55
10	300775	三角防务	282,424.00	0.55
11	601567	三星医疗	281,866.00	0.55
12	600557	康缘药业	281,355.00	0.55
13	603678	火炬电子	280,987.00	0.55
14	300674	宇信科技	280,386.00	0.54
15	002698	博实股份	279,355.00	0.54
16	300638	广和通	279,204.70	0.54
17	601519	大智慧	278,756.00	0.54
18	600612	老凤祥	277,831.00	0.54
19	002312	川发龙蟒	276,490.00	0.54

20	600478	科力远	275,020.00	0.53
----	--------	-----	------------	------

注：本项“买入金额”按买入成交金额填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

本基金本报告期末未卖出股票。

#### 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	43,186,803.23
卖出股票收入（成交）总额	-

注：本项“买入股票成本”和“卖出股票收入”均按买卖成交金额填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金投资股指期货，以套期保值为目的，选择流动性好、交易活跃的标的指数对应的股指期货合约。本报告期进行了少量的多头套保。

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

##### 7.11.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期内未持有国债期货。

##### 7.11.2 本期国债期货投资评价

#### 7.12 投资组合报告附注

##### 7.12.1

本报告期内，本基金投资前十名证券的发行主体没有被中国证监会及其派出机构、证券交易

所立案调查，或在报告编制日前一年受到公开谴责、处罚的情况。

## 7.12.2

本基金投资的前十名股票没有超出基金合同规定的备选股票库。

## 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	473,385.60
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	473,385.60

## 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

## 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况。

## 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于计算结果四舍五入，分项之和与合计可能存在尾差。

## § 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	户均持有的基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	(户)		持有份额	占总份 额比例 (%)	持有份额	占总 份额 比例 (%)
明亚中证 1000 指数 增强 A	118	430,874.09	50,006,900.99	98.36	836,241.63	1.64
明亚中证 1000 指数 增强 C	97	4,518.08	0.00	0	438,253.55	100
合计	215	238,518.12	50,006,900.99	97.51	1,274,495.18	2.49

注：机构投资者/个人投资者持有份额占总份额比例计算中，对下属分级基金，比例的分母采用各自级别的份额，对合计数，比例的分母采用下属分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额），  
 户均持有的基金份额的合计数=期末基金份额总额/期末持有人户数合计。

## 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	明亚中证 1000 指数增强 A	38,120.89	0.0750
	明亚中证 1000 指数增强 C	2,080.10	0.4746
	合计	40,200.99	0.0784

注：（1）前述“明亚中证 1000 指数增强 A”项下，占基金总份额比例，系基金管理人所有从业人员持有明亚中证 1000 指数增强 A 的份额占明亚中证 1000 指数增强 A 总份额比例；

（2）前述“明亚中证 1000 指数增强 C”项下，占基金总份额比例，系基金管理人所有从业人员持有明亚中证 1000 指数增强 C 的份额占明亚中证 1000 指数增强 C 总份额比例；

（3）前述“合计”项下，占基金总份额比例=（基金管理人所有从业人员持有明亚中证 1000 指数增强 A 的总份额数+基金管理人所有从业人员持有明亚中证 1000 指数增强 C 的总份额数）/（明亚中证 1000 指数增强 A 总份额数+明亚中证 1000 指数增强 C 总份额数）。

## 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	明亚中证 1000 指数增强 A	0~10
	明亚中证 1000 指数增强 C	0
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	明亚中证 1000 指数增强 A	0~10
	明亚中证 1000 指数增强 C	0

	合计	0~10
--	----	------

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

项目	明亚中证 1000 指数增强 A	明亚中证 1000 指数增强 C
基金合同生效日 (2023 年 4 月 25 日) 基金份额总额	243,697,121.18	27,196,182.66
基金合同生效日起至 报告期期末基金总申 购份额	883.67	3,467.50
减：基金合同生效日 起至报告期期末基金 总赎回份额	192,854,862.23	26,761,396.61
基金合同生效日起至 报告期期末基金拆分 变动份额	-	-
本报告期末基金份 额总额	50,843,142.62	438,253.55

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未进行基金份额持有人大会决议。

### 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

自 2023 年 6 月 19 日起，增聘孔令伟先生为明亚中证 1000 指数增强型证券投资基金的基金经理。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

报告期内未发生涉及基金管理人、基金财产、公募基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

报告期内基金投资策略未发生改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期本基金聘请的会计师事务所未发生变更。

## 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期未发生公司和董事、监事及高级管理人员被中国证监会、基金业协会、证券交易所处罚或公开谴责，以及被财政、外汇和审计等部门施以重大处罚的情况。

### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期未发生公司和董事、监事及高级管理人员被中国证监会、基金业协会、证券交易所处罚或公开谴责，以及被财政、外汇和审计等部门施以重大处罚的情况。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例 (%)	佣金	占当期佣金总量的比例 (%)	
招商证券股份有限公司	2	43,186,803.23	100.00	49,534.86	100.00	-

注：1. 本基金采用券商交易结算模式，可豁免单个券商的交易佣金比例限制。

2. 本基金管理人负责选择证券经纪商，使用其交易单元作为本基金的交易单元。基金证券经纪商的选择标准主要包括公司的财务状况、经营状况、研究实力、信息服务的全面性和及时性。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例 (%)	成交金额	占当期权证成交总额的比例 (%)
招商证券股份有限公司	-	-	100,030,000.00	100.00	-	-

## 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	明亚基金管理有限责任公司关于旗下	公司官网	2023年6月1日

	部分基金增加代销机构的公告		
2	明亚中证 1000 指数增强型证券投资基金基金经理变更公告	证监会规定网站、规定报刊、公司官网	2023 年 6 月 20 日
-	明亚基金管理有限责任公司关于旗下部分基金增加代销机构的公告	公司官网	2023 年 6 月 26 日
-	-	-	-

## § 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比 (%)
机构	1	20230425-20230630	49,997,000.00	0.00	0.00	49,997,000.00	97.50
产品特有风险							

注：1、大额赎回风险本基金如果出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过基金份额总份额的 20%，则面临大额赎回的情况，可能导致：（1）基金在短时间内无法变现足够的资产予以应对，可能会产生基金仓位调整困难，导致流动性风险；如果持有基金份额比例达到或超过基金份额总额的 20%的单一投资者大额赎回引发巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定决定部分延期赎回，如果连续 2 个开放日以上（含本数）发生巨额赎回，基金管理人可能根据《基金合同》的约定暂停接受基金的赎回申请，对剩余投资者的赎回办理造成影响；（2）基金管理人被迫抛售证券以应付基金赎回的现金需要，则可能是基金资产净值收到不利影响，影响基金的投资运作和收益水平；（3）因基金净值精度计算问题，或因赎回费收入归基金资产，导致基金净值出现较大波动；（4）基金资产规模过小，可能导致部分投资受限而不能实现基金合同约定的投资目的及投资策略；（5）大额赎回导致基金资产规模过小，不能满足存续的条件，基金将根据基金合同的约定面临合同终止清算、转型等风险。2、大额申购风险若投资者大额申购，基金所投资的标的资产未及时准备，导致净值涨幅可能会因此降低。

### 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

无
---

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予明亚中证 1000 指数增强型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《明亚中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《明亚中证 1000 指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照。
- 5、报告期内明亚中证 1000 指数增强型证券投资基金在规定报刊上披露的各项公告。

## 12.2 存放地点

深圳市前海深港合作区南山街道前海大道前海嘉里商务中心四期 T1 写字楼 1804、1803B

## 12.3 查阅方式

投资者可在营业时间内至基金管理人办公场所或登陆基金管理人网站：[www.mingyafunds.com](http://www.mingyafunds.com) 免费查阅，也可按工本费购买复印件。

投资者对本报告如有疑问，可致电基金管理人全国统一客户服务电话：4008-785-795。

明亚基金管理有限责任公司

2023 年 8 月 30 日