

# 明亚中证 1000 指数增强型证券投资基金 2024 年中期报告

2024 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：2024 年 8 月 28 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 2024 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 2024 年 1 月 1 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>7</b>
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
<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	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人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	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	13
<b>§ 5 托管人报告</b>	<b>13</b>
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内容的真实、准确和完整发表意见	13
<b>§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）</b>	<b>13</b>
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	16
6.4 报表附注	18
<b>§ 7 投资组合报告</b>	<b>39</b>
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
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	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	49
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	49

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 .....	49
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 .....	49
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 .....	49
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 .....	49
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 .....	49
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 .....	51
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 .....	51
<b>§ 9 开放式基金份额变动 .....</b>	<b>52</b>
<b>§ 10 重大事件揭示 .....</b>	<b>52</b>
10.1 基金份额持有人大会决议 .....	52
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 .....	52
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	52
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 .....	53
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 .....	56
<b>§ 12 备查文件目录 .....</b>	<b>56</b>
12.1 备查文件目录 .....	56
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	47,343,989.08 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	47,170,849.91 份	173,139.17 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 $\times$ 95%+银行活期存款利率(税后) $\times$ 5%。
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金,预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金主要投资于标的指数成份股及备选成份股,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	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 姓名	吴建炜	

负责人			韩鑫普
	联系电话	0755-23626585	0755-82943666
	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	0755-82960794
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	深圳市福田区福田街道福华一路 111 号
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 据和指标	报告期(2024年1月1日-2024年6月30日)	
	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	-2,605,734.98	-35,487.66
本期利润	-4,784,461.29	-145,480.97
加权平均基金份 额本期利润	-0.0839	-0.5111
本期加权平均净 值利润率	-9.69%	-59.84%
本期基金份额净 值增长率	-9.70%	-9.89%
3.1.2 期末数 据和指标	报告期末(2024年6月30日)	
期末可供分配利 润	-8,591,285.36	-32,087.26
期末可供分配基 金份额利润	-0.1821	-0.1853
期末基金资产净 值	38,579,564.55	141,051.91
期末基金份额净 值	0.8179	0.8147
3.1.3 累计期 末指标	报告期末(2024年6月30日)	
基金份额累计净 值增长率	-18.21%	-18.53%

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

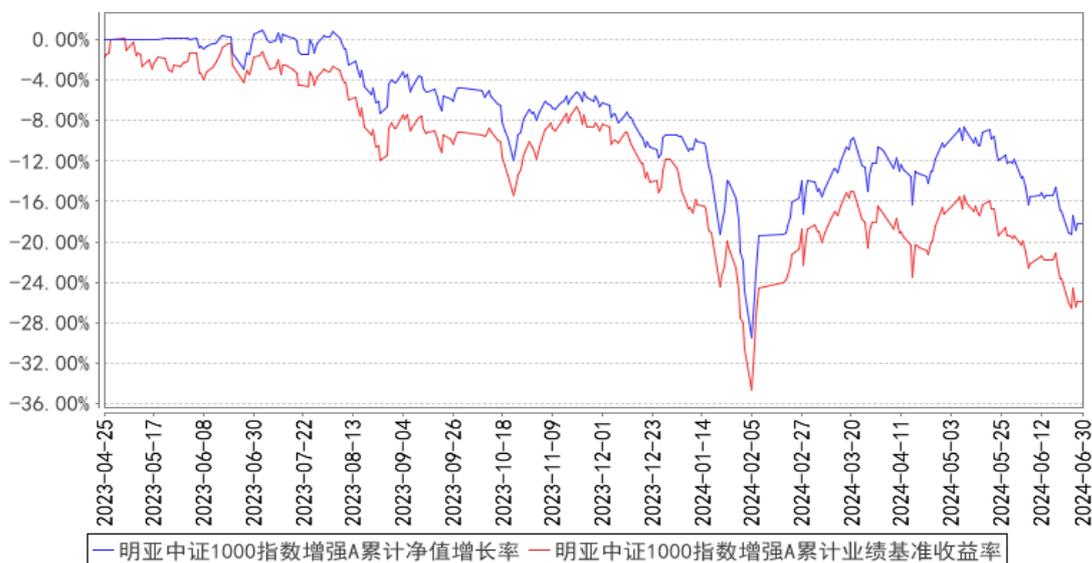
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-7.28%	1.27%	-8.15%	1.36%	0.87%	-0.09%
过去三个月	-6.81%	1.29%	-9.51%	1.42%	2.70%	-0.13%
过去六个月	-9.70%	1.75%	-15.97%	1.87%	6.27%	-0.12%
过去一年	-18.62%	1.35%	-24.61%	1.47%	5.99%	-0.12%
自基金合同生效起至今	-18.21%	1.25%	-25.91%	1.39%	7.70%	-0.14%

明亚中证 1000 指数增强 C

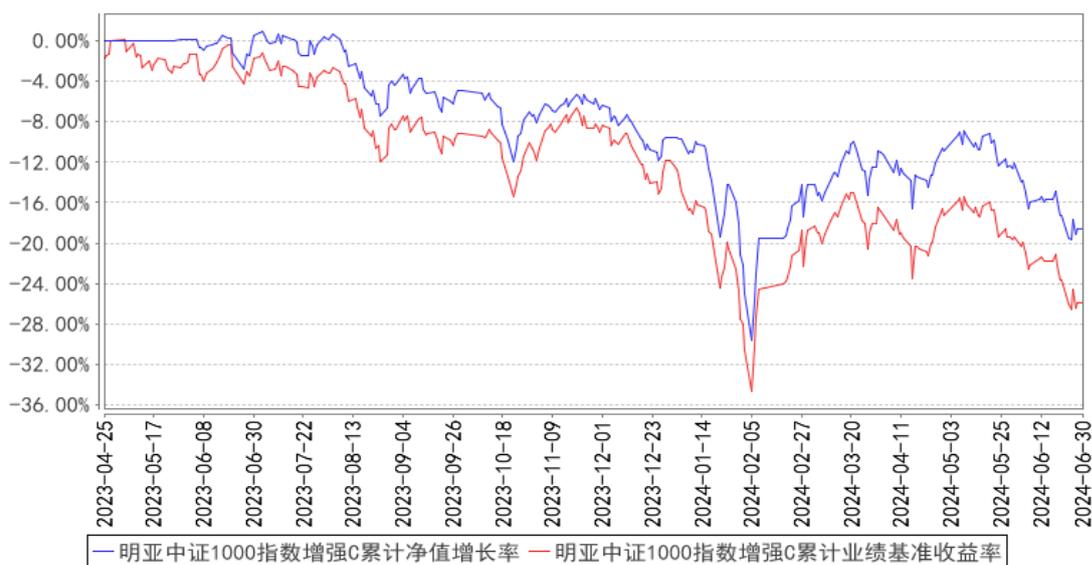
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-7.30%	1.27%	-8.15%	1.36%	0.85%	-0.09%
过去三个月	-6.90%	1.29%	-9.51%	1.42%	2.61%	-0.13%
过去六个月	-9.89%	1.75%	-15.97%	1.87%	6.08%	-0.12%
过去一年	-18.94%	1.35%	-24.61%	1.47%	5.67%	-0.12%
自基金合同生效起至今	-18.53%	1.25%	-25.91%	1.39%	7.38%	-0.14%

### 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



## § 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	基金经理、研究部总监	2023 年 4 月 25 日	-	23 年	武汉大学国际金融硕士、英国巴斯大学 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，现任研究部总监、权益投资部基金经理。
毛瑞翔	基金经理	2024 年 1 月 15 日	-	6 年	英国曼彻斯特大学商业研究专业本科，纽卡斯尔大学可再生能源管理专业硕士。曾任职于上海开思股权投资基金管理有限公司、上海鲲洋投资管理有限公司；2023 年 2 月加入明亚基金，现任权益投资部基金经理。

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遵规守信情况的说明

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

上半年 A 股震荡反复，年初延续 2023 年的跌势，指数于 2 月初触及低点后反弹，市场风险偏好有所改善，各主要宽基指数均有阶段性表现。5 月中，市场达到上半年高点后再度走弱，经济增速放缓、美联储降息预期落空等因素导致市场转为下跌，经过近 1 个月的调整后，6 月末，指数初步企稳。在风格上，上半年呈现较明显的分化，大盘、价值占优，成长及中小市值相对弱势，在这样的背景下，流通市值偏小的中证 1000 指数整体承压，指数层面跌幅较大。

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的前提下，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

截止本报告期末，明亚中证 1000 指数增强 A 的基金份额净值为 0.8179，本报告期基金份额净值增长率为-9.70%；明亚中证 1000 指数增强 C 的基金份额净值为 0.8147，本报告期基金份额净值增长率为-9.89%。同期业绩比较基准收益率为-15.97%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我们对下半年谨慎乐观。经济增长存在压力已基本成为市场共识，但各项稳增长措施的累积效应将在下半年有所体现，对经济偏弱不应简单地线性外推；另一方面，若美联储降息窗口打开，也将缓解人民币资产的外部压力，形成较好的内外共振，提振投资者信心，带来 A 股的估值修复。

从中期维度上，经济转型的长期目标不变，与经济总量相关的顺周期资产有望在寻底后企稳，但弹性相对有限，结构性行情可能依旧延续。在红利方向上，“新国九条”发布后，上市公司更加关注股东回报，红利资产池有望扩大，关注现金流持续改善、分红比例有望提升、资本开支增速下降的潜在高股息方向；在产业趋势推动方向上，投资逻辑可能逐步由事件驱动转为关注商业化、产业化能取得重大突破并逐步兑现业绩的领域；在政策驱动上，关注以旧换新、设备更新、产业升级以及科技创新等领域的政策红利。

在操作策略上，考虑到指数的调整幅度，中证 1000 指数的配置价值有所提升，本基金将在继续紧跟中证 1000 指数的背景下，通过不断提高因子质量、优化选股模型，力争为投资者创造稳定的超额收益。

#### 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，本基金管理人按照《企业会计准则》、中国证券监督管理委员会相关规定、中国证券投资基金基金业协会相关指引和基金合同的约定，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

本报告期内，本基金存在连续二十个工作日基金资产净值持续低于 5000 万元的情形，不存在连续六十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

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：2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
<b>资产:</b>			
货币资金	6.4.7.1	4,443,626.96	5,083,198.81
结算备付金		686,168.78	467,845.75
存出保证金		231,316.80	140,318.40
交易性金融资产	6.4.7.2	33,446,171.61	44,612,942.00
其中: 股票投资		33,446,171.61	44,612,942.00
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		125.00	139,997,025.00
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		38,807,409.15	190,301,329.96
<b>负债和净资产</b>			
	<b>附注号</b>	<b>本期末 2024 年 6 月 30 日</b>	<b>上年度末 2023 年 12 月 31 日</b>
<b>负债:</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		4,659.66	-
应付管理人报酬		32,755.76	50,332.78
应付托管费		4,913.36	7,549.92
应付销售服务费		48.99	96.84
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	44,414.92	97,000.00
负债合计		86,792.69	154,979.54
<b>净资产:</b>			
实收基金	6.4.7.10	47,343,989.08	209,911,747.14
未分配利润	6.4.7.12	-8,623,372.62	-19,765,396.72
净资产合计		38,720,616.46	190,146,350.42

负债和净资产总计		38,807,409.15	190,301,329.96
----------	--	---------------	----------------

注：报告截止日 2024 年 6 月 30 日，基金份额总额 47,343,989.08 份，其中明亚中证 1000 指数增强 A 基金份额净值 0.8179 元，份额总额 47,170,849.91 份；明亚中证 1000 指数增强 C 基金份额净值 0.8147 元，份额总额 173,139.17 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：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 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>		-4,617,629.23	750,340.78
1. 利息收入		35,873.55	547,022.97
其中：存款利息收入	6.4.7.13	35,873.55	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
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		-2,999,473.84	127,965.47
其中：股票投资收益	6.4.7.14	-3,411,844.27	-51,938.06
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.15	9,858.31	-
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	-61,336.95	-99.52
股利收益	6.4.7.19	463,849.07	180,003.05
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	-2,288,719.62	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	634,690.68	3,533.67
<b>减：二、营业总支出</b>		312,313.03	363,447.40
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	242,185.73	283,429.53

其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	36,327.83	42,514.43
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	482.55	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	33,316.92	28,428.11
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-4,929,942.26	386,893.38
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-4,929,942.26	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>		-4,929,942.26	386,893.38

### 6.3 净资产变动表

会计主体：明亚中证 1000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 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	209,911,747.14	-	-19,765,396.72	190,146,350.42
二、本期期初净资产	209,911,747.14	-	-19,765,396.72	190,146,350.42
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-162,567,758.06	-	11,142,024.10	-151,425,733.96
（一）、综合收益总额	-	-	-4,929,942.26	-4,929,942.26
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-162,567,758.06	-	16,071,966.36	-146,495,791.70
其中：1. 基金申购款	6,972,463.29	-	-862,818.01	6,109,645.28
2. 基金赎回款	-169,540,221.3	-	16,934,784.37	-152,605,436.98

	5			
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	47,343,989.08	-	-8,623,372.62	38,720,616.46
项目	上年度可比期间			
	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	-	-	-	-
二、本期期初净资产	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净资产变动数(净资产减少以“-”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净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-	-
四、本期期末净资产	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

屠建宗

李晓妹

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

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>》、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 2024 年 06 月 30 日的财务状况以及 2024 年 01 月 01 日至 2024 年 06 月 30 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

#### 6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致。

#### 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。根据财政部、国家税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自 2023

年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024 年 6 月 30 日
活期存款	424,481.78
等于：本金	424,265.62
加：应计利息	216.16
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	4,019,145.18
等于：本金	4,018,902.11
加：应计利息	243.07
减：坏账准备	-
合计	4,443,626.96

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 2024 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	36,511,585.75	-	33,446,171.61	-3,065,414.14
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	36,511,585.75	-	33,446,171.61	-3,065,414.14

### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

#### 6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024年6月30日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	2,017,960.00	-	-	-
其中：股指期货投资	2,017,960.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	2,017,960.00	-	-	-

#### 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
IM2407	中证1000股指期货 2407	1.00	971,600.00	-44,320.00
IM2409	中证1000股指期货 2409	1.00	956,040.00	-46,000.00
合计				-90,320.00
减：可抵销期货暂收款				-90,320.00
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

本基金本报告期末无各项买入返售金融资产。

## 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

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

本基金本报告期末未持有其他权益工具。

## 6.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

本基金本报告期末未持有其他权益工具。

## 6.4.7.8 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

## 6.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024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	11,098.00
预提审计费	8,453.90

预提信息披露费	24,863.02
合计	44,414.92

#### 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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	209,600,549.90	209,600,549.90
本期申购	5,744,440.66	5,744,440.66
本期赎回（以“-”号填列）	-168,174,140.65	-168,174,140.65
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	47,170,849.91	47,170,849.91

##### 明亚中证 1000 指数增强 C

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	311,197.24	311,197.24
本期申购	1,228,022.63	1,228,022.63
本期赎回（以“-”号填列）	-1,366,080.70	-1,366,080.70
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	173,139.17	173,139.17

#### 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
上年度末	-15,314,587.67	-4,420,959.09	-19,735,546.76
本期期初	-15,314,587.67	-4,420,959.09	-19,735,546.76
本期利润	-2,605,734.98	-2,178,726.31	-4,784,461.29
本期基金份额交易产生的变动数	12,080,507.96	3,848,214.73	15,928,722.69
其中：基金申购款	-718,582.71	7,154.95	-711,427.76
基金赎回款	12,799,090.67	3,841,059.78	16,640,150.45
本期已分配利润	-	-	-

本期末	-5,839,814.69	-2,751,470.67	-8,591,285.36
-----	---------------	---------------	---------------

## 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
上年度末	-23,287.84	-6,562.12	-29,849.96
本期期初	-23,287.84	-6,562.12	-29,849.96
本期利润	-35,487.66	-109,993.31	-145,480.97
本期基金份额交易产生的变动数	36,761.37	106,482.30	143,243.67
其中：基金申购款	-109,927.50	-41,462.75	-151,390.25
基金赎回款	146,688.87	147,945.05	294,633.92
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-22,014.13	-10,073.13	-32,087.26

## 6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年1月1日至2024年6月30日
活期存款利息收入	28,066.90
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	3,638.75
结算备付金利息收入	4,167.90
其他	-
合计	35,873.55

## 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
	2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-3,411,844.27
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	-3,411,844.27

## 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
	2024年1月1日至2024年6月30日
卖出股票成交总额	134,989,024.84
减：卖出股票成本总额	138,199,962.12
减：交易费用	200,906.99
买卖股票差价收入	-3,411,844.27

**6.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入**

本基金本报告期内无股票投资收益——证券出借差价收入。

**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**

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
债券投资收益——利息收入	4,484.39
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	5,373.92
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	9,858.31

**6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	2,826,600.37
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,793,944.00
减：应计利息总额	27,141.37
减：交易费用	141.08
买卖债券差价收入	5,373.92

**6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入**

本基金本报告期内无债券投资收益——赎回差价收入。

**6.4.7.15.4 债券投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期内无债券投资收益——申购差价收入。

**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**

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益。

**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**

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入。

**6.4.7.16.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入**

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益——赎回差价收入。

**6.4.7.16.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期内无资产支持证券投资收益——申购差价收入。

**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**

本基金本报告期内无贵金属投资收益。

**6.4.7.17.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入**

本基金本报告期内无贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入。

**6.4.7.17.3 贵金属投资收益——赎回差价收入**

本基金本报告期内无贵金属投资收益——赎回差价收入。

**6.4.7.17.4 贵金属投资收益——申购差价收入**

本基金本报告期内无贵金属投资收益——申购差价收入。

**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**

本基金本报告期内无衍生工具收益——买卖权证差价收入。

**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 2024年1月1日至2024年6月30日
股指期货投资收益	-61,336.95

**6.4.7.19 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
股票投资产生的股利收益	463,849.07
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	463,849.07

**6.4.7.20 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日
1. 交易性金融资产	-2,238,259.62
股票投资	-2,238,259.62
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	-50,460.00
权证投资	-
期货投资	-50,460.00
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	-2,288,719.62

#### 6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	634,690.68
合计	634,690.68

#### 6.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期内无信用减值损失。

#### 6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日
审计费用	8,453.90
信息披露费	24,863.02
证券出借违约金	-
合计	33,316.92

#### 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

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

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 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 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（%）	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	264,260,476.19	100.00	43,186,803.23	100.00

## 6.4.10.1.2 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024年6月30日		上年度可比期间 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 成交总额的比 例（%）	成交金额	占当期债券 成交总额的比 例（%）
招商证券股份 有限公司	5,593,403.00	100.00	-	-

## 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 2024年1月1日至2024年6月30日	上年度可比期间 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 (%)	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

本基金报告期内没有通过关联方交易单元进行的权证交易。

#### 6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年1月1日至2024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	116,606.03	100.00	-	-
关联方名称	上年度可比期间 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 2024年1月1日至2024年6 月30日	上年度可比期间 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	242,185.73	283,429.53
其中：应支付销售机构的客户维护 费	36,838.10	110,925.81
应支付基金管理人的净管理费	205,347.63	172,503.72

注：本基金的管理费按前一日基金资产净值的 1.00% 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×1.00%/当年天数。

## 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日	上年度可比期间 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	36,327.83	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 2024 年 1 月 1 日至 2024 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
招商证券股份有限公司	-	345.31	345.31
合计	-	345.31	345.31
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 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

本基金报告期内未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

##### 6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期内无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。

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

本基金本报告期内无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。

#### 6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期内基金管理人未运用固有资金投资本基金。

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

份额单位：份

明亚中证 1000 指数增强 A

关联方名称	本期末 2024 年 6 月 30 日		上年度末 2023 年 12 月 31 日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例 (%)	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	-	-
屠建宗	9.99	0.0000	-	-
杨飞	99.01	0.0002	-	-
蒋如光	9.90	0.0000	-	-

注：丁玥、屠建宗、杨飞、蒋如光为公司股东，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 2024 年 1 月 1 日至 2024 年 6 月 30 日		上年度可比期间 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	期末余额	当期利息收入
招商证券股份有限公司	424,481.78	28,066.90	2,953,755.45	109,538.30

注：本基金的银行存款由基金托管人招商证券股份有限公司保管，按银行约定存款利率计息。

#### 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

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期末未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2024 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银行间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

本基金于本期末未持有按短期信用评级列示的债券。

##### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本期末未持有按短期信用评级列示的资产支持证券。

##### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本期末未持有按短期信用评级列示的同业存单投资。

##### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金于本期末未持有按长期信用评级列示的债券。

##### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金于本期末未持有按长期信用评级列示的资产支持证券。

##### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金于本期末未持有按长期信用评级列示的同业存单投资。

#### 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 2024 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
<b>资产</b>							
货币资金	4,443,626.96	-	-	-	-	-	4,443,626.96
结算备付金	686,168.78	-	-	-	-	-	686,168.78
存出保证金	231,316.80	-	-	-	-	-	231,316.80
交易性金融资产	-	-	-	-	-	33,446,171.61	33,446,171.61
应收申购款	-	-	-	-	-	125.00	125.00
资产总计	5,361,112.54	-	-	-	-	33,446,296.61	38,807,409.15
<b>负债</b>							
应付赎回款	-	-	-	-	-	4,659.66	4,659.66
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	32,755.76	32,755.76
应付托管费	-	-	-	-	-	4,913.36	4,913.36
应付销售服务费	-	-	-	-	-	48.99	48.99
其他负债	-	-	-	-	-	44,414.92	44,414.92
负债总计	-	-	-	-	-	86,792.69	86,792.69
利率敏感度缺口	5,361,112.54	-	-	-	-	33,359,503.92	38,720,616.46
上年度末 2023 年 12 月 31 日	1 个月以内	1-3 个月	3 个月-1 年	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
<b>资产</b>							
货币资金	5,083,198.81	-	-	-	-	-	5,083,198.81
结算备付金	467,845.75	-	-	-	-	-	467,845.75
存出保证金	140,318.40	-	-	-	-	-	140,318.40
交易性金融资产	-	-	-	-	-	44,612,942.00	44,612,942.00
应收申购款	-	-	-	-	-	139,997,025.00	139,997,025.00
资产总计	5,691,362.96	-	-	-	-	184,609,967.00	190,301,329.96
<b>负债</b>							
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	50,332.78	50,332.78
应付托管费	-	-	-	-	-	7,549.92	7,549.92
应付销售服务费	-	-	-	-	-	96.84	96.84
其他负债	-	-	-	-	-	97,000.00	97,000.00
负债总计	-	-	-	-	-	154,979.54	154,979.54
利率敏感度缺口	5,691,362.96	-	-	-	-	184,454,987.46	190,146,350.42

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

本基金于本期末未持有交易性债券资产，因此市场利率的变动对本基金净资产无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金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。

#### 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 2024年6月30日		上年度末 2023年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)	公允价值	占基金资产净值 比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	33,446,171.61	86.38	44,612,942.00	23.46
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	33,446,171.61	86.38	44,612,942.00	23.46

##### 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（2024年6月30日）	上年度末（2023年12月）

			31 日 )
	业绩比较基准上升 5%	1,772,277.40	6,815,461.31
	业绩比较基准下降 5%	-1,772,277.40	-6,815,461.31

#### 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 2024 年 6 月 30 日	上年度末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	33,446,171.61	44,612,942.00
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	33,446,171.61	44,612,942.00

###### 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**

2024 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	33,446,171.61	86.19
	其中：股票	33,446,171.61	86.19
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	5,129,795.74	13.22
8	其他各项资产	231,441.80	0.60
9	合计	38,807,409.15	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	750,198.00	1.94
C	制造业	19,042,781.40	49.18
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,280,397.46	3.31
E	建筑业	913,455.00	2.36

F	批发和零售业	1,403,487.00	3.62
G	交通运输、仓储和邮政业	1,152,479.00	2.98
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,101,488.00	8.01
J	金融业	326,577.00	0.84
K	房地产业	660,475.00	1.71
L	租赁和商务服务业	458,320.00	1.18
M	科学研究和技术服务业	102,258.00	0.26
N	水利、环境和公共设施管理业	222,754.00	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	118,221.00	0.31
R	文化、体育和娱乐业	464,023.00	1.20
S	综合	-	-
	合计	29,996,913.86	77.47

### 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	117,406.00	0.30
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,411,732.75	6.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	344,871.00	0.89
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	104,720.00	0.27
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	253,880.00	0.66
J	金融业	-	-
K	房地产业	106,722.00	0.28
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	-	-

0	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	109,926.00	0.28
S	综合	-	-
	合计	3,449,257.75	8.91

### 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	600312	平高电气	15,600	303,420.00	0.78
2	000543	皖能电力	26,200	231,870.00	0.60
3	002318	久立特材	9,500	221,635.00	0.57
4	002773	康弘药业	10,000	216,500.00	0.56
5	600007	中国国贸	9,500	208,620.00	0.54
6	000088	盐田港	45,900	207,927.00	0.54
7	603556	海兴电力	4,400	206,052.00	0.53
8	000403	派林生物	7,600	202,616.00	0.52
9	600688	上海石化	75,200	196,272.00	0.51
10	000028	国药一致	5,800	186,934.00	0.48
11	600761	安徽合力	8,500	183,940.00	0.48
12	603505	金石资源	6,500	181,545.00	0.47
13	688018	乐鑫科技	1,600	157,888.00	0.41
14	600601	方正科技	49,000	147,000.00	0.38
15	603171	税友股份	5,400	146,016.00	0.38
16	300319	麦捷科技	15,000	139,950.00	0.36
17	601126	四方股份	7,100	136,462.00	0.35
18	000049	德赛电池	5,800	136,010.00	0.35
19	002815	崇达技术	14,400	135,072.00	0.35
20	603936	博敏电子	16,000	134,400.00	0.35
21	688484	南芯科技	3,600	133,560.00	0.34
22	603328	依顿电子	16,800	132,048.00	0.34
23	600491	龙元建设	47,900	131,246.00	0.34
24	002993	奥海科技	3,500	130,200.00	0.34
25	002233	塔牌集团	17,700	129,387.00	0.33
26	600269	赣粤高速	25,000	129,250.00	0.33
27	603393	新天然气	3,700	128,538.00	0.33

28	002139	拓邦股份	12,100	128,502.00	0.33
29	688100	威胜信息	3,300	125,895.00	0.33
30	002635	安洁科技	8,100	125,064.00	0.32
31	000429	粤高速 A	12,000	124,920.00	0.32
32	002270	华明装备	5,600	124,544.00	0.32
33	000415	渤海租赁	48,600	123,930.00	0.32
34	603132	金徽股份	9,000	123,840.00	0.32
35	600718	东软集团	14,900	123,223.00	0.32
36	002003	伟星股份	9,800	122,990.00	0.32
37	688209	英集芯	9,900	122,859.00	0.32
38	600461	洪城环境	10,600	122,748.00	0.32
39	688381	帝奥微	6,300	122,724.00	0.32
40	601326	秦港股份	38,700	122,679.00	0.32
41	600757	长江传媒	15,100	121,706.00	0.31
42	600285	羚锐制药	5,000	121,050.00	0.31
43	300065	海兰信	18,300	120,963.00	0.31
44	300579	数字认证	6,200	120,900.00	0.31
45	003006	百亚股份	5,100	120,870.00	0.31
46	300679	电连技术	3,000	120,690.00	0.31
47	600033	福建高速	35,700	119,595.00	0.31
48	603989	艾华集团	8,500	119,510.00	0.31
49	600717	天津港	27,900	119,133.00	0.31
50	002274	华昌化工	16,000	118,720.00	0.31
51	000902	新洋丰	10,000	118,700.00	0.31
52	002267	陕天然气	15,700	118,692.00	0.31
53	601702	华峰铝业	6,500	118,690.00	0.31
54	600711	ST 盛屯	32,300	118,541.00	0.31
55	300143	盈康生命	15,700	118,221.00	0.31
56	600710	苏美达	14,500	118,175.00	0.31
57	300303	聚飞光电	24,300	118,098.00	0.31
58	600776	东方通信	12,000	117,960.00	0.30
59	600751	海航科技	53,100	117,882.00	0.30
60	600064	南京高科	19,400	117,758.00	0.30
61	002745	木林森	14,600	117,676.00	0.30
62	000685	中山公用	16,300	117,523.00	0.30
63	603025	大豪科技	8,500	117,470.00	0.30
64	002782	可立克	10,600	117,448.00	0.30
65	000727	冠捷科技	57,000	117,420.00	0.30
66	600874	创业环保	21,000	117,390.00	0.30
67	002053	云南能投	9,700	117,273.00	0.30
68	002245	蔚蓝锂芯	15,100	117,025.00	0.30
69	600320	振华重工	34,200	116,964.00	0.30
70	603301	振德医疗	5,600	116,816.00	0.30

71	002402	和而泰	10,900	116,739.00	0.30
72	601375	中原证券	34,200	116,622.00	0.30
73	301216	万凯新材	10,400	116,376.00	0.30
74	601811	新华文轩	8,300	116,283.00	0.30
75	688432	有研硅	12,000	116,280.00	0.30
76	600562	国睿科技	8,500	116,110.00	0.30
77	603299	苏盐井神	12,200	115,900.00	0.30
78	601163	三角轮胎	7,600	115,672.00	0.30
79	688106	金宏气体	6,600	115,632.00	0.30
80	002911	佛燃能源	12,639	115,520.46	0.30
81	000970	中科三环	15,100	115,515.00	0.30
82	601311	骆驼股份	14,400	115,488.00	0.30
83	002550	千红制药	21,400	115,346.00	0.30
84	600667	太极实业	20,200	115,342.00	0.30
85	000582	北部湾港	15,500	115,320.00	0.30
86	300674	宇信科技	10,400	115,232.00	0.30
87	600552	凯盛科技	12,200	115,046.00	0.30
88	600635	大众公用	42,900	114,972.00	0.30
89	002396	星网锐捷	8,700	114,927.00	0.30
90	002036	联创电子	17,000	114,750.00	0.30
91	601200	上海环境	13,500	114,750.00	0.30
92	002990	盛视科技	5,700	114,741.00	0.30
93	300113	顺网科技	11,200	114,688.00	0.30
94	688711	宏微科技	7,140	114,668.40	0.30
95	600971	恒源煤电	9,600	114,624.00	0.30
96	300123	亚光科技	24,700	114,608.00	0.30
97	000498	山东路桥	21,900	114,537.00	0.30
98	600888	新疆众和	16,200	114,534.00	0.30
99	300663	科蓝软件	11,600	114,492.00	0.30
100	000927	中国铁物	48,100	114,478.00	0.30
101	600248	陕建股份	31,500	114,345.00	0.30
102	600496	精工钢构	44,600	114,176.00	0.29
103	000090	天健集团	28,400	114,168.00	0.29
104	601222	林洋能源	18,200	114,114.00	0.29
105	600797	浙大网新	24,600	113,898.00	0.29
106	002649	博彦科技	14,300	113,828.00	0.29
107	002405	四维图新	18,300	113,826.00	0.29
108	601801	皖新传媒	16,400	113,652.00	0.29
109	000795	英洛华	20,500	113,570.00	0.29
110	002701	奥瑞金	27,300	113,568.00	0.29
111	688158	优刻得	11,100	113,553.00	0.29
112	600728	佳都科技	30,600	113,526.00	0.29
113	600618	氯碱化工	12,900	113,262.00	0.29

114	002467	二六三	33,900	113,226.00	0.29
115	300134	大富科技	16,600	113,212.00	0.29
116	002204	大连重工	26,500	113,155.00	0.29
117	002020	京新药业	10,800	113,076.00	0.29
118	600787	中储股份	23,500	113,035.00	0.29
119	600151	航天机电	25,000	113,000.00	0.29
120	600929	雪天盐业	21,300	112,890.00	0.29
121	300039	上海凯宝	21,100	112,885.00	0.29
122	603983	丸美股份	4,100	112,873.00	0.29
123	600273	嘉化能源	15,800	112,812.00	0.29
124	600641	万业企业	9,600	112,800.00	0.29
125	600577	精达股份	28,400	112,748.00	0.29
126	600252	中恒集团	51,900	112,623.00	0.29
127	300027	华谊兄弟	67,700	112,382.00	0.29
128	002545	东方铁塔	16,500	112,365.00	0.29
129	300660	江苏雷利	4,400	112,288.00	0.29
130	600169	太原重工	61,300	112,179.00	0.29
131	000062	深圳华强	12,600	112,140.00	0.29
132	600459	贵研铂业	8,300	112,133.00	0.29
133	600409	三友化工	22,300	111,946.00	0.29
134	002215	诺普信	15,000	111,750.00	0.29
135	002091	江苏国泰	16,400	111,684.00	0.29
136	002249	大洋电机	23,600	111,628.00	0.29
137	000029	深深房 A	10,500	111,615.00	0.29
138	002287	奇正藏药	5,700	111,606.00	0.29
139	688586	江航装备	12,000	111,600.00	0.29
140	000915	华特达因	3,700	111,592.00	0.29
141	002390	信邦制药	33,700	111,547.00	0.29
142	600651	飞乐音响	40,300	111,228.00	0.29
143	600366	宁波韵升	21,300	111,186.00	0.29
144	002697	红旗连锁	24,000	111,120.00	0.29
145	600458	时代新材	11,000	111,100.00	0.29
146	605365	立达信	7,000	111,090.00	0.29
147	600507	方大特钢	29,700	111,078.00	0.29
148	000969	安泰科技	14,000	111,020.00	0.29
149	002516	旷达科技	30,500	111,020.00	0.29
150	688279	峰昭科技	1,000	110,900.00	0.29
151	000012	南玻 A	22,000	110,880.00	0.29
152	600057	厦门象屿	16,300	110,840.00	0.29
153	601038	一拖股份	7,000	110,670.00	0.29
154	002416	爱施德	12,500	110,625.00	0.29
155	002081	金螳螂	36,500	110,595.00	0.29
156	603229	奥翔药业	11,000	110,550.00	0.29

157	688408	中信博	1,200	110,496.00	0.29
158	300772	运达股份	11,500	110,400.00	0.29
159	601609	金田股份	19,500	110,370.00	0.29
160	601678	滨化股份	31,700	110,316.00	0.28
161	688128	中国电研	6,400	110,144.00	0.28
162	601952	苏垦农发	12,200	110,044.00	0.28
163	000848	承德露露	14,000	110,040.00	0.28
164	601890	亚星锚链	15,600	109,980.00	0.28
165	002283	天润工业	25,600	109,824.00	0.28
166	600623	华谊集团	19,000	109,820.00	0.28
167	002461	珠江啤酒	14,800	109,816.00	0.28
168	002421	达实智能	47,100	109,743.00	0.28
169	002354	天娱数科	36,700	109,733.00	0.28
170	600604	市北高新	31,700	109,682.00	0.28
171	000597	东北制药	28,300	109,521.00	0.28
172	002489	浙江永强	46,200	109,494.00	0.28
173	688007	光峰科技	6,800	109,480.00	0.28
174	603638	艾迪精密	7,800	109,434.00	0.28
175	600643	爱建集团	29,000	109,330.00	0.28
176	002651	利君股份	19,900	109,251.00	0.28
177	300463	迈克生物	9,600	109,248.00	0.28
178	002212	天融信	22,400	109,088.00	0.28
179	000581	威孚高科	6,700	109,076.00	0.28
180	600662	外服控股	27,200	109,072.00	0.28
181	000019	深粮控股	19,000	109,060.00	0.28
182	603071	物产环能	8,700	109,011.00	0.28
183	688289	圣湘生物	6,200	108,996.00	0.28
184	000810	创维数字	12,700	108,966.00	0.28
185	002135	东南网架	27,500	108,900.00	0.28
186	603169	兰石重装	24,200	108,900.00	0.28
187	603297	永新光学	1,800	108,882.00	0.28
188	600502	安徽建工	25,300	108,790.00	0.28
189	603187	海容冷链	9,300	108,438.00	0.28
190	002108	沧州明珠	35,400	108,324.00	0.28
191	002258	利尔化学	13,500	108,270.00	0.28
192	601369	陕鼓动力	13,500	108,270.00	0.28
193	600037	歌华有线	18,100	108,238.00	0.28
194	002534	西子洁能	10,800	108,108.00	0.28
195	002171	楚江新材	16,400	108,076.00	0.28
196	600475	华光环能	12,400	108,004.00	0.28
197	002034	旺能环境	8,300	107,983.00	0.28
198	600596	新安股份	14,200	107,920.00	0.28
199	600556	天下秀	29,600	107,744.00	0.28

200	002216	三全食品	9,800	107,604.00	0.28
201	002123	梦网科技	15,300	107,559.00	0.28
202	000030	富奥股份	21,900	107,529.00	0.28
203	600073	光明肉业	19,500	107,445.00	0.28
204	002048	宁波华翔	8,300	107,402.00	0.28
205	600810	神马股份	17,300	107,260.00	0.28
206	600835	上海机电	9,300	107,043.00	0.28
207	600477	杭萧钢构	45,900	106,947.00	0.28
208	002705	新宝股份	7,600	106,932.00	0.28
209	300451	创业慧康	30,900	106,914.00	0.28
210	002004	华邦健康	28,000	106,400.00	0.27
211	600572	康恩贝	23,800	106,386.00	0.27
212	600750	江中药业	4,600	106,306.00	0.27
213	000811	冰轮环境	11,000	106,150.00	0.27
214	300409	道氏技术	12,400	106,144.00	0.27
215	002643	万润股份	10,600	106,000.00	0.27
216	600063	皖维高新	30,100	105,952.00	0.27
217	002978	安宁股份	3,800	105,868.00	0.27
218	600403	大有能源	41,000	105,780.00	0.27
219	300432	富临精工	16,400	105,616.00	0.27
220	600335	国机汽车	18,300	105,591.00	0.27
221	603906	龙蟠科技	13,500	105,165.00	0.27
222	600452	涪陵电力	8,300	105,161.00	0.27
223	688167	炬光科技	1,900	104,500.00	0.27
224	601886	江河集团	21,400	104,432.00	0.27
225	603699	纽威股份	6,100	104,432.00	0.27
226	002646	天佑德酒	10,200	104,346.00	0.27
227	688023	安恒信息	2,600	104,026.00	0.27
228	002100	天康生物	15,000	103,950.00	0.27
229	002434	万里扬	21,200	103,880.00	0.27
230	002158	汉钟精机	6,200	103,664.00	0.27
231	600997	开滦股份	15,100	103,586.00	0.27
232	300382	斯莱克	17,500	103,425.00	0.27
233	300369	绿盟科技	20,200	103,222.00	0.27
234	002191	劲嘉股份	28,500	102,885.00	0.27
235	605222	起帆电缆	6,700	102,778.00	0.27
236	002250	联化科技	21,400	102,720.00	0.27
237	002291	遥望科技	23,800	102,340.00	0.26
238	603113	金能科技	18,700	102,289.00	0.26
239	688372	伟测科技	2,600	102,258.00	0.26
240	002585	双星新材	20,600	102,176.00	0.26
241	300741	华宝股份	6,700	102,108.00	0.26
242	600963	岳阳林纸	27,600	101,292.00	0.26

243	600110	诺德股份	33,200	101,260.00	0.26
244	002145	中核钛白	30,800	101,024.00	0.26
245	000627	天茂集团	57,500	100,625.00	0.26
246	002320	海峡股份	19,500	100,620.00	0.26
247	300755	华致酒行	7,300	99,718.00	0.26
248	300379	东方通	12,300	99,384.00	0.26
249	600691	阳煤化工	58,100	99,351.00	0.26
250	688388	嘉元科技	10,100	98,475.00	0.25
251	300080	易成新能	34,100	98,208.00	0.25
252	002737	葵花药业	4,200	98,196.00	0.25
253	000016	深康佳 A	45,700	97,341.00	0.25
254	688177	百奥泰	4,500	95,040.00	0.25
255	002837	英维克	3,900	83,421.00	0.22

### 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	601766	中国中车	18,000	135,180.00	0.35
2	600150	中国船舶	3,200	130,272.00	0.34
3	002371	北方华创	400	127,956.00	0.33
4	601728	中国电信	20,800	127,920.00	0.33
5	600050	中国联通	26,800	125,960.00	0.33
6	000027	深圳能源	16,900	123,370.00	0.32
7	000703	恒逸石化	17,200	121,948.00	0.31
8	600019	宝钢股份	18,000	119,700.00	0.31
9	600352	浙江龙盛	13,900	119,401.00	0.31
10	600299	安迪苏	12,200	118,340.00	0.31
11	600598	北大荒	9,400	117,406.00	0.30
12	600887	伊利股份	4,500	116,280.00	0.30
13	002064	华峰化学	16,200	116,154.00	0.30
14	000830	鲁西化工	10,000	115,900.00	0.30
15	600578	京能电力	35,400	114,696.00	0.30
16	600582	天地科技	16,600	114,374.00	0.30
17	600967	内蒙一机	15,500	111,600.00	0.29
18	600873	梅花生物	11,100	111,222.00	0.29
19	605066	天正电气	19,875	110,703.75	0.29
20	601019	山东出版	9,300	109,926.00	0.28
21	600132	重庆啤酒	1,800	109,260.00	0.28
22	600380	健康元	9,700	108,349.00	0.28
23	300750	宁德时代	600	108,018.00	0.28
24	600167	联美控股	20,500	106,805.00	0.28
25	600663	陆家嘴	12,100	106,722.00	0.28
26	600309	万华化学	1,300	105,118.00	0.27
27	688819	天能股份	4,400	104,984.00	0.27

28	601010	文峰股份	61,600	104,720.00	0.27
29	601216	君正集团	28,100	103,689.00	0.27
30	002918	蒙娜丽莎	11,400	103,284.00	0.27

#### 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	002773	康弘药业	474,608.00	0.25
2	601801	皖新传媒	467,502.00	0.25
3	003006	百亚股份	456,599.00	0.24
4	000900	现代投资	452,055.00	0.24
5	000049	德赛电池	451,260.80	0.24
6	002139	拓邦股份	451,068.43	0.24
7	600787	中储股份	450,851.00	0.24
8	601222	林洋能源	450,679.00	0.24
9	002643	万润股份	450,275.00	0.24
10	600502	安徽建工	449,924.00	0.24
11	000088	盐田港	448,146.00	0.24
12	002416	爱施德	448,061.00	0.24
13	605066	天正电气	443,714.00	0.23
14	002436	兴森科技	402,923.00	0.21
15	300674	宇信科技	397,331.00	0.21
16	601702	华峰铝业	392,771.00	0.21
17	300872	天阳科技	392,438.00	0.21
18	300455	航天智装	390,585.00	0.21
19	002891	中宠股份	390,039.00	0.21
20	601890	亚星锚链	389,768.00	0.20

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	600125	铁龙物流	604,070.00	0.32
2	688403	汇成股份	536,346.59	0.28
3	000528	柳工	502,980.70	0.26
4	300894	火星号	497,458.00	0.26
5	002378	章源钨业	496,331.20	0.26
6	002023	海特高新	489,146.00	0.26
7	601869	长飞光纤	478,564.00	0.25
8	002096	易普力	473,574.00	0.25
9	603012	创力集团	473,240.00	0.25

10	000900	现代投资	448,841.00	0.24
11	002544	普天科技	444,830.00	0.23
12	600120	浙江东方	443,593.00	0.23
13	300455	航天智装	438,298.00	0.23
14	002573	清新环境	436,826.00	0.23
15	002488	金固股份	434,942.00	0.23
16	603299	苏盐井神	433,214.00	0.23
17	300872	天阳科技	426,026.00	0.22
18	002287	奇正藏药	424,772.92	0.22
19	000088	盐田港	414,797.00	0.22
20	000758	中色股份	409,660.00	0.22

注：本项“卖出金额”按卖出成交金额填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	129,271,451.35
卖出股票收入（成交）总额	134,989,024.84

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

本基金将根据风险管理原则，以套期保值为目的，有选择地投资于流动性好、交易活跃的股指期货合约。

#### 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

本基金将根据风险管理原则，以套期保值为目的，适度运用国债期货提高组合运作效率。

### 7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期内未持有国债期货。

### 7.12 投资组合报告附注

#### 7.12.1 基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现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

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 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

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	231,316.80
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	125.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	231,441.80

#### 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)	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 (%)
明亚中证 1000 指数增强 A	121	389,841.73	46,668,248.74	98.93	502,601.17	1.07
明亚中证 1000 指数增强 C	93	1,861.71	-	-	173,139.17	100.00
合计	214	221,233.59	46,668,248.74	98.57	675,740.34	1.43

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	37,861.96	0.0803
	明亚中证 1000 指数增强 C	1,060.05	0.6123
	合计	38,922.01	0.6926

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
本报告期期初基金份额总额	209,600,549.90	311,197.24
本报告期基金总申购份额	5,744,440.66	1,228,022.63
减：本报告期基金总赎回份额	168,174,140.65	1,366,080.70
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	47,170,849.91	173,139.17

## § 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

无

### 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

措施 1	内容
受到稽查或处罚等措施的主体	明亚基金管理有限责任公司
受到稽查或处罚等措施的时间	2024 年 4 月 9 日
采取稽查或处罚等措施的机构	深圳证监局
受到的具体措施类型	采取责令改正并暂停新增私募资管产品备案 3 个月的行政监管措施
受到稽查或处罚等措施的原因	单一资管计划产品由委托人推荐投资顾问，根据投资顾问的建议进行投资，存在“由委托人或其指定第三方下达投资指令或者提供具体投资标的等实质性投资建议”的情形；集合资产管理计划 B 成立于 2021 年 12 月，委托人为两只私募证券投资基金。经核查，两只私募基金穿透后的资金来源方与资管计划投资债券的发行人具有关联关系，基金公司未对两只私募基金的真实资金来源情况予以关注；未按时向监管部门报备高管变更。
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	目前公司已按监管要求完成整改
其他	-

##### 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，托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

## 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	2	264,260,476.19	100.00	116,606.03	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	5,593,403.00	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部分基金增加甬兴证券有限公司为代销机构的公告	公司官网	2024年01月02日
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	证监会指定网站、规定报刊、公司官网	2024年01月16日
3	明亚中证 1000 指数增强型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告	证监会指定网站、规定报刊、公司官网	2024年01月19日
4	明亚基金管理有限责任公司关于旗下部分基金增加财咨道信息技术有限公司为代销机构的公告	公司官网	2024年01月23日
5	明亚基金管理有限责任公司关于旗下部分基金增加国融证券股份有限公司为代销机构的公告	公司官网	2024年01月30日
6	明亚基金管理有限责任公司关于旗下部分基金增加国金证券股份有限公司为代销机构的公告	公司官网	2024年02月02日
7	明亚基金管理有限责任公司关于旗下	公司官网	2024年03月04日

	部分基金增加华宝证券股份有限公司为代销机构的公告		
8	明亚中证 1000 指数增强型证券投资基金 2023 年年度报告	证监会指定网站、规定报刊、公司官网	2024 年 03 月 27 日
9	明亚中证 1000 指数增强型证券投资基金 2024 年第一季度报告	证监会指定网站、规定报刊、公司官网	2024 年 04 月 18 日
10	明亚中证 1000 指数增强型证券投资基金基金产品资料概要更新	证监会指定网站、规定报刊、公司官网	2024 年 06 月 27 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	20240110-20240418	12,000,000.00	0.00	12,000,000.00	0.00	0.00
	2	20240105-20240630	15,423,141.12	0.00	0.00	15,423,141.12	32.58
	3	20240412-20240630	10,035,126.46	5,705,318.42	0.00	15,740,444.88	33.25
	4	20240105-20240630	32,096,292.20	0.00	16,601,530.45	15,494,761.75	32.73

#### 产品特有风险

##### 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

2024 年 8 月 28 日