

明亚中证 1000 指数增强型证券投资基金 2026 年中期报告

2026 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：2026 年 8 月 27 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 2026 年 8 月 26 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 2026 年 1 月 1 日起至 6 月 30 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§ 2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§ 3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§ 4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	9
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	11
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
§ 5 托管人报告	12
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真实、准确和完整发表意见	12
§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）	12
6.1 资产负债表	12
6.2 利润表	13
6.3 净资产变动表	15
6.4 报表附注	16
§ 7 投资组合报告	37
7.1 期末基金资产组合情况	37
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	37
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	38
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	41
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	51
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	51

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	51
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	51
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	51
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	52
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	52
7.12 投资组合报告附注	52
§ 8 基金份额持有人信息	53
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	53
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	53
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	54
§ 9 开放式基金份额变动	54
§ 10 重大事件揭示	54
10.1 基金份额持有人大会决议	54
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	54
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	55
10.4 基金投资策略的改变	55
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	55
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	55
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	55
10.8 其他重大事件	56
§ 11 影响投资者决策的其他重要信息	57
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	57
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	58
§ 12 备查文件目录	58
12.1 备查文件目录	58
12.2 存放地点	58
12.3 查阅方式	58

§ 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	92,669,079.66 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	1,054,945.61 份	91,614,134.05 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	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	韩鑫普

负责人	联系电话	4008-785-795	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 T1 写字楼 1804B	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 T1 写字楼 1804B	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		王靖	朱江涛

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
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.mingyafunds.com
基金中期报告置备地点	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 T1 写字楼 1804B

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 T1 写字楼 1804B

§ 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(2026 年 1 月 1 日-2026 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	139,869.79	11,264,579.44
本期利润	155,979.27	11,914,893.52
加权平均基金份 额本期利润	0.1378	0.1401
本期加权平均净 值利润率	10.58%	10.86%
本期基金份额净 值增长率	11.50%	11.28%
3.1.2 期末数	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	

据和指标		
期末可供分配利润	195,086.52	15,589,595.26
期末可供分配基金份额利润	0.1849	0.1702
期末基金资产净值	1,444,420.76	123,977,714.27
期末基金份额净值	1.3692	1.3533
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2026 年 6 月 30 日)	
基金份额累计净值增长率	36.92%	35.33%

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
过去三个月	11.46%	1.42%	14.83%	1.53%	-3.37%	-0.11%
过去六个月	11.50%	1.34%	15.23%	1.54%	-3.73%	-0.20%
过去一年	29.24%	1.11%	36.53%	1.31%	-7.29%	-0.20%
过去三年	36.24%	1.38%	32.22%	1.57%	4.02%	-0.19%
自基金合同生效起至今	36.92%	1.34%	29.93%	1.54%	6.99%	-0.20%

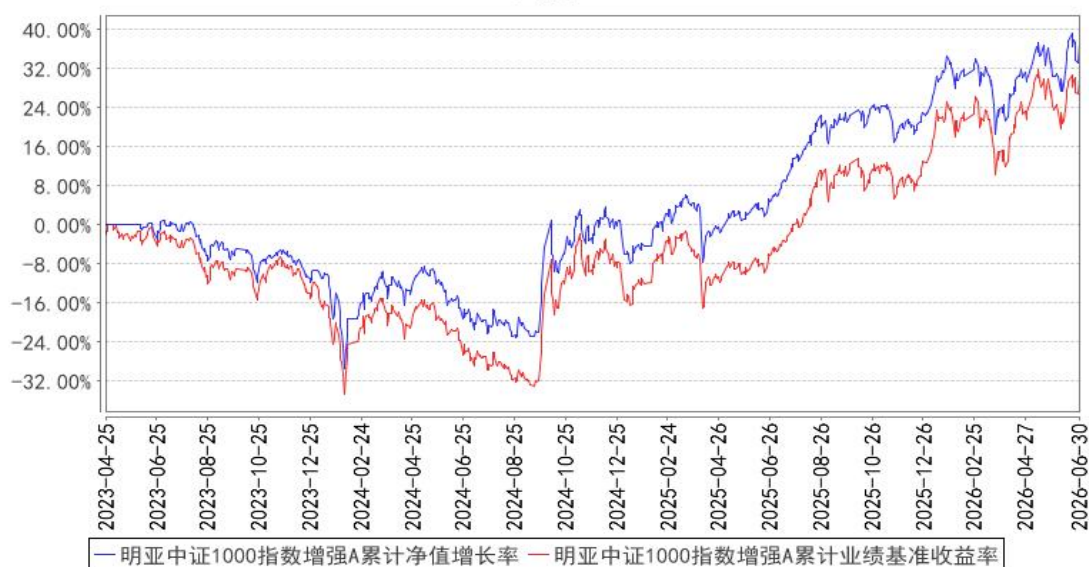
明亚中证 1000 指数增强 C

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
----	----------	-------------	------------	---------------	-----	-----

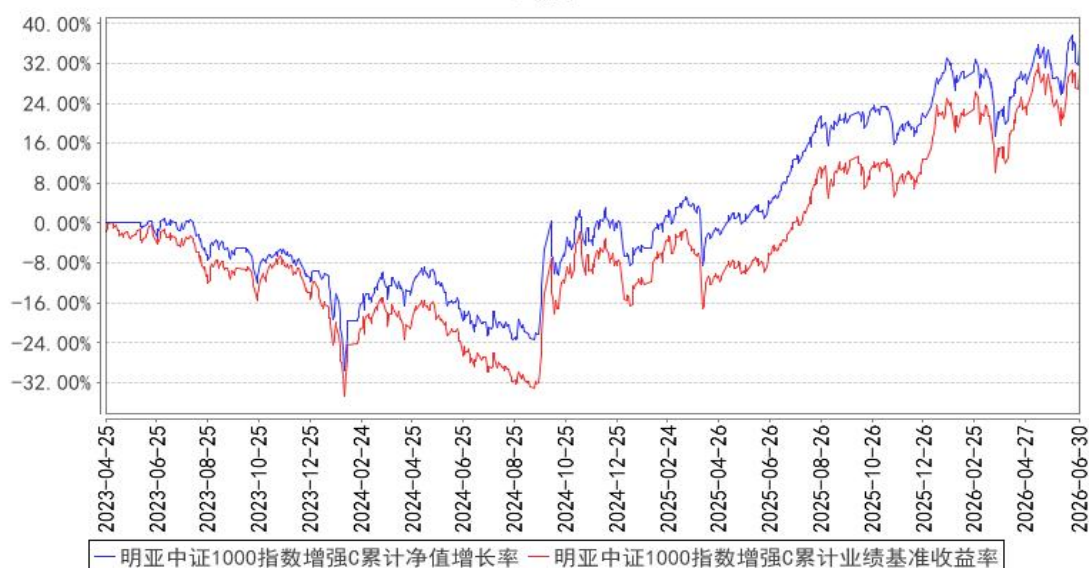
过去三个月	11.36%	1.42%	14.83%	1.53%	-3.47%	-0.11%
过去六个月	11.28%	1.34%	15.23%	1.54%	-3.95%	-0.20%
过去一年	28.82%	1.10%	36.53%	1.31%	-7.71%	-0.21%
过去三年	34.64%	1.38%	32.22%	1.57%	2.42%	-0.19%
自基金合同生效起 至今	35.33%	1.34%	29.93%	1.54%	5.40%	-0.20%

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

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的公募基金有：明亚价值长青混合型证券投资基金、明亚中证 1000 指数增强型证券投资基金、明亚久安 90 天持有期债券型证券投资基金、明亚稳利 3 个月持有期债券型证券投资基金、明亚远臻智选混合型证券投资基金、明亚多元配置三个月持有期混合型基金中基金（FOF）、明亚稳健配置三个月持有期混合型基金中基金（FOF）。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	-	26 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	2026 年 2 月 9 日	7 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，历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

2026 年上半年 A 股市场以结构性行情为主，科创 50、创业板指作为科技成长的代表性指数大幅跑赢其他宽基指数；行业间分化更为显著，电子、通信高居涨幅榜前两位，商贸零售、农林牧渔、美容、消费者服务等板块则有较大幅度的下跌，从相对收益角度看，行业涨跌幅度首尾相差巨大，为 A 股历史少见。分季度看，一季度市场呈现大幅波动，1、2 月科技和有色领涨，进入 3 月，美伊冲突升级后市场大幅波动，有色、科技板块出现较大幅度回撤，油气、煤炭、部分替代能源及稳定类资产表现占优；二季度市场对美伊冲突脱敏，转而聚焦产业和盈利趋势，A 股分化加剧。AI 算力相关产业链全面上涨，半导体设备与材料、PCB、光模块、芯片、核心元器件等细分领域均有可观涨幅。科技板块的强势上涨对其他行业形成了一定的压制，资金追逐产业趋势与盈利均处于上升阶段的科技，盈利短期承压的顺周期、消费等板块则因资金流出而持续走弱。

2026 年上半年中证 1000 有较好的收益表现。由于 A 股市场上半年科技板块领涨、成长风格占优，中证 1000 成分股覆盖大量中小市值科技与制造相关公司，因此在科技主线行情中通常会有较好的 β 弹性。策略配置方面，本季度继续坚持以基本面因子为主，重点配置高质量、高盈利的公司。在估值风格与成长风格的选择上，仍然采取了均衡配置加小幅轮动的思路，避免出现估值、

盈利同时下跌造成超额过度回撤。选股范围保持中证 1000 成分股的高占比，超额收益来自于对价值风格、质量风格、成长风格的有效轮动。操作上增加了仓位调整的频率，尽可能紧跟指数的表现，减少跟踪误差。

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 1.3692，本报告期份额净值增长率为 11.50%；明亚中证 1000 指数增强 C 的基金份额净值为 1.3533，本报告期基金份额净值增长率为 11.28%。同期业绩比较基准收益率为 15.23%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2026 年下半年，宏观层面大概率延续温和增长与政策托底并举的局面，流动性整体仍然中性偏松，但边际变化，如风险偏好、成交活跃度以及风格切换等因素会对小盘指数产生更明显的影响。科技可能依旧是各行业中，景气度与盈利增速最高的方向，但需要更加关注业绩兑现与订单的可验证，在市场逐步由预期驱动转向盈利验证的阶段，对壁垒、现金流以及估值匹配度的要求更高。中证 1000 指数做为专精特新领域的载体，成分股盈利趋势向好对指数依旧形成有效的支撑，我们仍然会坚持更多在高质量公司中赚取超额收益，谨慎对待市值下沉。同时也加强了对具备成长潜质的好公司的选择。积极运用量化模型和选股模型，主动调整组合的风险敞口，力争在与中证 1000 指数保持较小跟踪误差的前提下，创造较为稳定的超额收益。

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，本基金管理人严格按照企业会计准则、中国证券监督管理委员会相关规定和基金合同的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。基金托管人根据法律法规要求对基金管理人采用的估值政策和程序进行核查，并对估值结果及净值计算进行复核。

本基金管理人根据相关法律法规，制定了健全、有效的估值政策和程序，建立了估值委员会，估值委员会由分管基金运营部的高级管理人员、督察长和投资部、研究部、交易部、基金运营部、合规风控部负责人组成，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。估值委员会成员均具有基金从业资格、专业胜任能力和相关工作经历。

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，本基金不存在连续二十个工作日基金份额持有人数不满二百人或基金资产净值低于五千万元的情形。

§ 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：2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	13,521,764.50	4,858,677.34
结算备付金		3,120.99	3,102.89
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	114,873,194.71	61,550,891.01
其中：股票投资		114,873,194.71	61,550,891.01
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	-	999,770.33
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		53,208.84	3,963.98
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.8	-	-
资产总计		128,451,289.04	67,416,405.55
负债和净资产	附注号	本期末 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		2,820,735.95	650,692.44
应付管理人报酬		103,095.41	59,798.33
应付托管费		15,464.33	8,969.73
应付销售服务费		40,656.63	23,334.52
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	49,201.69	34,097.77
负债合计		3,029,154.01	776,892.79
净资产:			
实收基金	6.4.7.10	92,669,079.66	54,789,109.55
未分配利润	6.4.7.12	32,753,055.37	11,850,403.21
净资产合计		125,422,135.03	66,639,512.76
负债和净资产总计		128,451,289.04	67,416,405.55

注：报告截止日 2026 年 6 月 30 日，基金份额总额 92,669,079.66 份，其中明亚中证 1000 指数增强 A 基金份额净值 1.3692 元，份额总额 1,054,945.61 份；明亚中证 1000 指数增强 C 基金份额净值 1.3533 元，份额总额 91,614,134.05 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：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日
一、营业总收入		12,967,658.45	508,189.20
1. 利息收入		34,923.33	2,020.79
其中：存款利息收入	6.4.7.13	33,954.45	2,020.79
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		968.88	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-” 填列）		12,160,845.96	-14,754.17
其中：股票投资收益	6.4.7.14	11,660,522.08	-109,656.16
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	-	-
股利收益	6.4.7.19	500,323.88	94,901.99
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	666,423.56	520,464.22
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	105,465.60	458.36
减：二、营业总支出		896,785.66	80,052.16
1. 管理人报酬	6.4.10.2.1	549,105.52	51,904.90
其中：暂估管理人报酬		-	-
2. 托管费	6.4.10.2.2	82,365.80	7,785.68
3. 销售服务费	6.4.10.2.3	216,715.84	20,361.58
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	48,598.50	-
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		12,070,872.79	428,137.04
减：所得税费用		-	-

四、净利润(净亏损以“-”号填列)		12,070,872.79	428,137.04
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		12,070,872.79	428,137.04

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：2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 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	54,789,109.55	-	11,850,403.21	66,639,512.76
二、本期期初净资产	54,789,109.55	-	11,850,403.21	66,639,512.76
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	37,879,970.11	-	20,902,652.16	58,782,622.27
(一)、综合收益总额	-	-	12,070,872.79	12,070,872.79
(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)	37,879,970.11	-	8,831,779.37	46,711,749.48
其中：1. 基金申购款	110,019,756.37	-	31,239,190.81	141,258,947.18
2. 基金赎回款	-72,139,786.26	-	-22,407,411.44	-94,547,197.70
(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	92,669,079.66	-	32,753,055.37	125,422,135.03
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	19,383,369.73	-	-401,990.58	18,981,379.15

二、本期期初净资产	19,383,369.73	-	-401,990.58	18,981,379.15
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-9,722,390.43	-	891,502.77	-8,830,887.66
(一)、综合收益总额	-	-	428,137.04	428,137.04
(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)	-9,722,390.43	-	463,365.73	-9,259,024.70
其中：1. 基金申购款	300,292.35	-	-3,230.75	297,061.60
2. 基金赎回款	-10,022,682.78	-	466,596.48	-9,556,086.30
(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	9,660,979.30	-	489,512.19	10,150,491.49

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：

王靖

杨飞

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》准予注册,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。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。

根据《明亚中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》和《明亚中证 1000 指数增强型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金根据认购费、申购费和销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购时收取认购、申购费用，但不从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 A 类基金份额；不收取认购、申购费用，从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为 C 类基金份额。A 类基金份额和 C 类基金份额分别设置代码，分别计算基金份额净值并分别公告。

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

规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

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 2026 年 06 月 30 日的财务状况以及 2026 年 01 月 01 日至 2026 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

6.4.6.1 印花税

经国务院批准，财政部、国家税务总局研究决定，自 2008 年 4 月 24 日起，调整证券（股票）交易印花税税率，由原先的 3% 调整为 1%；根据财政部、税务总局公告 2023 年第 39 号《关于减半征收证券交易印花税的公告》的规定，自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

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

6.4.6.2 增值税

根据财政部、国家税务总局公告 2025 年第 4 号，自 2025 年 8 月 8 日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税。对在该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（包含在 2025 年 8 月 8 日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。上述金融债券，是指依法在中华人民共和国境内设立的金融机构法人在全国银行间和交易所债券市场发行的、按约定还本付息并由金融机构持有的有价证券。

根据财政部、国家税务总局财税[2016]36 号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》的规定，经国务院批准，自 2016 年 5 月 1 日起在全国范围内全面推开营业税改征增值税试点，金融业纳入试点范围，由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金（封闭式证券投资基金，开

放式证券投资基金）管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税；国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来利息收入免征增值税；存款利息收入不征收增值税；

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

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

根据财政部、国家税务总局财税[2016]140 号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，本基金运营过程中发生的增值税应税行为，以本基金的基金管理人为增值税纳税人；

根据财政部、国家税务总局财税[2017]56 号文《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，证券投资基金的基金管理人运营证券投资基金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。对证券投资基金在 2018 年 1 月 1 日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从证券投资基金的基金管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

6.4.6.3 城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加

根据《中华人民共和国城市维护建设税法》、《征收教育费附加的暂行规定（2011 年修订）》及相关地方教育附加的征收规定，凡缴纳消费税、增值税、营业税的单位和个人，都应当依照规定缴纳城市维护建设税、教育费附加（除按照相关规定缴纳农村教育事业费附加的单位外）及地方教育附加。本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3% 和 2% 缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

6.4.6.4 企业所得税

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

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

6.4.6.5 个人所得税

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

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

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

6.4.6.6 境外投资

本基金运作过程中涉及的境外投资的税项问题，根据财政部、国家税务总局、中国证监会财税[2014]81 号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127 号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》及其他境内外相关税务法规的规定和实务操作执行。

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 2026 年 6 月 30 日
活期存款	2,726,636.11
等于：本金	2,725,160.27
加：应计利息	1,475.84
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	10,795,128.39
等于：本金	10,794,993.04

加：应计利息	135.35
减：坏账准备	—
合计	13,521,764.50

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 2026 年 6 月 30 日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	113,832,109.52	—	114,873,194.71	1,041,085.19
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	113,832,109.52	—	114,873,194.71	1,041,085.19

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

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

本基金本报告期末未持有期货合约。

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

本基金本报告期末无买断式逆回购交易中取得的债券。

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

本基金本报告期末未持有债权投资。

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

本基金本报告期末未持有其他债权投资。

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 2026 年 6 月 30 日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	603.19
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提审计费	8,926.92
预提信息披露费	39,671.58
合计	49,201.69

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
----	----

	2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	987,231.58	987,231.58
本期申购	2,040,105.65	2,040,105.65
本期赎回（以“-”号填列）	-1,972,391.62	-1,972,391.62
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	1,054,945.61	1,054,945.61

明亚中证 1000 指数增强 C

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	53,801,877.97	53,801,877.97
本期申购	107,979,650.72	107,979,650.72
本期赎回（以“-”号填列）	-70,167,394.64	-70,167,394.64
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	91,614,134.05	91,614,134.05

注：申购含红利再投、转换入份额，赎回含转化出份额。

6.4.7.11 其他综合收益

本基金本报告期末无其他综合收益。

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	32,371.63	192,695.14	225,066.77
本期期初	32,371.63	192,695.14	225,066.77
本期利润	139,869.79	16,109.48	155,979.27
本期基金份额交易产生的变动数	22,845.10	-14,415.99	8,429.11
其中：基金申购款	227,434.17	391,209.74	618,643.91
基金赎回款	-204,589.07	-405,625.73	-610,214.80
本期已分配利润	-	-	-
本期末	195,086.52	194,388.63	389,475.15

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	1,193,911.19	10,431,425.25	11,625,336.44

本期期初	1,193,911.19	10,431,425.25	11,625,336.44
本期利润	11,264,579.44	650,314.08	11,914,893.52
本期基金份额交易产生的变动数	3,131,104.63	5,692,245.63	8,823,350.26
其中：基金申购款	10,217,643.38	20,402,903.52	30,620,546.90
基金赎回款	-7,086,538.75	-14,710,657.89	-21,797,196.64
本期已分配利润	-	-	-
本期末	15,589,595.26	16,773,984.96	32,363,580.22

6.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
活期存款利息收入	32,293.30
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	1,643.05
结算备付金利息收入	18.10
其他	-
合计	33,954.45

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	11,660,522.08
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	11,660,522.08

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
卖出股票成交总额	730,945,874.73
减：卖出股票成本总额	718,529,232.71
减：交易费用	756,119.94
买卖股票差价收入	11,660,522.08

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

本基金本报告期无债券投资收益。

6.4.7.15.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

本基金本报告期无债券投资收益——买卖债券差价收入。

6.4.7.15.3 债券投资收益——赎回差价收入

本基金本报告期无债券投资收益——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

本基金本报告期无衍生工具收益——其他投资收益。

6.4.7.19 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
股票投资产生的股利收益	500,323.88
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	500,323.88

6.4.7.20 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
1. 交易性金融资产	666,423.56
股票投资	666,423.56
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	—
权证投资	—
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	666,423.56

6.4.7.21 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
基金赎回费收入	105,465.60
合计	105,465.60

6.4.7.22 信用减值损失

本基金本报告期无信用减值损失。

6.4.7.23 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日
审计费用	8,926.92

信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
合计	48,598.50

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、关联关系

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
杨飞	基金管理人股东
蒋如光	基金管理人股东

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

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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	-	-	83,198,450.11	100.00

6.4.10.1.2 债券交易

本基金本报告期内及上年度可比期间没有通过关联方交易单元进行的债券交易。

6.4.10.1.3 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间没有通过关联方交易单元进行的债券回购交易。

6.4.10.1.4 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间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 2026年1月1日至2026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（%）
-	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2025年1月1日至2025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	15,883.71	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 2026年1月1日至2026年6 月30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年 6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	549,105.52	51,904.90
其中：应支付销售机构的客户维护 费	274,407.77	16,057.00
应支付基金管理人的净管理费	274,697.75	35,847.90

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 2026年1月1日至2026年6 月30日	上年度可比期间 2025年1月1日至2025年 6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	82,365.80	7,785.68

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		
	2026 年 1 月 1 日至 2026 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	-	492.35	492.35
合计	-	492.35	492.35
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2025 年 1 月 1 日至 2025 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	-	42.82	42.82
合计	-	42.82	42.82

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

本基金本报告期及上年度可比期间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

本基金本报告期及上年度可比期间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

本基金本报告期及上年度可比期间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

份额单位：份

项目	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日	本期 2026 年 1 月 1 日至 2026 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
基金合同生效日（ 2023 年 4 月 25 日）持有的基金份额	0.00	-
报告期初持有的基金份额	18,763.12	-
报告期间申购/买入总份额	0.00	-
报告期间因拆分变动份额	0.00	-
减：报告期间赎回/卖出总份 额	0.00	-
报告期末持有的基金份额	18,763.12	-
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	1.7786%	-
项目	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 年 6 月 30 日	上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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
基金合同生效日（ 2023 年 4 月 25 日）持有的基金份额	0.00	-
报告期初持有的基金份额	18,763.12	-
报告期间申购/买入总份额	0.00	-
报告期间因拆分变动份额	0.00	-
减：报告期间赎回/卖出总份 额	0.00	-
报告期末持有的基金份额	18,763.12	-
报告期末持有的基金份额 占基金总份额比例	9.9734%	-

注：本基金管理人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。

6.4.10.5.2 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 2026 年 6 月 30 日		上年度末 2025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（%）
蒋如光	9.90	0.0009	9.90	0.0010

杨飞	99.01	0.0094	99.01	0.0100
----	-------	--------	-------	--------

注：蒋如光、杨飞为公司股东，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 2026 年 1 月 1 日至 2026 年 6 月 30 日		上年度可比期间 2025 年 1 月 1 日至 2025 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	2,726,636.11	32,293.30	77,670.95	1,603.44

注：本基金的活期存款由基金托管人招商证券股份有限公司保管，按约定存款利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未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

本基金本报告期末未进行利润分配。

6.4.12 期末（2026 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，本基金未持有债券或资产支持证券。

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。

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。

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 2026 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							
货币资金	13,521,764.50	-	-	-	-	-	13,521,764.50
结算备付金	3,120.99	-	-	-	-	-	3,120.99
交易性金融资产	-	-	-	-	-	114,873,194.71	114,873,194.71
应收申购款	-	-	-	-	-	53,208.84	53,208.84
资产总计	13,524,885.49	-	-	-	-	114,926,403.55	128,451,289.04
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	2,820,735.95	2,820,735.95
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	103,095.41	103,095.41
应付托管费	-	-	-	-	-	15,464.33	15,464.33
应付销售服务费	-	-	-	-	-	40,656.63	40,656.63
其他负债	-	-	-	-	-	49,201.69	49,201.69
负债总计	-	-	-	-	-	3,029,154.01	3,029,154.01
利率敏感度缺口	13,524,885.49	-	-	-	-	111,897,249.54	125,422,135.03
上年度末 2025 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
资产							
货币资金	4,858,677.34	-	-	-	-	-	4,858,677.34
结算备付金	3,102.89	-	-	-	-	-	3,102.89
交易性金融资产	-	-	-	-	-	61,550,891.01	61,550,891.01
买入返售金融资产	999,770.33	-	-	-	-	-	999,770.33
应收申购款	-	-	-	-	-	3,963.98	3,963.98
资产总计	5,861,550.56	-	-	-	-	61,554,854.99	67,416,405.55
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	650,692.44	650,692.44
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	59,798.33	59,798.33
应付托管费	-	-	-	-	-	8,969.73	8,969.73
应付销售服务费	-	-	-	-	-	23,334.52	23,334.52
其他负债	-	-	-	-	-	34,097.77	34,097.77
负债总计	-	-	-	-	-	776,892.79	776,892.79
利率敏感度缺口	5,861,550.56	-	-	-	-	60,777,962.20	66,639,512.76

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

项目	本期末		上年度末	
	2026 年 6 月 30 日		2025 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	114,873,194.71	91.59	61,550,891.01	92.36
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	114,873,194.71	91.59	61,550,891.01	92.36

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（2026 年 6 月 30 日）	上年度末（2025 年 12 月 31 日）
	业绩比较基准上升 5%	5,228,361.08	2,713,143.96

	业绩比较基准下降 5%	-5, 228, 361. 08	-2, 713, 143. 96
--	----------------	------------------	------------------

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 2026 年 6 月 30 日	上年度末 2025 年 12 月 31 日
第一层次	114, 873, 194. 71	61, 550, 891. 01
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	114, 873, 194. 71	61, 550, 891. 01

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

2026 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

本基金持有的不以公允价值计量的金融工具为以摊余成本计量的金融资产和金融负债，这

些金融工具因其剩余期限较短，所以其账面价值与公允价值相若。

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	114,873,194.71	89.43
	其中：股票	114,873,194.71	89.43
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	13,524,885.49	10.53
8	其他各项资产	53,208.84	0.04
9	合计	128,451,289.04	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	5,586,470.00	4.45
C	制造业	77,543,232.71	61.83
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,837,387.00	5.45
E	建筑业	2,227,551.00	1.78
F	批发和零售业	4,622,941.00	3.69
G	交通运输、仓储和邮政业	1,085,699.00	0.87
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	16,313,364.00	13.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-

L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	656, 550. 00	0. 52
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	114, 873, 194. 71	91. 59

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

本基金本报告期末未持有积极投资的境内股票。

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	688503	聚和材料	11, 347	1, 505, 746. 90	1. 20
2	301392	汇成真空	5, 100	1, 472, 064. 00	1. 17
3	688110	东芯股份	6, 594	1, 343, 197. 80	1. 07
4	300503	昊志机电	14, 300	1, 319, 890. 00	1. 05
5	688549	中巨芯	35, 833	1, 319, 012. 73	1. 05
6	688593	新相微	33, 623	1, 308, 607. 16	1. 04
7	600619	海立股份	80, 000	1, 268, 000. 00	1. 01
8	300323	华灿光电	62, 000	1, 264, 800. 00	1. 01
9	688279	峰昭科技	5, 597	1, 256, 190. 68	1. 00
10	002053	云南能投	127, 400	1, 252, 342. 00	1. 00
11	688165	埃夫特	61, 189	1, 248, 255. 60	1. 00
12	300821	东岳硅材	60, 600	1, 245, 936. 00	0. 99
13	300723	一品红	33, 400	1, 245, 152. 00	0. 99
14	688003	天准科技	9, 775	1, 244, 357. 50	0. 99
15	688141	杰华特	8, 092	1, 242, 122. 00	0. 99
16	000810	创维数字	93, 400	1, 237, 550. 00	0. 99
17	002338	奥普光电	21, 600	1, 235, 520. 00	0. 99
18	300613	富瀚微	15, 300	1, 225, 224. 00	0. 98

19	688559	海目星	14,573	1,222,966.16	0.98
20	688519	南亚新材	3,217	1,222,588.68	0.97
21	688107	安路科技	26,491	1,207,989.60	0.96
22	300607	拓斯达	29,100	1,199,793.00	0.96
23	300493	润欣科技	80,300	1,197,273.00	0.95
24	300861	美畅股份	47,400	1,194,006.00	0.95
25	300357	我武生物	51,100	1,191,652.00	0.95
26	688766	普冉股份	1,554	1,191,296.40	0.95
27	002077	大港股份	61,600	1,188,264.00	0.95
28	688025	杰普特	2,527	1,187,690.00	0.95
29	300814	中富电路	5,800	1,186,100.00	0.95
30	301275	汉朔科技	26,400	1,185,360.00	0.95
31	002006	精工科技	80,500	1,184,155.00	0.94
32	002745	木林森	93,700	1,175,935.00	0.94
33	002192	融捷股份	13,100	1,171,140.00	0.93
34	688400	凌云光	17,680	1,170,416.00	0.93
35	603638	艾迪精密	49,900	1,170,155.00	0.93
36	300184	力源信息	66,600	1,168,830.00	0.93
37	002174	游族网络	92,400	1,165,164.00	0.93
38	688388	嘉元科技	26,474	1,164,856.00	0.93
39	688031	星环科技	10,062	1,158,941.16	0.92
40	301563	云汉芯城	6,600	1,150,974.00	0.92
41	300337	银邦股份	98,700	1,150,842.00	0.92
42	300459	汤姆猫	339,300	1,150,227.00	0.92
43	002151	北斗星通	36,200	1,149,350.00	0.92
44	000685	中山公用	102,400	1,142,784.00	0.91
45	300738	奥飞数据	56,300	1,138,386.00	0.91
46	301489	思泉新材	6,900	1,135,602.00	0.91
47	301101	明月镜片	41,600	1,133,184.00	0.90
48	000581	威孚高科	66,500	1,131,830.00	0.90
49	300768	迪普科技	82,100	1,130,517.00	0.90
50	002516	旷达科技	202,600	1,130,508.00	0.90
51	301219	腾远钴业	20,610	1,129,428.00	0.90
52	001339	智微智能	11,030	1,128,148.40	0.90
53	603025	大豪科技	82,700	1,128,028.00	0.90
54	000973	佛塑科技	78,600	1,127,910.00	0.90
55	300034	钢研高纳	65,800	1,127,812.00	0.90
56	300098	高新兴	245,700	1,127,763.00	0.90
57	600744	华银电力	175,100	1,125,893.00	0.90
58	301662	宏工科技	11,100	1,124,652.00	0.90
59	600116	三峡水利	200,700	1,123,920.00	0.90
60	600037	歌华有线	179,000	1,122,330.00	0.89
61	301510	固高科技	35,100	1,120,743.00	0.89

62	001337	四川黄金	30,500	1,118,130.00	0.89
63	002498	汉缆股份	163,900	1,117,798.00	0.89
64	603317	天味食品	85,900	1,117,559.00	0.89
65	301500	飞南资源	42,900	1,117,545.00	0.89
66	601038	一拖股份	105,500	1,117,245.00	0.89
67	603026	石大胜华	12,500	1,117,125.00	0.89
68	002761	浙江建投	168,300	1,115,829.00	0.89
69	600320	振华重工	269,700	1,113,861.00	0.89
70	300153	科泰电源	49,200	1,112,904.00	0.89
71	002163	海南发展	133,300	1,111,722.00	0.89
72	600961	株冶集团	34,300	1,110,977.00	0.89
73	600971	恒源煤电	160,800	1,109,520.00	0.88
74	300075	数字政通	108,500	1,108,870.00	0.88
75	301216	万凯新材	48,200	1,108,118.00	0.88
76	301511	德福科技	7,700	1,107,645.00	0.88
77	002488	金固股份	124,300	1,107,513.00	0.88
78	603883	老百姓	100,900	1,105,864.00	0.88
79	000966	长源电力	281,400	1,103,088.00	0.88
80	000612	焦作万方	104,000	1,101,360.00	0.88
81	601069	西部黄金	50,000	1,100,000.00	0.88
82	600006	东风股份	214,300	1,099,359.00	0.88
83	000681	视觉中国	55,000	1,096,700.00	0.87
84	301665	泰禾股份	52,100	1,092,016.00	0.87
85	300341	麦克奥迪	82,300	1,090,475.00	0.87
86	301217	铜冠铜箔	6,600	1,089,462.00	0.87
87	600726	华电能源	153,000	1,089,360.00	0.87
88	601101	昊华能源	103,000	1,087,680.00	0.87
89	002737	葵花药业	97,000	1,087,370.00	0.87
90	600717	天津港	279,100	1,085,699.00	0.87
91	002588	史丹利	137,300	1,084,670.00	0.86
92	300773	拉卡拉	70,740	1,082,322.00	0.86
93	002378	章源钨业	32,200	1,078,056.00	0.86
94	600869	远东股份	32,100	1,074,387.00	0.86
95	601678	滨化股份	148,900	981,251.00	0.78
96	603327	福蓉科技	114,700	972,656.00	0.78
97	300438	鹏辉能源	11,400	944,490.00	0.75
98	688522	纳睿雷达	35,377	708,247.54	0.56
99	300726	宏达电子	8,200	693,474.00	0.55
100	301267	华夏眼科	45,000	656,550.00	0.52
101	688127	蓝特光学	4,989	486,926.40	0.39

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

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

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	301101	明月镜片	4,049,306.00	6.08
2	600320	振华重工	3,738,389.00	5.61
3	603876	鼎胜新材	3,708,883.00	5.57
4	000848	承德露露	3,707,614.00	5.56
5	301510	固高科技	3,562,992.00	5.35
6	002588	史丹利	3,506,412.00	5.26
7	000685	中山公用	3,374,838.00	5.06
8	001309	德明利	3,344,669.00	5.02
9	600717	天津港	3,243,074.00	4.87
10	300738	奥飞数据	3,223,799.00	4.84
11	300363	博腾股份	3,184,797.00	4.78
12	000028	国药一致	3,143,149.50	4.72
13	301267	华夏眼科	3,131,509.65	4.70
14	000885	城发环境	3,087,457.00	4.63
15	002557	洽洽食品	3,080,365.44	4.62
16	603025	大豪科技	3,025,001.00	4.54
17	002516	旷达科技	2,987,651.00	4.48
18	601069	西部黄金	2,987,411.00	4.48
19	000581	威孚高科	2,969,956.33	4.46
20	300493	润欣科技	2,959,293.00	4.44
21	301219	腾远钴业	2,948,586.00	4.42
22	000589	贵州轮胎	2,915,158.00	4.37
23	300841	康华生物	2,908,431.50	4.36
24	603915	国茂股份	2,871,672.00	4.31
25	300768	迪普科技	2,871,606.00	4.31
26	600116	三峡水利	2,858,629.00	4.29
27	600267	海正药业	2,845,383.00	4.27
28	688522	纳睿雷达	2,842,588.03	4.27
29	600507	方大特钢	2,752,748.00	4.13
30	300953	震裕科技	2,737,416.40	4.11
31	688503	聚和材料	2,694,376.59	4.04
32	603100	川仪股份	2,691,196.00	4.04
33	600353	旭光电子	2,642,749.00	3.97
34	603026	石大胜华	2,639,383.00	3.96
35	301606	绿联科技	2,634,517.00	3.95
36	601677	明泰铝业	2,617,468.00	3.93
37	000682	东方电子	2,582,537.00	3.88
38	002405	四维图新	2,573,481.50	3.86

39	301571	国科天成	2,568,208.00	3.85
40	603083	剑桥科技	2,565,320.00	3.85
41	000927	中国铁物	2,565,267.00	3.85
42	301215	中汽股份	2,529,898.00	3.80
43	600686	金龙汽车	2,523,953.00	3.79
44	600033	福建高速	2,493,230.00	3.74
45	603383	顶点软件	2,489,957.00	3.74
46	600201	生物股份	2,487,962.00	3.73
47	688279	峰昭科技	2,470,822.15	3.71
48	300357	我武生物	2,450,371.00	3.68
49	002354	天娱数科	2,416,886.00	3.63
50	300773	拉卡拉	2,387,438.80	3.58
51	600726	华电能源	2,380,687.00	3.57
52	605020	永和股份	2,341,659.00	3.51
53	300341	麦克奥迪	2,333,917.00	3.50
54	600782	新钢股份	2,285,751.00	3.43
55	600971	恒源煤电	2,256,414.00	3.39
56	002351	漫步者	2,233,226.50	3.35
57	601126	四方股份	2,231,988.00	3.35
58	301487	盟固利	2,210,970.00	3.32
59	002239	奥特佳	2,200,270.00	3.30
60	603317	天味食品	2,196,035.00	3.30
61	601777	千里科技	2,182,720.00	3.28
62	002545	东方铁塔	2,175,070.00	3.26
63	600552	凯盛科技	2,171,435.00	3.26
64	301500	飞南资源	2,170,822.00	3.26
65	600894	广日股份	2,168,086.00	3.25
66	600740	山西焦化	2,166,579.00	3.25
67	001337	四川黄金	2,150,407.00	3.23
68	603588	高能环境	2,137,171.00	3.21
69	002053	云南能投	2,124,923.00	3.19
70	000552	甘肃能化	2,118,790.00	3.18
71	300184	力源信息	2,062,808.00	3.10
72	600037	歌华有线	2,053,765.00	3.08
73	603236	移远通信	2,047,512.00	3.07
74	300257	开山股份	2,033,658.00	3.05
75	301665	泰禾股份	2,016,724.00	3.03
76	300726	宏达电子	2,008,496.00	3.01
77	603638	艾迪精密	2,005,409.11	3.01
78	300171	东富龙	1,995,233.00	2.99
79	600961	株冶集团	1,981,738.00	2.97
80	688146	中船特气	1,979,926.01	2.97
81	600420	国药现代	1,977,752.00	2.97

82	301371	敷尔佳	1,965,129.00	2.95
83	603663	三祥新材	1,915,409.16	2.87
84	002489	浙江永强	1,914,027.00	2.87
85	300678	中科信息	1,912,883.00	2.87
86	000810	创维数字	1,909,775.00	2.87
87	688127	蓝特光学	1,906,050.12	2.86
88	603730	岱美股份	1,903,681.00	2.86
89	600850	电科数字	1,899,812.00	2.85
90	002101	广东鸿图	1,889,085.00	2.83
91	002006	精工科技	1,888,787.00	2.83
92	600155	华创云信	1,881,582.00	2.82
93	605198	安德利	1,869,200.00	2.80
94	688779	五矿新能	1,864,890.56	2.80
95	300323	华灿光电	1,863,077.00	2.80
96	301035	润丰股份	1,848,934.00	2.77
97	000672	上峰材料	1,841,766.56	2.76
98	002544	普天科技	1,834,829.00	2.75
99	301592	六九一二	1,825,389.00	2.74
100	600114	东睦股份	1,822,310.00	2.73
101	603505	金石资源	1,819,938.20	2.73
102	002498	汉缆股份	1,817,650.00	2.73
103	600292	电投水电	1,816,910.00	2.73
104	601101	昊华能源	1,815,668.26	2.72
105	300438	鹏辉能源	1,812,327.00	2.72
106	603327	福蓉科技	1,810,981.00	2.72
107	300409	道氏技术	1,796,975.00	2.70
108	300723	一品红	1,794,301.00	2.69
109	301392	汇成真空	1,791,534.00	2.69
110	000917	电广传媒	1,790,800.00	2.69
111	002073	软控股份	1,787,391.00	2.68
112	300098	高新兴	1,781,532.00	2.67
113	000923	河钢资源	1,778,159.00	2.67
114	600094	大名城	1,776,110.00	2.67
115	600654	中安科	1,774,262.00	2.66
116	301109	军信股份	1,774,028.00	2.66
117	300183	东软载波	1,773,508.00	2.66
118	601038	一拖股份	1,769,948.00	2.66
119	002091	江苏国泰	1,767,975.00	2.65
120	002488	金固股份	1,759,749.00	2.64
121	000612	焦作万方	1,737,896.00	2.61
122	603508	思维列控	1,737,316.00	2.61
123	300821	东岳硅材	1,730,034.00	2.60
124	300337	银邦股份	1,725,670.03	2.59

125	002192	融捷股份	1,715,542.00	2.57
126	002779	中坚科技	1,714,872.00	2.57
127	301297	富乐德	1,714,074.00	2.57
128	301029	怡合达	1,712,431.00	2.57
129	000966	长源电力	1,711,730.00	2.57
130	603883	老百姓	1,702,782.00	2.56
131	600619	海立股份	1,698,941.00	2.55
132	300075	数字政通	1,690,140.00	2.54
133	002151	北斗星通	1,685,968.00	2.53
134	600750	华润江中	1,682,184.00	2.52
135	600744	华银电力	1,675,007.42	2.51
136	600006	东风股份	1,673,201.00	2.51
137	002761	浙江建投	1,672,968.00	2.51
138	301458	钧崴电子	1,670,533.00	2.51
139	003039	顺控发展	1,669,884.00	2.51
140	601858	中国科传	1,668,159.00	2.50
141	601200	上海环境	1,662,907.04	2.50
142	300598	诚迈科技	1,660,406.82	2.49
143	002174	游族网络	1,659,747.00	2.49
144	301238	瑞泰新材	1,657,192.00	2.49
145	603613	国联股份	1,656,562.90	2.49
146	002338	奥普光电	1,656,211.00	2.49
147	300034	钢研高纳	1,653,087.00	2.48
148	603014	威高血净	1,652,989.00	2.48
149	000681	视觉中国	1,649,717.00	2.48
150	003006	百亚股份	1,643,387.00	2.47
151	000089	深圳机场	1,640,727.00	2.46
152	688332	中科蓝讯	1,631,824.94	2.45
153	300861	美畅股份	1,623,729.00	2.44
154	301031	中熔电气	1,618,680.00	2.43
155	002901	大博医疗	1,616,532.00	2.43
156	688549	中巨芯	1,612,088.64	2.42
157	000778	新兴铸管	1,611,374.00	2.42
158	002675	东诚药业	1,611,324.00	2.42
159	002690	美亚光电	1,607,616.00	2.41
160	688165	埃夫特	1,605,807.49	2.41
161	600388	龙净环保	1,604,749.00	2.41
162	300459	汤姆猫	1,601,903.00	2.40
163	002737	葵花药业	1,591,061.00	2.39
164	002077	大港股份	1,590,481.00	2.39
165	000828	东莞控股	1,569,368.00	2.36
166	301275	汉朔科技	1,564,555.00	2.35
167	002216	三全食品	1,551,328.00	2.33

168	000902	新洋丰	1,546,293.00	2.32
169	688107	安路科技	1,544,994.52	2.32
170	601801	皖新传媒	1,542,907.00	2.32
171	002847	盐津铺子	1,540,244.00	2.31
172	601678	滨化股份	1,539,645.49	2.31
173	002163	海南发展	1,538,035.00	2.31
174	300613	富瀚微	1,537,879.00	2.31
175	002378	章源钨业	1,530,933.00	2.30
176	301511	德福科技	1,529,970.00	2.30
177	600869	远东股份	1,523,803.00	2.29
178	688400	凌云光	1,522,894.49	2.29
179	300607	拓斯达	1,520,771.00	2.28
180	603583	捷昌驱动	1,514,372.00	2.27
181	688110	东芯股份	1,503,833.49	2.26
182	301263	泰恩康	1,496,866.00	2.25
183	600710	苏美达	1,494,149.00	2.24
184	301377	鼎泰高科	1,492,070.00	2.24
185	301678	新恒汇	1,483,905.00	2.23
186	600113	浙江东日	1,481,877.00	2.22
187	002906	华阳集团	1,478,591.00	2.22
188	300525	博思软件	1,471,169.00	2.21
189	688700	东威科技	1,469,424.89	2.21
190	300406	九强生物	1,469,287.00	2.20
191	600100	同方股份	1,469,170.00	2.20
192	300475	香农芯创	1,466,728.00	2.20
193	300049	福瑞医科	1,465,608.00	2.20
194	603328	依顿电子	1,464,131.00	2.20
195	601900	南方传媒	1,460,855.00	2.19
196	301339	通行宝	1,457,218.00	2.19
197	002745	木林森	1,456,176.00	2.19
198	000550	江铃汽车	1,456,106.00	2.19
199	688003	天准科技	1,451,001.39	2.18
200	600572	康恩贝	1,443,123.00	2.17
201	300775	三角防务	1,441,953.00	2.16
202	300634	彩讯股份	1,440,788.00	2.16
203	600903	贵州燃气	1,435,205.00	2.15
204	300620	光库科技	1,434,874.00	2.15
205	300244	迪安诊断	1,432,305.00	2.15
206	600827	百联股份	1,432,195.00	2.15
207	002534	西子洁能	1,428,844.00	2.14
208	601952	苏垦农发	1,427,650.00	2.14
209	600395	盘江股份	1,423,803.00	2.14
210	603013	亚普股份	1,419,349.00	2.13

211	300595	欧普康视	1,418,035.00	2.13
212	002925	盈趣科技	1,411,827.00	2.12
213	688586	江航装备	1,407,264.32	2.11
214	603057	紫燕食品	1,406,262.00	2.11
215	300685	艾德生物	1,405,550.00	2.11
216	002010	传化智联	1,401,441.00	2.10
217	002332	仙琚制药	1,398,280.00	2.10
218	300725	药石科技	1,396,400.00	2.10
219	301563	云汉芯城	1,395,174.76	2.09
220	688515	裕太微	1,394,859.61	2.09
221	001339	智微智能	1,390,250.00	2.09
222	301217	铜冠铜箔	1,379,633.00	2.07
223	600017	日照港	1,379,568.00	2.07
224	002373	千方科技	1,376,212.00	2.07
225	601500	通用股份	1,374,821.00	2.06
226	605599	菜百股份	1,371,411.00	2.06
227	002518	科士达	1,366,201.00	2.05
228	688559	海目星	1,364,178.11	2.05
229	300809	华辰装备	1,361,555.00	2.04
230	002345	潮宏基	1,357,519.00	2.04
231	600502	安徽建工	1,357,044.00	2.04
232	002079	苏州固锝	1,353,854.00	2.03
233	603072	天和磁材	1,349,984.00	2.03
234	000737	北方铜业	1,349,011.00	2.02
235	601068	中铝国际	1,346,468.00	2.02
236	688025	杰普特	1,345,818.86	2.02
237	600612	老凤祥	1,345,239.00	2.02
238	002292	奥飞娱乐	1,343,639.00	2.02
239	300153	科泰电源	1,340,970.00	2.01
240	002643	万润股份	1,339,782.00	2.01
241	000973	佛塑科技	1,336,477.00	2.01
242	603887	城地香江	1,336,143.00	2.01

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	603876	鼎胜新材	4,286,228.00	6.43
2	000848	承德露露	4,017,375.29	6.03
3	001309	德明利	3,994,870.00	5.99
4	000885	城发环境	3,583,221.00	5.38
5	000589	贵州轮胎	3,373,165.00	5.06
6	603915	国茂股份	3,278,856.40	4.92

7	600507	方大特钢	3,268,109.00	4.90
8	000682	东方电子	3,152,848.00	4.73
9	301606	绿联科技	3,120,511.00	4.68
10	300363	博腾股份	3,109,933.00	4.67
11	000028	国药一致	3,070,405.30	4.61
12	600267	海正药业	3,042,867.00	4.57
13	002545	东方铁塔	2,988,394.00	4.48
14	300257	开山股份	2,985,033.00	4.48
15	301215	中汽股份	2,981,014.76	4.47
16	603083	剑桥科技	2,960,161.88	4.44
17	002557	洽洽食品	2,895,413.33	4.34
18	300953	震裕科技	2,883,273.80	4.33
19	300841	康华生物	2,823,358.00	4.24
20	002354	天娱数科	2,799,523.00	4.20
21	601677	明泰铝业	2,780,736.00	4.17
22	301571	国科天成	2,773,730.00	4.16
23	601777	千里科技	2,765,868.00	4.15
24	600320	振华重工	2,742,950.00	4.12
25	301101	明月镜片	2,711,338.00	4.07
26	600552	凯盛科技	2,707,612.00	4.06
27	301377	鼎泰高科	2,677,307.00	4.02
28	600782	新钢股份	2,652,723.00	3.98
29	605020	永和股份	2,630,368.00	3.95
30	600686	金龙汽车	2,616,915.00	3.93
31	600353	旭光电子	2,574,424.00	3.86
32	002405	四维图新	2,563,191.00	3.85
33	301510	固高科技	2,543,904.00	3.82
34	000927	中国铁物	2,519,705.00	3.78
35	603100	川仪股份	2,519,326.00	3.78
36	300171	东富龙	2,477,455.00	3.72
37	603588	高能环境	2,476,398.00	3.72
38	688146	中船特气	2,475,708.59	3.72
39	301031	中熔电气	2,459,934.12	3.69
40	600201	生物股份	2,459,848.00	3.69
41	600033	福建高速	2,459,031.00	3.69
42	002588	史丹利	2,429,910.00	3.65
43	301267	华夏眼科	2,414,360.05	3.62
44	601126	四方股份	2,373,732.00	3.56
45	603383	顶点软件	2,351,973.68	3.53
46	002239	奥特佳	2,314,975.00	3.47
47	600717	天津港	2,292,198.00	3.44
48	603730	岱美股份	2,266,114.00	3.40
49	603505	金石资源	2,256,598.80	3.39

50	301458	钧崴电子	2,252,065.00	3.38
51	600292	电投水电	2,251,696.00	3.38
52	301487	盟固利	2,227,573.00	3.34
53	000581	威孚高科	2,220,953.00	3.33
54	688700	东威科技	2,185,209.28	3.28
55	601200	上海环境	2,182,178.00	3.27
56	002351	漫步者	2,166,843.00	3.25
57	600710	苏美达	2,154,313.00	3.23
58	000685	中山公用	2,150,057.00	3.23
59	600894	广日股份	2,120,194.00	3.18
60	600740	山西焦化	2,108,231.00	3.16
61	688182	灿勤科技	2,075,050.92	3.11
62	300475	香农芯创	2,063,050.00	3.10
63	000552	甘肃能化	2,061,478.00	3.09
64	301371	敷尔佳	2,053,356.80	3.08
65	002091	江苏国泰	2,049,098.00	3.07
66	603663	三祥新材	2,044,634.00	3.07
67	688779	五矿新能	2,034,889.36	3.05
68	300726	宏达电子	2,016,065.00	3.03
69	002690	美亚光电	2,009,428.00	3.02
70	300184	力源信息	1,978,331.00	2.97
71	603057	紫燕食品	1,977,751.00	2.97
72	603236	移远通信	1,975,937.00	2.97
73	002518	科士达	1,968,738.50	2.95
74	688522	纳睿雷达	1,962,410.35	2.94
75	301339	通行宝	1,954,511.00	2.93
76	600100	同方股份	1,949,198.00	2.92
77	300595	欧普康视	1,947,406.00	2.92
78	688127	蓝特光学	1,944,468.17	2.92
79	301219	腾远钴业	1,924,902.00	2.89
80	300738	奥飞数据	1,923,187.00	2.89
81	600420	国药现代	1,918,553.00	2.88
82	600361	创新新材	1,913,605.00	2.87
83	000089	深圳机场	1,898,227.00	2.85
84	301035	润丰股份	1,888,571.00	2.83
85	002073	软控股份	1,887,839.00	2.83
86	600094	大名城	1,882,653.00	2.83
87	600155	华创云信	1,877,553.00	2.82
88	600116	三峡水利	1,872,857.00	2.81
89	601858	中国科传	1,860,021.00	2.79
90	600654	中安科	1,859,761.00	2.79
91	300678	中科信息	1,856,968.00	2.79
92	301029	怡合达	1,846,285.00	2.77

93	002101	广东鸿图	1,842,692.00	2.77
94	300049	福瑞医科	1,841,891.00	2.76
95	000923	河钢资源	1,841,608.00	2.76
96	603025	大豪科技	1,831,683.00	2.75
97	301592	六九一二	1,827,967.00	2.74
98	002489	浙江永强	1,823,161.00	2.74
99	605198	安德利	1,818,387.00	2.73
100	301297	富乐德	1,815,968.00	2.73
101	000672	上峰材料	1,807,734.12	2.71
102	601801	皖新传媒	1,785,920.00	2.68
103	300409	道氏技术	1,776,728.00	2.67
104	002010	传化智联	1,770,268.00	2.66
105	688549	中巨芯	1,756,916.46	2.64
106	688503	聚和材料	1,755,857.68	2.63
107	600114	东睦股份	1,753,433.00	2.63
108	600572	康恩贝	1,752,459.00	2.63
109	301109	军信股份	1,750,898.00	2.63
110	002626	金达威	1,739,725.00	2.61
111	002516	旷达科技	1,731,465.00	2.60
112	600850	电科数字	1,728,769.00	2.59
113	002847	盐津铺子	1,723,635.20	2.59
114	603014	威高血净	1,722,361.00	2.58
115	603072	天和磁材	1,699,767.00	2.55
116	002544	普天科技	1,697,766.00	2.55
117	301238	瑞泰新材	1,696,004.00	2.55
118	000917	电广传媒	1,691,816.00	2.54
119	003006	百亚股份	1,684,371.00	2.53
120	603026	石大胜华	1,683,271.00	2.53
121	000543	皖能电力	1,663,601.00	2.50
122	603613	国联股份	1,659,335.20	2.49
123	300693	盛弘股份	1,642,179.00	2.46
124	300319	麦捷科技	1,638,844.00	2.46
125	300493	润欣科技	1,636,373.00	2.46
126	600388	龙净环保	1,634,916.00	2.45
127	002779	中坚科技	1,615,562.00	2.42
128	002675	东诚药业	1,614,785.00	2.42
129	300357	我武生物	1,614,542.00	2.42
130	002216	三全食品	1,611,481.60	2.42
131	601069	西部黄金	1,605,880.00	2.41
132	601033	永兴股份	1,604,072.00	2.41
133	300634	彩讯股份	1,603,827.00	2.41
134	600750	华润江中	1,601,726.00	2.40
135	300183	东软载波	1,601,696.00	2.40

136	003039	顺控发展	1,600,995.00	2.40
137	000902	新洋丰	1,594,736.00	2.39
138	688515	裕太微	1,592,820.63	2.39
139	300598	诚迈科技	1,588,490.00	2.38
140	300768	迪普科技	1,587,471.00	2.38
141	688048	长光华芯	1,581,586.69	2.37
142	600331	宏达股份	1,580,346.00	2.37
143	600125	铁龙物流	1,579,229.00	2.37
144	688690	纳微科技	1,576,565.56	2.37
145	002901	大博医疗	1,575,072.00	2.36
146	300620	光库科技	1,570,762.00	2.36
147	600458	时代新材	1,568,309.00	2.35
148	688498	源杰科技	1,566,592.66	2.35
149	600113	浙江东日	1,562,347.50	2.34
150	603638	艾迪精密	1,550,427.00	2.33
151	603508	思维列控	1,544,737.81	2.32
152	000828	东莞控股	1,540,775.00	2.31
153	688106	金宏气体	1,537,230.43	2.31
154	002906	华阳集团	1,535,220.00	2.30
155	300127	银河磁体	1,533,042.00	2.30
156	600338	西藏珠峰	1,515,529.00	2.27
157	002612	朗姿股份	1,512,902.00	2.27
158	000778	新兴铸管	1,501,436.00	2.25
159	600335	国机汽车	1,500,589.00	2.25
160	000550	江铃汽车	1,487,304.00	2.23
161	301217	铜冠铜箔	1,484,604.58	2.23
162	600827	百联股份	1,482,739.00	2.23
163	300926	博俊科技	1,482,116.00	2.22
164	605099	共创草坪	1,481,443.00	2.22
165	603328	依顿电子	1,470,476.00	2.21
166	688279	峰昭科技	1,470,323.38	2.21
167	002079	苏州固锟	1,461,252.00	2.19
168	688332	中科蓝讯	1,449,794.86	2.18
169	300398	飞凯材料	1,446,138.00	2.17
170	601952	苏垦农发	1,442,618.00	2.16
171	600395	盘江股份	1,432,780.00	2.15
172	002534	西子洁能	1,425,645.00	2.14
173	600210	紫江企业	1,419,175.00	2.13
174	300525	博思软件	1,411,062.00	2.12
175	601068	中铝国际	1,411,003.00	2.12
176	301263	泰恩康	1,409,244.00	2.11
177	002925	盈趣科技	1,404,861.00	2.11
178	000737	北方铜业	1,403,289.00	2.11

179	301345	涛涛车业	1,397,289.00	2.10
180	002747	埃斯顿	1,396,946.00	2.10
181	603826	坤彩科技	1,396,667.00	2.10
182	300657	弘信电子	1,395,714.00	2.09
183	688586	江航装备	1,394,536.16	2.09
184	688766	普冉股份	1,388,886.06	2.08
185	002292	奥飞娱乐	1,388,416.00	2.08
186	301678	新恒汇	1,386,286.00	2.08
187	600639	浦东金桥	1,383,408.00	2.08
188	002332	仙琚制药	1,377,404.00	2.07
189	002895	川恒股份	1,374,386.00	2.06
190	300861	美畅股份	1,371,998.00	2.06
191	600933	爱柯迪	1,371,711.00	2.06
192	603583	捷昌驱动	1,367,584.00	2.05
193	002911	佛燃能源	1,366,069.00	2.05
194	300244	迪安诊断	1,359,036.00	2.04
195	002345	潮宏基	1,358,792.00	2.04
196	600017	日照港	1,355,621.00	2.03
197	300406	九强生物	1,350,431.67	2.03
198	301015	百洋医药	1,345,323.00	2.02
199	301511	德福科技	1,333,347.00	2.00

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	771,185,112.85
卖出股票收入（成交）总额	730,945,874.73

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约定的备选股票库

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	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	53,208.84
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	53,208.84

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况。

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

本基金本报告期末未持有积极投资的股票。

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	201	5,248.49	18,771.40	1.78	1,036,174.21	98.22
明亚中证 1000 指数 增强 C	2,653	34,532.28	0.00	0.00	91,614,134.05	100.00
合计	2,854	32,469.89	18,771.40	0.02	92,650,308.26	99.98

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	11,437.28	1.0842
	明亚中证 1000 指数增强 C	59.36	0.0001
	合计	11,496.64	0.0124

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	987,231.58	53,801,877.97
本报告期基金总申购份额	2,040,105.65	107,979,650.72
减：本报告期基金总赎回份额	1,972,391.62	70,167,394.64
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,054,945.61	91,614,134.05

注：总申购份额含红利再投、转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

报告期内未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内，基金管理人无重大人事变动。

2026 年 1 月 14 日，本基金托管人招商证券股份有限公司免去赵斗斗担任的托管部总经理

职务，另有任用。

2026 年 1 月 14 日，本基金托管人招商证券股份有限公司聘牛中强担任托管部副总经理(主持工作)；2026 年 6 月 10 日，任托管部总经理。

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、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

报告期内，管理人无受调查或处罚等情况。

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

报告期内，管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，托管人无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

报告期内，托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过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(%)	
粤开证券	2	1,502,130,987.58	100.00	294,447.72	100.00	-
招商证券	2	-	-	-	-	-

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：

- (1) 资金雄厚，信誉良好，遵守国家及证券监管机构的各项法律法规、监管规定的要求；
- (2) 财务状况良好，经营行为规范，最近一年未因重大违规行为而受到有关管理机关的处罚；
- (3) 内部管理规范、严格，具备健全的内控制度，并能满足本公司基金运作高度保密的要求；
- (4) 具备基金运作所需的高效、安全的通讯条件，交易设施符合代理基金进行证券交易的需
要，并能为基金提供全面的信息服务；
- (5) 具有研究资质，研究实力较强；
- (6) 具备覆盖本公司基金投资方向和投资策略的适应能力及合作意愿。

本公司根据以上标准进行考察后确定证券公司的选择。首先研究部根据相关制度主导推进选择符合条件的证券公司，其次合规负责人对证券公司选择、协议签订、服务评价、交易佣金分配、投资运作管理，以及存续基金转换交易模式等进行合规性审查，最后由总经理审批，对于符合条件的证券公司，本公司与其签订委托协议。

10.7.2 基金租用或者通过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 (%)
粤开证券	-	-	12,900,000.00	100.00	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-

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	明亚中证 1000 指数增强型证券投资基金 2025 年第 4 季度报告	证监会指定网站、公司官网	2026 年 1 月 21 日
2	明亚基金管理有限责任公司关于旗下基金 2025 年 4 季度报告提示性公告	规定报刊	2026 年 1 月 21 日
3	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、公司官网、规定报刊	2026 年 2 月 10 日
4	明亚中证 1000 指数增强型证券投资基金基金产品资料概要及招募说明书更新提示性公告	规定报刊	2026 年 2 月 12 日
5	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（2026 年第一版）	证监会指定网站、公司官网	2026 年 2 月 12 日
6	明亚中证 1000 指数增强型证券投资	证监会指定网站、公司	2026 年 2 月 12 日

	基金招募说明书（更新）（2026 年第一版）	官网	
7	明亚中证 1000 指数增强型证券投资基金 2025 年年度报告	证监会指定网站、公司官网	2026 年 3 月 27 日
8	明亚基金管理有限责任公司关于旗下基金 2025 年年度报告提示性公告	规定报刊	2026 年 3 月 27 日
9	明亚基金管理有限责任公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025 年度）	证监会指定网站、公司官网、规定报刊	2026 年 3 月 30 日
10	明亚基金管理有限责任公司公开募集证券投资基金风险等级评价体系	公司官网	2026 年 4 月 2 日
11	明亚中证 1000 指数增强型证券投资基金 2026 年第 1 季度报告	证监会指定网站、公司官网	2026 年 4 月 21 日
12	明亚基金管理有限责任公司关于旗下基金 2026 年 1 季度报告提示性公告	规定报刊	2026 年 4 月 21 日
13	明亚基金管理有限责任公司关于旗下部分基金增加大连网金基金销售有限公司为代销机构的公告	公司官网	2026 年 4 月 22 日
14	2025 年度明亚基金管理有限责任公司以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	公司官网	2026 年 4 月 27 日
15	明亚基金管理有限责任公司关于旗下部分基金增加民生证券股份有限公司为代销机构的公告	公司官网	2026 年 4 月 28 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（%）
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，可能使基金资产净值受到不利影响，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。

注:本报告期内不存在单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

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、《明亚中证 1000 指数增强型证券投资基金产品资料概要》;
- 5、《明亚中证 1000 指数增强型证券投资基金招募说明书》;
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照。

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 1804B

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录基金管理人网站: 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

2026 年 8 月 27 日