

浙商中证 1000 指数增强型证券投资基金 2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人：浙商基金管理有限公司

基金托管人：招商银行股份有限公司

送出日期：2024 年 3 月 30 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人招商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 3 月 29 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

毕马威华振会计师事务所为本基金出具了无保留意见的审计报告。

本报告期自 2023 年 9 月 26 日（基金合同生效日）起至 2023 年 12 月 31 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、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§ 4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§ 5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	14
§ 6 审计报告	14
6.1 审计报告基本信息	14
6.2 审计报告的基本内容	14
§ 7 年度财务报表	16
7.1 资产负债表	16
7.2 利润表	17
7.3 净资产变动表	18
7.4 报表附注	20
§ 8 投资组合报告	48

8.1 期末基金资产组合情况	48
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	48
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	50
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	60
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	63
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	63
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	63
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	64
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	64
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	64
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	64
8.12 本报告期投资基金情况	64
8.13 投资组合报告附注	64
§ 9 基金份额持有人信息	65
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	65
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	65
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	66
9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况	66
§ 10 开放式基金份额变动	66
§ 11 重大事件揭示	67
11.1 基金份额持有人大会决议	67
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	67
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	67
11.4 基金投资策略的改变	67
11.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件	67
11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况	67
11.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	67
11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况	68
11.9 其他重大事件	71
§ 12 影响投资者决策的其他重要信息	72
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	72
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	72
§ 13 备查文件目录	72
13.1 备查文件目录	72
13.2 存放地点	72
13.3 查阅方式	73

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	浙商中证 1000 指数增强型证券投资基金	
基金简称	浙商中证 1000 指数增强	
基金主代码	018233	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023 年 9 月 26 日	
基金管理人	浙商基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	87,654,861.43 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	浙商中证 1000 指数增强 A	浙商中证 1000 指数增强 C
下属分级基金的交易代码	018233	018234
报告期末下属分级基金的份额总额	40,414,328.29 份	47,240,533.14 份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在指数化投资的基础上通过量化模型进行投资组合优化，在控制与业绩比较基准偏离风险的前提下，力争获得超越标的指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。本基金力争日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年跟踪误差不超过 7.75%。
投资策略	1、股票投资策略；2、债券投资策略；3、可转换债券投资策略；4、可交换债券投资策略；5、资产支持证券投资策略；6、股指期货投资策略；7、国债期货投资策略；8、融资业务投资策略；9、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%+人民币活期存款利率（税后）*5%
风险收益特征	本基金是股票指数增强型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其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。本基金可投资于港股通标的股票，需面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

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		浙商基金管理有限公司	招商银行股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	纪士鹏	张姗
	联系电话	021-60350878	400-61-95555
	电子邮箱	jishipeng@zsfund.com	zhangshan_1027@cmbchina.com

客户服务电话	4000-679-908/021-60359000	400-61-95555
传真	0571-28191919	0755-83195201
注册地址	浙江省杭州市下城区环城北路 208 号 1801 室	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
办公地址	上海市浦东新区陆家嘴西路 99 号万向大厦 10 楼	深圳市深南大道 7088 号招商银行大厦
邮政编码	310012	518040
法定代表人	肖风	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	http://www.zsfund.com
基金年度报告备置地点	基金管理人和基金托管人的住所

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市静安区南京西路 1266 号恒隆广场 2 幢 25 楼
注册登记机构	浙商基金管理有限公司	上海市浦东新区陆家嘴西路 99 号万向大厦 10 楼

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2023 年 9 月 26 日(基金合同生效日)-2023 年 12 月 31 日	
	浙商中证 1000 指数增强 A	浙商中证 1000 指数增强 C
本期已实现收益	503,590.38	565,873.05
本期利润	-711,392.31	1,053,220.84
加权平均基金份额本期利润	-0.0130	0.0070
本期加权平均净值利润率	-1.31%	0.70%
本期基金份额净值增长率	-2.43%	-2.54%
3.1.2 期末数据和指标	2023 年末	
期末可供分配利润	-982,226.23	-1,197,864.41

期末可供分配基金份额利润	-0.0243	-0.0254
期末基金资产净值	39,432,102.06	46,042,668.73
期末基金份额净值	0.9757	0.9746
3.1.3 累计期末指标	2023 年末	
基金份额累计净值增长率	-2.43%	-2.54%

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

浙商中证 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	-2.58%	0.80%	-2.98%	0.98%	0.40%	-0.18%
自基金合同生效起至今	-2.43%	0.78%	-2.19%	0.96%	-0.24%	-0.18%

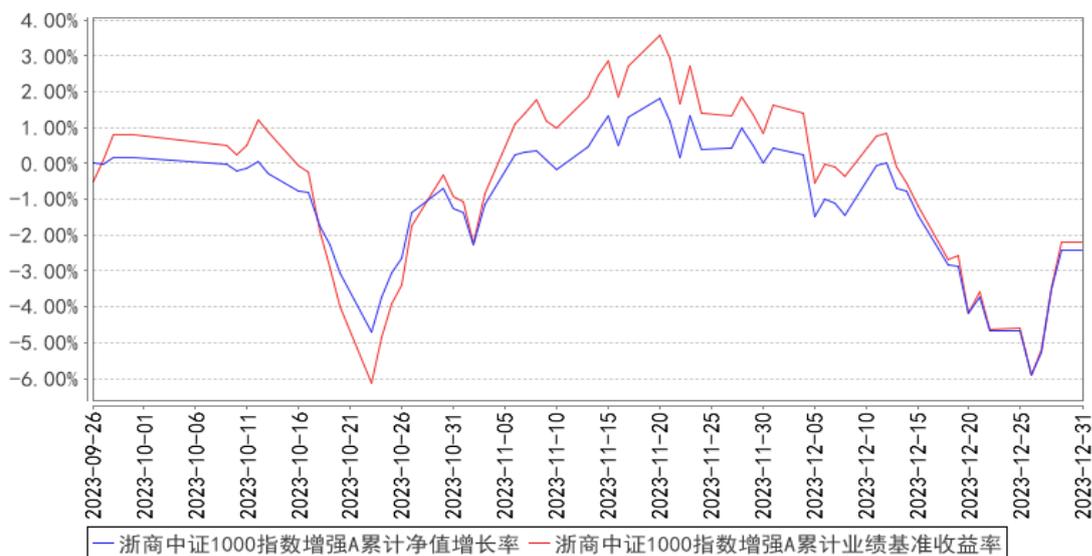
浙商中证 1000 指数增强 C

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	-2.68%	0.80%	-2.98%	0.98%	0.30%	-0.18%
自基金合同生效起至今	-2.54%	0.78%	-2.19%	0.96%	-0.35%	-0.18%

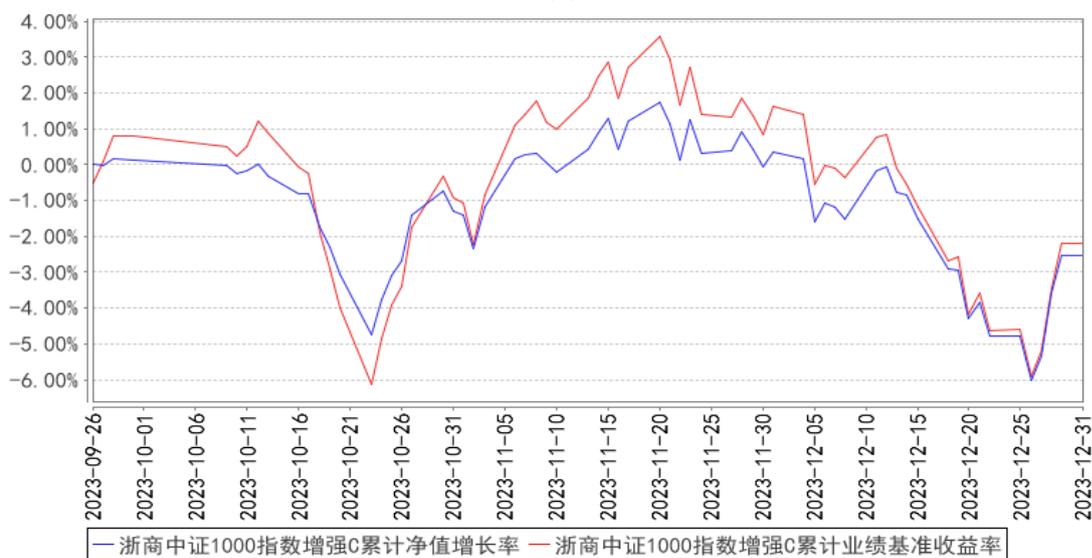
注：本基金业绩比较基准为：中证 1000 指数收益率*95%+人民币活期存款利率（税后）*5%。

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

浙商中证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



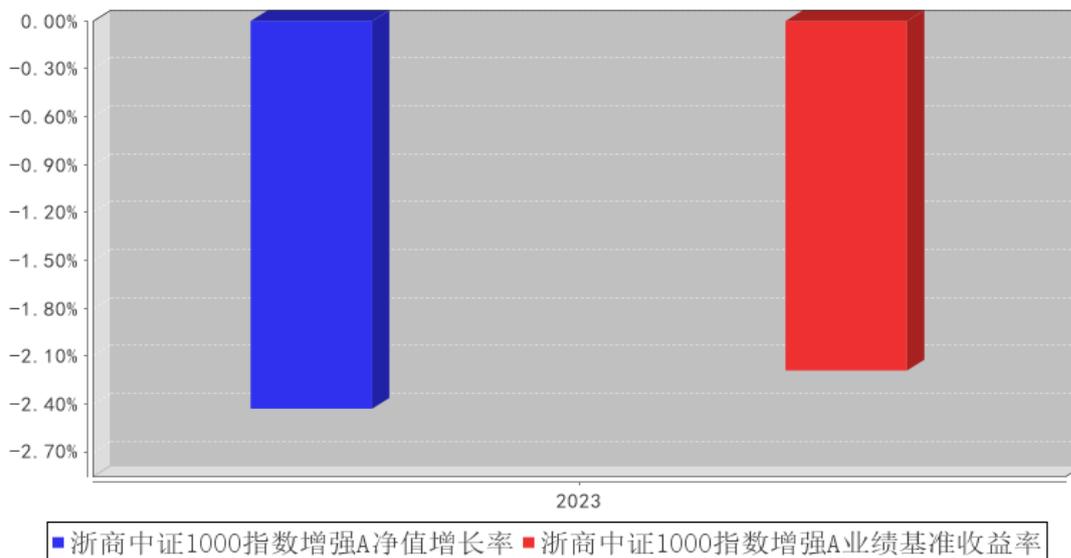
浙商中证1000指数增强C累计净值增长率与同期业绩比较基准收益率的历史走势对比图



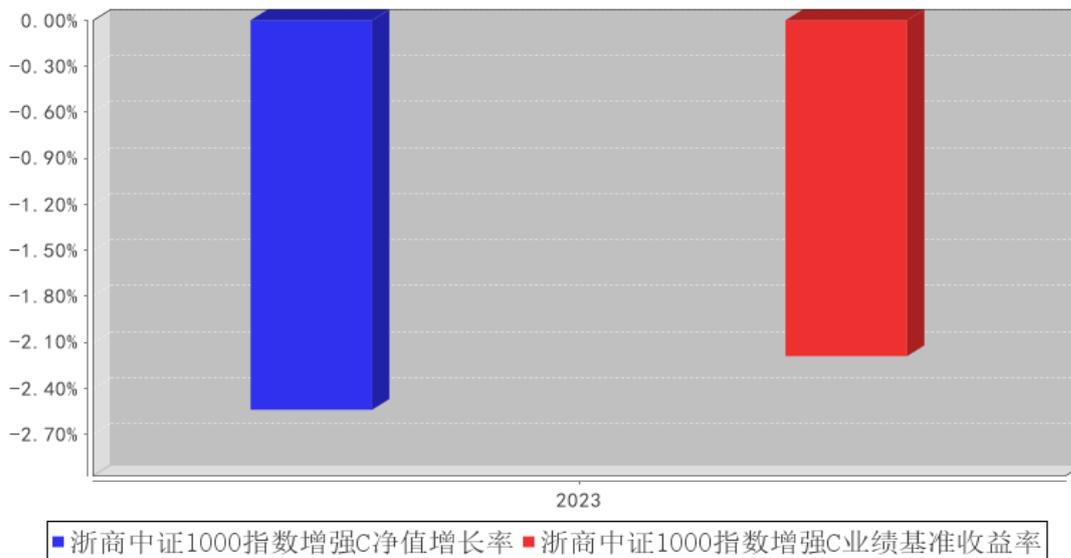
注：1、本基金基金合同生效日为 2023 年 9 月 26 日，基金合同生效日至本报告期末，本基金生效时间未满一年。

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

浙商中证1000指数增强A基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



浙商中证1000指数增强C基金每年净值增长率与同期业绩比较基准收益率的对比图



3.3 过去三年基金的利润分配情况

注：本基金自2023年9月26日(基金合同生效日)至2023年12月31日未进行利润分配。

§ 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

浙商基金管理有限公司经中国证券监督管理委员会(证监许可[2010]1312号)批准,于2010年10月21日成立。公司股东为民生人寿保险股份有限公司、浙商证券股份有限公司、养生堂有限公司。民生人寿保险股份有限公司出资15000万元,浙商证券股份有限公司和养生堂有限公司各出资7500万元,注册资本3亿元人民币。注册地为浙江省杭州市。

截至2023年12月31日,浙商基金共管理四十三只开放式基金——浙商聚潮产业成长混合型证券投资基金、浙商聚潮新思维混合型证券投资基金、浙商日添利货币市场基金、浙商惠丰定期开放债券型证券投资基金、浙商惠利纯债债券型证券投资基金、浙商惠裕纯债债券型证券投资基金、浙商惠南纯债债券型证券投资基金、浙商日添金货币市场基金、浙商大数据智选消费灵活配置混合型证券投资基金、浙商聚盈纯债债券型证券投资基金、浙商全景消费混合型证券投资基金、浙商沪深300指数增强型证券投资基金(LOF)、浙商丰利增强债券型证券投资基金、浙商兴永纯债三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、浙商中证500指数增强型证券投资基金、浙商沪港深精选混合型证券投资基金、浙商智能行业优选混合型发起式证券投资基金、浙商港股通中华交易服务预期高股息指数增强型证券投资基金、浙商惠盈纯债债券型证券投资基金、浙商丰顺纯债债券型证券投资基金、浙商丰裕纯债债券型证券投资基金、浙商惠泉3个月定期开放债券型证券投资基金、浙商惠睿纯债债券型证券投资基金、浙商智多兴稳健回报一年持有期混合型证券投资基金、浙商智多宝稳健一年持有期混合型证券投资基金、浙商中短债债券型证券投资基金、浙商惠隆39个月定期开放债券型证券投资基金、浙商科技创新一个月滚动持有混合型证券投资基金、浙商智选领航三年持有期混合型证券投资基金、浙商智选经济动能混合型证券投资基金、浙商智选食品饮料股票型发起式证券投资基金、浙商智选家居股票型发起式证券投资基金、浙商创业板指数增强型发起式证券投资基金、浙商智选价值混合型证券投资基金、浙商智多金稳健一年持有期混合型证券投资基金、浙商智多享稳健混合型发起式证券投资基金、浙商智选先锋一年持有期混合型证券投资基金、浙商兴盛一年定期开放债券型发起式证券投资基金、浙商智多盈债券型证券投资基金、浙商智选新兴产业混合型证券投资基金、浙商智配瑞享一年持有期债券型基金中基金(FOF)、浙商中证1000指数增强型证券投资基金、浙商兴盈6个月定期开放债券型证券投资基金。

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	证券从	说明
----	----	-----------	-----	----

		（助理）期限		业年限	
		任职日期	离任日期		
胡羿	本基金的基金经理，公司智能权益投资部基金经理	2023 年 9 月 26 日	-	9 年	胡羿先生，复旦大学金融专业硕士，曾任东海证券自营衍生品投资部量化研究员，五牛基金权益投资部量化研究员，雪松资产管理有限公司量化投资经理。

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

注：本报告期本基金不存在基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

4.1.4 基金经理薪酬机制

无

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内，基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和基金合同的约定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的前提下，为基金份额持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作整体合法合规，无损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

为了规范公平交易行为，保护投资者合法权益，根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金管理公司管理办法》、《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等法律法规规定，本公司制定了相应的公平交易制度。在投资决策层面，本公司实行投资决策委员会领导下的投资组合经理负责制，对不同类别的投资组合分别管理、独立决策；在交易层面，实行集中交易制度，建立了公平的交易分配制度，确保各投资组合享有公平的交易执行机会，严禁在不同投资组合之间进行利益输送；在监控和评估层面，本公司风险管理部将每日审查当天的投资交易，对不同投资组合在交易所公开竞价交易中同日同向交易的交易时机和交易价差进行监控，同时对不同投资组合临近交易日的同向交易和反向交易的交易时机和交易价差进行分析。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

本报告期内，本基金未发生违反公平交易制度的行为。

4.3.2.1 增加执行的基金经理公平交易制度执行情况及公平交易管理情况

无

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现异常交易行为。

公司旗下管理的各投资组合在交易所公开竞价同日反向交易的控制方面，未出现成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量 5% 的情况，亦未受到监管机构的相关调查。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金在报告期内，按照中证 1000 指数增强策略操作。本基金按照基金合同的要求，基于财务数据、量价数据、舆情数据等信息来源，利用 AI 模型整合高纬数据构建指数增强策略，力争达到产生相对基准超额收益的投资目的。同时，通过风险模型实现对各类风险暴露的数量化精细控制，利用基本面量化模型剔除潜在尾部风险较高的个股，通过持续优化模型来适应市场的持续变化，努力将基金的跟踪误差控制在较低水平下。

报告期内本基金完成了建仓操作，各类模型平稳运行。在策略配置上，本基金将继续配置一定比例的交易性策略，以捕捉短期的交易机会。此外，将继续完善利用 AI 模型，挖掘非标数据中的非线性信息，力争增加潜在超额收益来源。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至本报告期末，浙商中证 1000 指数增强 A 基金份额净值为 0.9757 元，成立以来基金份额净值增长率为-2.43%；浙商中证 1000 指数增强 C 基金份额净值为 0.9746 元，成立以来基金份额净值增长率为-2.54%；同期业绩比较基准收益率为-2.19%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2023 年 4 季度，A 股市场震荡下跌。国内经济延续底部恢复状态，经济数据逐步企稳但仍需继续改善。年底几次国内重要会议的召开，定调“稳中求进，以进促稳，先立后破”，再一次验证了当前“政策底”的判断。目前市场估值分位数依然较低、美联储预期进入降息区间等因素，也预示着“市场底”或将逐步形成。从风格角度来看，红利风格表现相对较优的状态有望延续。另外，成长风格当前已处于高赔率阶段。后续以相对均衡的风格配置，更多关注结构性机会，应对当前偏震荡的市场环境。同时，近期市值因子对市场影响较大，我们会延续在市值敞口端较为严格的控制，力争提升组合超额的稳定性。

当前中证 1000 的整体估值水平依然是处于历史低位，依然具有较强的配置价值。长期来看，中证 1000 作为以高成长潜力的中小型上市公司为主要成分股的指数，在未来经济复苏阶段有望显著收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人监察稽核工作重点是加强基金投资交易的风险控制，保证本基金投资运作的合法合规性。通过加大日常业务检查力度，对公司投研、营销、运作等业务进行专项检查，开展员工行为合规检查，进行投资研究、销售等业务的合规培训，来增强员工合规意识，促进公司业务的合规运作。

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

报告期内，本基金管理人严格按照中国证监会相关规定和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值，本基金托管人根据法律法规要求履行估值及净值计算的复核责任，会计师事务所在估值调整导致基金资产净值的变化在 0.25% 以上时对所采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。本基金管理人为了确保估值工作的合规开展，建立了负责估值工作的估值委员会，并制订了相关制度及流程。估值委员会主要负责基金估值相关工作的评估、决策、执行和监督，确保基金估值的公允与合理。公司估值委员会成员中不包括基金经理。报告期内，参与估值流程各方之间无重大利益冲突。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金在本报告期内未进行过利润分配。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内不存在对本基金持有人数或基金资产净值预警的情形。

§ 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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，我行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产

品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本年度报告中利润分配情况真实、准确。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本年度报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第 2401941 号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	浙商中证 1000 指数增强型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了后附的浙商中证 1000 指数增强型证券投资基金（以下简称“该基金”）财务报表，包括 2023 年 12 月 31 日的资产负债表、自 2023 年 9 月 26 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日止期间的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了该基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况以及自 2023 年 9 月 26 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则（以下简称“审计准则”）的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于该基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	该基金管理人浙商基金管理有限公司（以下简称“该基金管理人”）管理层对其他信息负责。其他信息包括该基金 2023

	<p>年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>该基金管理人管理层负责按照企业会计准则及财务报表附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时，该基金管理人管理层负责评估该基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项（如适用），并运用持续经营假设，除非该基金预计在清算时资产无法按照公允价值处置。</p> <p>该基金管理人治理层负责监督该基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3) 评价该基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4) 对该基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对该基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意</p>

	见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致该基金不能持续经营。 (5) 评价财务报表的总体列报（包括披露）、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。 我们与该基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	张楠 朱鹏飞
会计师事务所的地址	上海市静安区南京西路 1266 号恒隆广场 2 幢 25 楼
审计报告日期	2024 年 03 月 29 日

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：浙商中证 1000 指数增强型证券投资基金

报告截止日：2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023 年 12 月 31 日
资产：		
货币资金	7.4.7.1	1,828,621.36
结算备付金		1,940,350.16
存出保证金		82,712.72
交易性金融资产	7.4.7.2	82,291,472.56
其中：股票投资		78,159,778.57
基金投资		-
债券投资		4,131,693.99
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
债权投资	7.4.7.5	-
其中：债券投资		-
资产支持证券投资		-
其他投资		-
其他债权投资	7.4.7.6	-
其他权益工具投资	7.4.7.7	-
应收清算款		341,331.04
应收股利		-

应收申购款		152,049.56
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.8	-
资产总计		86,636,537.40
负债和净资产	附注号	本期末 2023年12月31日
负债:		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		-
应付赎回款		185,498.79
应付管理人报酬		94,087.54
应付托管费		15,681.23
应付销售服务费		17,609.36
应付投资顾问费		-
应交税费		0.11
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.9	848,889.58
负债合计		1,161,766.61
净资产:		
实收基金	7.4.7.10	87,654,861.43
其他综合收益	7.4.7.11	-
未分配利润	7.4.7.12	-2,180,090.64
净资产合计		85,474,770.79
负债和净资产总计		86,636,537.40

注：报告截止日 2023 年 12 月 31 日，浙商中证 1000 指数增强 A 份额净值 0.9757 元，基金份额总额 40,414,328.29 份，浙商中证 1000 指数增强 C 份额净值 0.9746 元，基金份额总额 47,240,533.14 份，总份额合计 87,654,861.43 份。

7.2 利润表

会计主体：浙商中证 1000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2023 年 9 月 26 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年9月26日（基金合同 生效日）至2023年12月31 日
一、营业总收入		1,418,624.46
1. 利息收入		309,526.81

其中：存款利息收入	7.4.7.13	262,156.40
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		47,370.41
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		1,739,689.17
其中：股票投资收益	7.4.7.14	2,138,980.97
基金投资收益	7.4.7.15	-
债券投资收益	7.4.7.16	60,759.30
资产支持证券投资收益	7.4.7.17	-
贵金属投资收益	7.4.7.18	-
衍生工具收益	7.4.7.19	-526,250.99
股利收益	7.4.7.20	66,199.89
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.21	-727,634.90
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.22	97,043.38
减：二、营业总支出		1,076,795.93
1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	662,804.88
其中：暂估管理人报酬		-
2. 托管费	7.4.10.2.2	110,467.48
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	163,257.29
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		1,530.08
其中：卖出回购金融资产支出		1,530.08
6. 信用减值损失	7.4.7.24	-
7. 税金及附加		0.03
8. 其他费用	7.4.7.25	138,736.17
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		341,828.53
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		341,828.53
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		341,828.53

7.3 净资产变动表

会计主体：浙商中证 1000 指数增强型证券投资基金

本报告期：2023 年 9 月 26 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 9 月 26 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 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	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产	290,070,261.48	-	-	290,070,261.48
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-202,415,400.05	-	-2,180,090.64	-204,595,490.69
（一）、综合收益总额	-	-	341,828.53	341,828.53
（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）	-202,415,400.05	-	-2,521,919.17	-204,937,319.22
其中：1. 基金申购款	2,533,286.07	-	-24,424.52	2,508,861.55
2. 基金赎回款	-204,948,686.12	-	-2,497,494.65	-207,446,180.77
（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）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	87,654,861.43	-	-2,180,090.64	85,474,770.79

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告 7.1 至 7.4 财务报表由下列负责人签署：

王波

基金管理人负责人

王波

主管会计工作负责人

王波

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

浙商中证 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”）《关于准予浙商中证 1000 指数增强型证券投资基金注册的批复》（证监许可[2023]487 号）批准，由浙商基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法规和《浙商中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》发售，基金合同于 2023 年 9 月 26 日生效。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为浙商基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司（以下简称“招商银行”）。

本基金自 2023 年 8 月 28 日至 2023 年 9 月 22 日止期间募集，募集期间净认购资金人民币 290,054,059.05 元，孳生利息人民币 16,202.43 元，募集的有效认购份额及利息结转的基金份额合计 290,070,261.48 份。其中 A 类有效认购资金人民币 64,478,739.55 元，孳生利息人民币 5,455.55 元，折合 64,484,195.10 份本基金 A 类份额；C 类有效认购资金人民币 225,575,319.50 元，孳生利息人民币 10,746.88 元，折合 225,586,066.38 份本基金 C 类份额。上述募集资金已由毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)验证，并出具了毕马威华振验字第 2300911 号验资报告。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法规、《浙商中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》和《浙商中证 1000 指数增强型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括标的指数成份股及其备选成份股、其他国内依法发行上市的股票（含创业板、存托凭证及其他中国证监会允许基金投资的股票）、港股通标的股票、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、地方政府债券、政府支持机构债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、衍生品（包括股指期货、国债期货）、资产支持证券、同业存单、债券回购、货币市场工具、银行存款以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金可根据法律法规的规定参与融资、转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的 80%，港股通标的股票的投资比例为股票资产的 0%-20%，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、国债期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券投资比例不低于基金

资产净值的 5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或中国证监会变更上述投资品种的比例限制，基金管理人、基金托管人书面协商一致并履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准为：中证 1000 指数收益率 \times 95%+人民币活期存款利率(税后) \times 5%。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金财务报表以持续经营为基础编制。

本基金财务报表符合中华人民共和国财政部(以下简称“财政部”)颁布的企业会计准则和《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称“企业会计准则”)的要求，同时亦按照中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露 XBRL 模板第 3 号<年度和中期报告>》以及中国证券投资基金业协会于 2012 年 11 月 16 日颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》编制财务报表。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金财务报表符合财政部颁布的企业会计准则及附注 7.4.2 中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定的要求，真实、完整地反映了本基金 2023 年 12 月 31 日的财务状况、自 2023 年 9 月 26 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日止期间的经营成果和净资产变动情况。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金的会计年度自公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为自 2023 年 9 月 26 日(基金合同生效日)至 2023 年 12 月 31 日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币，编制财务报表采用的货币为人民币。本基金选定记账本位币的依据是主要业务收支的计价和结算币种。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(a) 金融资产的分类

本基金的金融工具包括股票投资、债券投资等。

本基金通常根据管理金融资产的业务模式和金融资产的合同现金流量特征，在初始确认时将金融资产分为不同类别：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以摊余成本计量的金融资产。

除非本基金改变管理金融资产的业务模式，在此情形下，所有受影响的相关金融资产在业务模式发生变更后的首个报告期间的第一天进行重分类，否则金融资产在初始确认后不得进行重分

类。

本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；
- 该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。本基金现无分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

管理金融资产的业务模式，是指本基金如何管理金融资产以产生现金流量。业务模式决定本基金所管理金融资产现金流量的来源是收取合同现金流量、出售金融资产还是两者兼有。本基金以客观事实为依据、以关键管理人员决定的对金融资产进行管理的特定业务目标为基础，确定管理金融资产的业务模式。

本基金对金融资产的合同现金流量特征进行评估，以确定相关金融资产在特定日期产生的合同现金流量是否仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。其中，本金是指金融资产在初始确认时的公允价值；利息包括对货币时间价值、与特定时期未偿付本金金额相关的信用风险、以及其他基本借贷风险、成本和利润的对价。此外，本基金对可能导致金融资产合同现金流量的时间分布或金额发生变更的合同条款进行评估，以确定其是否满足上述合同现金流量特征的要求。

(b) 金融负债的分类

本基金将金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及以摊余成本计量的金融负债。

- 以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

该类金融负债包括交易性金融负债（含属于金融负债的衍生工具）和指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

- 以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

本基金现无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

(a) 金融工具的初始确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

(b) 后续计量

-以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失（包括利息和股利收入）计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

-以摊余成本计量的金融资产

初始确认后，对于该类金融资产采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

-以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债以公允价值进行后续计量，除与套期会计有关外，产生的利得或损失（包括利息费用）计入当期损益。

-以摊余成本计量的金融负债

初始确认后，对于该类金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。

(c) 金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；
- 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产在终止确认日的账面价值；
- 因转移金融资产而收到的对价。

金融负债（或其一部分）的现时义务已经解除的，本基金终止确认该金融负债（或该部分金融负债）。

(d) 金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对下列项目进行减值会计处理并确认损失准备：

-以摊余成本计量的金融资产

本基金持有的其他以公允价值计量的金融资产不适用预期信用损失模型。

预期信用损失的计量

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

在计量预期信用损失时，本基金需考虑的最长期限为面临信用风险的最长合同期限（包括考虑续约选择权）。

整个存续期预期信用损失，是指因金融工具整个预计存续期内所有可能发生的违约事件而导致的预期信用损失。

未来 12 个月内预期信用损失，是指因资产负债表日后 12 个月内（若金融工具的预计存续期少于 12 个月，则为预计存续期）可能发生的金融工具违约事件而导致的预期信用损失，是整个存续期预期信用损失的一部分。

本基金对满足下列情形的金融工具按照相当于未来 12 个月内预期信用损失的金额计量其损失准备，对其他金融工具按照相当于整个存续期内预期信用损失的金额计量其损失准备：

-该金融工具在资产负债表日只具有较低的信用风险；或

-该金融工具的信用风险自初始确认后并未显著增加。

预期信用损失准备的列报

为反映金融工具的信用风险自初始确认后的变化，本基金在每个资产负债表日重新计量预期信用损失，由此形成的损失准备的增加或转回金额，应当作为减值损失或利得计入当期损益。对于以摊余成本计量的金融资产，损失准备抵减该金融资产在资产负债表中列示的账面价值。

核销

如果本基金不再合理预期金融资产合同现金流量能够全部或部分收回，则直接减记该金融资产的账面余额。这种减记构成相关金融资产的终止确认。这种情况通常发生在本基金确定债务人没有资产或收入来源可产生足够的现金流量以偿还将被减记的金额。但是，被减记的金融资产仍可能受到本基金催收到期款项相关执行活动的影响。

已减记的金融资产以后又收回的，作为减值损失的转回计入收回当期的损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

除特别声明外，本基金按下述原则计量公允价值：

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据企业会计准则的规定采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

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

如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似金融工具的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

金融资产和金融负债在资产负债表内分别列示，没有相互抵销。但是，同时满足下列条件的，以相互抵销后的净额在资产负债表内列示：

- 本基金具有抵销已确认金额的法定权利，且该种法定权利是当前可执行的；
- 本基金计划以净额结算，或同时变现该金融资产和清偿该金融负债。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金份额变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金核算在基金份额发生变动时，申购、赎回、转入、转出及红利再投资等款项中包

含的未分配利润和公允价值变动损益，包括已实现损益平准金和未实现损益平准金。已实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现损益平准金指根据交易申请日申购或赎回款项中包含的按累计未分配的未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日进行确认和计量，并于会计期末全额转入未分配利润。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

投资收益

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其初始计量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资，在其持有期间，按票面金额和票面利率计算的利息计入投资收益。

公允价值变动收益

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且变动计入当期损益的金融资产、衍生工具、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。不包括本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资在持有期间按票面利率计算的利息。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准。若基金合同生效不满 3 个月可不进行收益分配；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；基金收益分配后各类基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的各类基金份额净值减去每单位该类基金份额收益分配金额后不能低于面值；由于本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额收取销售服务费，各基金份额类别对应的可供分配利润将有所不同，本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。在不违反法律法规、基金合同的约定以及对基金份额持有人利益无实质性不利影响的情况下，基金管理人可调整基金收益的分配原则和支付方式，不需召开基金份额持有人大会审议。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

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

7.4.4.13 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。

本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

编制财务报表时，本基金需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入和支出的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本基金对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

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

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，根据中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《关于固定收益品种的估值处理标准》在银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所及中国证券监督管理委员会认可的其他交易场所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值基准服务机构提供的价格数据进

行估值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期内未发生重大会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、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》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、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》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《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》、财税[2017]2号文《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》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

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

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。

b) 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。

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

c)对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）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。

d)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。自 2023 年 8 月 28 日起，证券交易印花税实施减半征收。

e)对基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育费附加。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日
活期存款	1,828,621.36
等于：本金	1,828,390.81
加：应计利息	230.55
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	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	1,828,621.36

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	78,888,493.47	-	78,159,778.57	-728,714.90	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	4,074,220.00	56,393.99	4,131,693.99	1,080.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	4,074,220.00	56,393.99	4,131,693.99	1,080.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	82,962,713.47	56,393.99	82,291,472.56	-727,634.90	

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

注：本基金于本报告期末未持有任何衍生金融资产/负债。

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

注：本基金于本报告期末未持有任何期货合约。

7.4.7.3.3 期末基金持有的黄金衍生品情况

注：本基金于本报告期末未持有任何黄金衍生品。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

注：本基金于本报告期末未持有任何买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

注：本基金于本报告期末未持有任何买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.4.3 按预期信用损失一般模型计提减值准备的说明

本基金本报告期无按预期信用损失一般模型计提减值准备。

7.4.7.5 债权投资

7.4.7.5.1 债权投资情况

注：本基金于本报告期末未持有债权投资。

7.4.7.5.2 债权投资减值准备计提情况

注：本基金于本报告期无债权投资减值准备。

7.4.7.6 其他债权投资

7.4.7.6.1 其他债权投资情况

注：本基金于本报告期末未持有其他债权投资。

7.4.7.6.2 其他债权投资减值准备计提情况

注：本基金于本报告期末无其他债权投资减值准备。

7.4.7.7 其他权益工具投资

7.4.7.7.1 其他权益工具投资情况

注：本基金于本报告期末未持有其他权益工具。

7.4.7.7.2 报告期末其他权益工具投资情况

注：本基金于本报告期末未持有其他权益工具。

7.4.7.8 其他资产

注：本基金于本报告期末未持有其他资产。

7.4.7.9 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 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	713,889.58
其中：交易所市场	713,889.58
银行间市场	-
应付利息	-
预提审计费	35,000.00
预提信息披露费	100,000.00
合计	848,889.58

7.4.7.10 实收基金

金额单位：人民币元

浙商中证 1000 指数增强 A

项目	本期 2023 年 9 月 26 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	64,484,195.10	64,484,195.10

本期申购	1,500,244.81	1,500,244.81
本期赎回（以“-”号填列）	-25,570,111.62	-25,570,111.62
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	40,414,328.29	40,414,328.29

浙商中证 1000 指数增强 C

项目	本期 2023 年 9 月 26 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	225,586,066.38	225,586,066.38
本期申购	1,033,041.26	1,033,041.26
本期赎回（以“-”号填列）	-179,378,574.50	-179,378,574.50
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	47,240,533.14	47,240,533.14

7.4.7.11 其他综合收益

注：本基金本报告期内无其他综合收益。

7.4.7.12 未分配利润

单位：人民币元

浙商中证 1000 指数增强 A

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	503,590.38	-1,214,982.69	-711,392.31
本期基金份额交易产生的变动数	-94,679.10	-176,154.82	-270,833.92
其中：基金申购款	33,717.58	-38,674.61	-4,957.03
基金赎回款	-128,396.68	-137,480.21	-265,876.89
本期已分配利润	-	-	-
本期末	408,911.28	-1,391,137.51	-982,226.23

浙商中证 1000 指数增强 C

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-

加：会计政策变更	-	-	-
前期差错更正	-	-	-
其他	-	-	-
本期期初	-	-	-
本期利润	565,873.05	487,347.79	1,053,220.84
本期基金份额交易产生的变动数	-138,605.33	-2,112,479.92	-2,251,085.25
其中：基金申购款	19,422.63	-38,890.12	-19,467.49
基金赎回款	-158,027.96	-2,073,589.80	-2,231,617.76
本期已分配利润	-	-	-
本期末	427,267.72	-1,625,132.13	-1,197,864.41

7.4.7.13 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年9月26日（基金合同生效日）至2023年12月31日
活期存款利息收入	23,226.90
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	238,735.81
其他	193.69
合计	262,156.40

注：其他列示的是结算保证金利息收入。

7.4.7.14 股票投资收益

7.4.7.14.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2023年9月26日（基金合同生效日）至2023年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	2,138,980.97
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	2,138,980.97

7.4.7.14.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年9月26日（基金合同生效日）至2023年12月31日

	月 31 日
卖出股票成交总额	480,724,022.56
减：卖出股票成本总额	477,487,727.04
减：交易费用	1,097,314.55
买卖股票差价收入	2,138,980.97

7.4.7.14.3 股票投资收益——证券出借差价收入

注：本基金在本报告期内无股票投资收益-证券出借差价收入。

7.4.7.15 基金投资收益

注：本基金在本报告期内无基金投资收益。

7.4.7.16 债券投资收益

7.4.7.16.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年9月26日（基金合同生效日）至2023年12月31日
债券投资收益——利息收入	42,029.19
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	18,730.11
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	60,759.30

7.4.7.16.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年9月26日（基金合同生效日）至2023年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	10,284,550.55
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	10,147,300.00
减：应计利息总额	118,520.44
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	18,730.11

7.4.7.16.3 债券投资收益——赎回差价收入

注：本基金在本报告期内无债券投资收益-赎回差价收入。

7.4.7.16.4 债券投资收益——申购差价收入

注：本基金在本报告期内无债券投资收益-申购差价收入。

7.4.7.17 资产支持证券投资收益

7.4.7.17.1 资产支持证券投资收益项目构成

注：本基金在本报告期内无资产支持证券投资收益。

7.4.7.17.2 资产支持证券投资收益——买卖资产支持证券差价收入

注：本基金在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。

7.4.7.17.3 资产支持证券投资收益——赎回差价收入

注：本基金在本报告期内无资产支持证券投资收益-赎回差价收入。

7.4.7.17.4 资产支持证券投资收益——申购差价收入

注：本基金在本报告期内无资产支持证券投资收益-申购差价收入。

7.4.7.18 贵金属投资收益

7.4.7.18.1 贵金属投资收益项目构成

注：本基金在本报告期内无贵金属投资收益。

7.4.7.18.2 贵金属投资收益——买卖贵金属差价收入

注：本基金在本报告期内无贵金属投资收益-买卖贵金属差价收入。

7.4.7.18.3 贵金属投资收益——赎回差价收入

注：本基金在本报告期内无贵金属投资收益-赎回差价收入。

7.4.7.18.4 贵金属投资收益——申购差价收入

注：本基金在本报告期内无贵金属投资收益-申购差价收入。

7.4.7.19 衍生工具收益

7.4.7.19.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

注：本基金在本报告期内无衍生工具收益-买卖权证差价收入。

7.4.7.19.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 9 月 26 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
股指期货投资收益	-526,250.99

7.4.7.20 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2023 年 9 月 26 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
股票投资产生的股利收益	66,199.89
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	66,199.89

7.4.7.21 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023 年 9 月 26 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
1. 交易性金融资产	-727,634.90
股票投资	-728,714.90
债券投资	1,080.00
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	-727,634.90

7.4.7.22 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023 年 9 月 26 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
基金赎回费收入	97,043.38
合计	97,043.38

7.4.7.23 持有基金产生的费用

注：本基金在本报告期内无持有基金产生的费用。

7.4.7.24 信用减值损失

注：本基金在本报告期内无信用减值损失。

7.4.7.25 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023 年 9 月 26 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日
审计费用	35,000.00
信息披露费	100,000.00
证券出借违约金	-
其他	400.00
银行汇划费	3,336.17
合计	138,736.17

7.4.7.26 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部。本基金目前以一个经营分部运作，不需要进行分部报告的披露。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报告批准报出日，本基金没有需要在财务报表附注中说明的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
浙商基金管理有限公司（“浙商基金”）	基金管理人、注册登记机构、基金销售机构
招商银行股份有限公司（“招商银行”）	基金托管人、基金销售机构
浙商证券股份有限公司（“浙商证券”）	基金管理人的股东
民生人寿保险股份有限公司（“民生人寿”）	基金管理人的股东
养生堂有限公司	基金管理人的股东
上海聚潮资产管理有限公司（“聚潮资管”）	基金管理人的子公司

注：本报告期内存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

注：本基金在本报告期内没有通过关联方的交易单元进行过股票交易。

7.4.10.1.2 债券交易

注：本基金在本报告期内没有通过关联方的交易单元进行过债券交易。

7.4.10.1.3 债券回购交易

注：本基金在本报告期内没有通过关联方的交易单元进行过回购交易。

7.4.10.1.4 基金交易

注：本基金在本报告期内没有通过关联方的交易单元进行过基金交易。

7.4.10.1.5 权证交易

注：本基金在本报告期内没有通过关联方的交易单元进行过权证交易。

7.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

注：本基金在本报告期内没有应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年9月26日（基金合同生效日）至2023年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	662,804.88
其中：应支付销售机构的客户维护费	196,405.81
应支付基金管理人的净管理费	466,399.07

注：支付基金管理人浙商基金的基金管理费按前一日基金资产净值 1.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

$$\text{日基金管理费} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.20\% / \text{当年天数}$$

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年9月26日（基金合同生效日）至2023年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	110,467.48

注：支付基金托管人招商银行的基金托管费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。计算公式为：

$$\text{日基金托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}$$

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方	本期

名称	2023 年 9 月 26 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	浙商中证 1000 指数增 强 A	浙商中证 1000 指数增 强 C	合计
浙商基金	-	24,299.00	24,299.00
招商银行	-	13,430.66	13,430.66
合计	-	37,729.66	37,729.66

注：本基金 A 类基金份额不收取销售服务费。支付销售机构的基金销售服务费按前一日 C 类资产净值 0.40% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。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

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

注：本基金在本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。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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

注：本基金在本报告期内未与关联方通过约定申报方式进行适用固定期限费率的证券出借业务。

7.4.10.4.2 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

注：本基金在本报告期内未与关联方通过约定申报方式进行适用市场化期限费率的证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

注：本基金的基金管理人在本期间未持有本基金。

7.4.10.5.2 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

注：除基金管理人之外的其他关联方在本报告期末未持有本基金。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023 年 9 月 26 日（基金合同生效日）至 2023 年 12 月 31 日	
	期末余额	当期利息收入
	招商银行	1,828,621.36

注：本基金通过“招商银行基金托管结算资金专用存款账户”转存于中国证券登记结算有限责任

公司的结算备付金，于 2023 年 12 月 31 日的相关余额为人民币 1,234,719.18 元。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

注：本基金在本报告期内未在承销期内购入过由关联方承销的证券。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

7.4.10.8.1 其他关联交易事项的说明

上述关联交易均根据正常的商业交易条件进行，并以一般交易价格为定价基础。

7.4.10.8.2 当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用

注：本基金在本报告期内无当期交易及持有基金管理人以及管理人关联方所管理基金产生的费用。

7.4.11 利润分配情况

注：本基金在本报告期内未进行过利润分配。

7.4.12 期末（2023 年 12 月 31 日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
113069	博 23 转债	2023 年 12 月 22 日	27 天	新债未上市	100.00	100.01	710	71,000.00	71,004.67	-
127100	神码转债	2023 年 12 月 21 日	29 天	新债未上市	100.00	100.01	39	3,900.00	3,900.28	-

注：根据中国证监会相关规定，证券投资基金参与网下配售，可与发行人、承销商自主约定网下配售股票的持有期限并公开披露。持有期自公开发行的股票上市之日起计算。在持有期内的股票为流动受限制而不能自由转让的资产。证券投资基金获配的科创板股票及创业板股票需要锁定的，锁定期根据相关法规及交易所相关规定执行。证券投资基金还可作为特定投资者，认购由中国证监会规范的非公开发行股票，所认购的股票自发行结束之日起在法规规定的限售期内不得转让。证券投资基金对上述非公开发行股票的减持还需根据交易所相关规定执行。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	------	------	------	--------	------	-------	-------	--------	--------	----

688337	普源精电	2023年12月25日	重大事项停牌	43.87	2024年01月09日	41.72	2,500	110,068.00	109,675.00	-
000657	中钨高新	2023年12月26日	重大事项停牌	8.48	2024年01月10日	9.33	9,200	75,864.00	78,016.00	-

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

注：于 2023 年 12 月 31 日，本基金未持有因债券正回购交易而作为抵押的银行间债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

于 2023 年 12 月 31 日，本基金未持有因债券正回购交易而作为抵押的交易所债券。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

注：于 2023 年 12 月 31 日，本基金未持有参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金在日常活动中面临各种金融工具的风险，主要包括：

- 信用风险
- 流动性风险
- 市场风险

本基金管理人制定了政策和程序来识别及分析这些风险，并设定适当的风险限额及内部控制流程，通过可靠的管理及信息系统持续监控上述各类风险。

本基金的基金管理人建立了以合规与风险控制委员会为核心的，由总经理、风险控制委员会、督察长、监察稽核部和相关业务部门构成的多层次风险管理架构体系。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，在董事会下设立合规与风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；督察长独立行使权利，直接对董事会负责，向合规与风险控制委员会提交独立的监察稽核报告和建议；在管理层层面设立风险控制委员会，讨论和制定公司日常经营过程中风险防范和控制措施；在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部负责，协调并与各部门合作完成运作风险管理以及进行投资风险分析与绩效评估。监察稽核部对公司总经理负责。

本基金管理人主要通过定性分析和定量分析的方法，估测各种金融工具风险可能产生的损失。

本基金管理人从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重性；从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用的金融工具特征，通过特定的风险量化指标、模型、日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时对各种风险进行监督、检查和评估，并制定相应决策，将风险控制在预期可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，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，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的银行存款存放在本基金的托管行招商银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，本基金投资于具有良好信用等级的证券，且通过分散化投资以分散信用风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。

本基金在交易所进行的交易均与中国证券登记结算有限责任公司完成证券交收和款项清算，因此违约风险发生的可能性很小；本基金在进行银行间同业市场交易前均对交易对手进行信用评估并采用券款对付交割方式以控制相应的信用风险。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023 年 12 月 31 日
A-1	-
A-1 以下	-
未评级	4,056,789.04
合计	4,056,789.04

注：上述表格列示的未评级债券为国债。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金于本期末未持有短期资产支持证券投资。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金于本期末未持有短期同业存单投资。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023 年 12 月 31 日
AAA	-
AAA 以下	74,904.95
未评级	-

合计	74,904.95
----	-----------

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

注：本基金于本期末未持有长期资产支持证券投资。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

注：本基金于本期末未持有长期同业存单投资。

7.4.13.3 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，另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。

本基金所持有的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（净资产）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 金融资产和金融负债的到期期限分析

7.4.13.3.2 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严格按照《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等有关法规的要求建立健全开放式基金流动性风险管理的内部控制体系，审慎评估各类资产的流动性，针对性制定流动性风险管理措施，对本基金组合资产的流动性风险进行管理。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金所持证券均在证券交易所或银行间同业市场交易，因此除附注 7.4.12 中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能根据本基金的基金管理人的投资意图，以合理的价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金 7 日可变现资产始终保持较高水平，基金资产整体具备良好流动性。

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。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来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、存出保证金及债券投资等。

下表统计了本基金面临的利率风险敞口，表中所示为本基金资产及负债的公允价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者进行了分类：

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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
资产							
货币资金	1,828,621.36	-	-	-	-	-	1,828,621.36
结算备付金	1,940,350.16	-	-	-	-	-	1,940,350.16
存出保证金	82,712.72	-	-	-	-	-	82,712.72
交易性金融资产	-	-	4,131,693.99	-	-	78,159,778.57	82,291,472.56
应收申购款	-	-	-	-	-	152,049.56	152,049.56
应收清算款	-	-	-	-	-	341,331.04	341,331.04
资产总计	3,851,684.24	-	4,131,693.99	-	-	78,653,159.17	86,636,537.40
负债							
应付赎回款	-	-	-	-	-	185,498.79	185,498.79
应付管理人报酬	-	-	-	-	-	94,087.54	94,087.54
应付托管费	-	-	-	-	-	15,681.23	15,681.23
应付销售服务费	-	-	-	-	-	17,609.36	17,609.36
应交税费	-	-	-	-	-	0.11	0.11
其他负债	-	-	-	-	-	848,889.58	848,889.58
负债总计	-	-	-	-	-	1,161,766.61	1,161,766.61
利率敏感度缺口	3,851,684.24	-	4,131,693.99	-	-	77,491,392.56	85,474,770.79

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2023年12月31日）
	市场利率上升 25 个基点	-3,131.31
	市场利率下降 25 个基点	3,131.31

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的证券，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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用自上而下与自下而上相结合的投资策略，在科学分析与有效管理信用风险的基础上，实现风险与收益的最佳匹配。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的 10%，且本基金与由本基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券，不得超过该证券的 10%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR（Value at Risk）指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023 年 12 月 31 日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）

交易性金融资产—股票投资	78,159,778.57	91.44
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—债券投资	4,131,693.99	4.83
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	82,291,472.56	96.28

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除敏感性分析基准以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末（2023年12月31日）
	沪深 300 指数上升 5%	3,307,767.55
	沪深 300 指数下降 5%	-3,307,767.55

注：本基金以沪深 300 指数作为其他价格波动风险的敏感性分析基准。

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属层次取决于对公允价值计量整体而言具有重要意义的最低层次的输入值。三个层次输入值的定义如下：

- 第一层次输入值：在计量日能够取得的相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价；
- 第二层次输入值：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察到的输入值；
- 第三层次输入值：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023 年 12 月 31 日
第一层次	77,972,087.57
第二层次	4,319,384.99
第三层次	-
合计	82,291,472.56

7.4.14.2.2 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可转换债券等，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，本基金分别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不会将相关股票和可转换债券等的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关股票和可转换债券公允价值应属第二层次或第三层次。

于本报告期间，本基金无公允价值所属层次间的重大变动。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

注：无。

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

注：无。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于 2023 年 12 月 31 日，本基金无非持续的以公允价值计量的金融工具。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融工具主要包括以摊余成本计量的金融资产和以摊余成本计量的金融负债，其账面价值与公允价值之间无重大差异。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至本报告期末，本基金无有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	78,159,778.57	90.22
	其中：股票	78,159,778.57	90.22
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	4,131,693.99	4.77
	其中：债券	4,131,693.99	4.77
	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	3,768,971.52	4.35
8	其他各项资产	576,093.32	0.66
9	合计	86,636,537.40	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末指数投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	56,889.00	0.07
B	采矿业	1,330,630.00	1.56
C	制造业	49,069,436.62	57.41
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,279,827.50	2.67
E	建筑业	1,181,792.00	1.38
F	批发和零售业	2,620,826.00	3.07
G	交通运输、仓储和邮政业	1,948,263.00	2.28
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,147,537.15	11.87
J	金融业	1,409,635.00	1.65
K	房地产业	1,553,601.00	1.82
L	租赁和商务服务业	1,070,048.00	1.25
M	科学研究和技术服务业	958,000.00	1.12

N	水利、环境和公共设施管理业	910,038.00	1.06
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	494,570.00	0.58
R	文化、体育和娱乐业	1,177,642.00	1.38
S	综合	-	-
	合计	76,208,735.27	89.16

8.2.2 报告期末积极投资按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	104,488.00	0.12
C	制造业	1,080,654.00	1.26
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	19,618.00	0.02
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	508,535.30	0.59
J	金融业	60,116.00	0.07
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	98,532.00	0.12
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	79,100.00	0.09
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,951,043.30	2.28

8.2.3 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

注：本基金本报告期末未持有港股通投资股票。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	002212	天融信	55,400	541,812.00	0.63
2	600312	平高电气	42,100	534,249.00	0.63
3	000528	柳工	76,300	514,262.00	0.60
4	600933	爱柯迪	22,900	502,426.00	0.59
5	002139	拓邦股份	51,300	500,688.00	0.59
6	600572	康恩贝	99,100	500,455.00	0.59
7	600285	羚锐制药	29,000	496,190.00	0.58
8	601137	博威合金	31,800	493,854.00	0.58
9	000650	仁和药业	73,100	484,653.00	0.57
10	002706	良信股份	54,400	480,352.00	0.56
11	600120	浙江东方	133,100	477,829.00	0.56
12	603300	华铁应急	73,700	471,680.00	0.55
13	002048	宁波华翔	36,000	468,360.00	0.55
14	600420	国药现代	47,500	465,025.00	0.54
15	600391	航发科技	24,200	462,704.00	0.54
16	601890	亚星锚链	46,600	461,340.00	0.54
17	601567	三星医疗	22,300	457,150.00	0.53
18	002130	沃尔核材	60,300	455,265.00	0.53
19	300377	赢时胜	58,400	453,184.00	0.53
20	300634	彩讯股份	22,100	452,387.00	0.53
21	603328	依顿电子	55,500	452,325.00	0.53
22	688239	航宇科技	9,427	450,327.79	0.53
23	603699	纽威股份	32,400	449,064.00	0.53
24	002063	远光软件	72,600	448,668.00	0.52
25	603871	嘉友国际	28,200	447,252.00	0.52
26	301087	可孚医疗	11,800	447,220.00	0.52
27	603920	世运电路	24,400	446,032.00	0.52
28	688106	金宏气体	18,488	445,375.92	0.52
29	002851	麦格米特	18,100	445,260.00	0.52
30	600623	华谊集团	69,000	444,360.00	0.52
31	688711	宏微科技	10,650	441,868.50	0.52
32	600986	浙文互联	80,700	440,622.00	0.52
33	688508	芯朋微	8,936	439,740.56	0.51
34	300768	迪普科技	29,600	437,488.00	0.51
35	603187	海容冷链	28,800	436,608.00	0.51
36	000737	北方铜业	75,200	436,160.00	0.51

37	002516	旷达科技	88,400	435,812.00	0.51
38	300183	东软载波	28,800	434,592.00	0.51
39	000597	东北制药	81,100	433,885.00	0.51
40	000012	南玻 A	77,700	432,789.00	0.51
41	688232	新点软件	11,934	432,010.80	0.51
42	002461	珠江啤酒	54,500	430,550.00	0.50
43	600266	城建发展	88,900	430,276.00	0.50
44	300206	理邦仪器	41,700	425,757.00	0.50
45	000811	冰轮环境	31,300	424,741.00	0.50
46	688368	晶丰明源	3,932	424,420.08	0.50
47	002651	利君股份	61,200	423,504.00	0.50
48	000061	农产品	65,400	423,138.00	0.50
49	000019	深粮控股	56,000	422,240.00	0.49
50	688739	成大生物	12,931	420,386.81	0.49
51	301267	华夏眼科	13,000	417,170.00	0.49
52	600510	黑牡丹	73,700	416,405.00	0.49
53	002218	拓日新能	90,900	409,959.00	0.48
54	688066	航天宏图	9,700	409,728.00	0.48
55	600633	浙数文化	36,800	407,008.00	0.48
56	603299	苏盐井神	47,500	404,700.00	0.47
57	000062	深圳华强	35,700	402,339.00	0.47
58	300002	神州泰岳	45,400	401,790.00	0.47
59	000928	中钢国际	68,800	401,104.00	0.47
60	002390	信邦制药	90,300	400,932.00	0.47
61	688007	光峰科技	15,300	395,964.00	0.46
62	600710	苏美达	55,600	394,204.00	0.46
63	000917	电广传媒	70,300	385,244.00	0.45
64	002091	江苏国泰	49,100	384,453.00	0.45
65	002539	云图控股	44,900	370,425.00	0.43
66	600780	通宝能源	44,500	364,900.00	0.43
67	603801	志邦家居	21,400	358,878.00	0.42
68	000921	海信家电	17,400	354,960.00	0.42
69	002158	汉钟精机	15,900	353,934.00	0.41
70	002545	东方铁塔	49,500	353,925.00	0.41
71	600273	嘉化能源	41,200	353,908.00	0.41
72	002204	大连重工	76,800	350,976.00	0.41
73	601801	皖新传媒	50,300	349,585.00	0.41
74	002283	天润工业	59,700	349,245.00	0.41
75	605507	国邦医药	19,800	347,688.00	0.41
76	603063	禾望电气	13,900	347,500.00	0.41
77	300119	瑞普生物	21,200	347,468.00	0.41
78	002895	川恒股份	18,200	345,800.00	0.40
79	300638	广和通	18,100	344,443.00	0.40

80	600459	贵研铂业	23,960	344,065.60	0.40
81	601811	新华文轩	24,900	340,134.00	0.40
82	000791	甘肃能源	60,600	337,542.00	0.39
83	688033	天宜上佳	19,970	337,493.00	0.39
84	688381	帝奥微	13,300	336,756.00	0.39
85	002125	湘潭电化	31,500	336,735.00	0.39
86	002171	楚江新材	44,900	335,852.00	0.39
87	002646	天佑德酒	24,600	334,806.00	0.39
88	002276	万马股份	32,500	332,150.00	0.39
89	688439	振华风光	3,700	329,707.00	0.39
90	688262	国芯科技	11,225	329,341.50	0.39
91	002498	汉缆股份	81,700	326,800.00	0.38
92	002960	青鸟消防	23,600	326,624.00	0.38
93	000885	城发环境	28,600	324,324.00	0.38
94	002541	鸿路钢构	14,900	323,777.00	0.38
95	002484	江海股份	20,000	321,200.00	0.38
96	688100	威胜信息	10,700	309,444.00	0.36
97	001213	中铁特货	71,700	301,140.00	0.35
98	300687	赛意信息	13,700	298,386.00	0.35
99	688372	伟测科技	3,800	297,920.00	0.35
100	002389	航天彩虹	16,000	297,600.00	0.35
101	688403	汇成股份	28,100	296,455.00	0.35
102	300887	谱尼测试	25,100	296,431.00	0.35
103	601677	明泰铝业	26,100	295,974.00	0.35
104	688556	高测股份	7,492	292,113.08	0.34
105	603599	广信股份	20,100	291,450.00	0.34
106	688128	中国电研	13,778	282,724.56	0.33
107	300233	金城医药	16,700	278,222.00	0.33
108	688206	概伦电子	12,670	276,206.00	0.32
109	300319	麦捷科技	28,600	275,704.00	0.32
110	603393	新天然气	9,000	275,130.00	0.32
111	301047	义翘神州	3,320	273,568.00	0.32
112	600717	天津港	66,000	271,260.00	0.32
113	600750	江中药业	12,900	269,352.00	0.32
114	600531	豫光金铅	44,100	266,805.00	0.31
115	603323	苏农银行	64,100	266,656.00	0.31
116	002079	苏州固锝	23,600	266,208.00	0.31
117	603071	物产环能	17,500	266,000.00	0.31
118	002254	泰和新材	17,600	263,296.00	0.31
119	600761	安徽合力	14,400	262,224.00	0.31
120	000968	蓝焰控股	36,600	260,226.00	0.30
121	600458	时代新材	27,800	256,038.00	0.30
122	300303	聚飞光电	42,900	254,397.00	0.30

123	002746	仙坛股份	35,900	252,736.00	0.30
124	600064	南京高科	41,700	251,868.00	0.29
125	600787	中储股份	48,200	245,820.00	0.29
126	000552	甘肃能化	80,300	244,915.00	0.29
127	300170	汉得信息	29,400	244,314.00	0.29
128	688568	中科星图	4,977	244,171.62	0.29
129	002108	沧州明珠	58,600	240,846.00	0.28
130	688298	东方生物	6,719	240,271.44	0.28
131	603010	万盛股份	22,100	238,459.00	0.28
132	000035	中国天楹	48,000	237,120.00	0.28
133	600835	上海机电	19,500	231,465.00	0.27
134	600475	华光环能	22,200	230,880.00	0.27
135	001696	宗申动力	34,700	230,061.00	0.27
136	002985	北摩高科	6,600	228,888.00	0.27
137	688016	心脉医疗	1,176	228,884.88	0.27
138	603881	数据港	11,500	227,930.00	0.27
139	688083	中望软件	2,284	227,349.36	0.27
140	000603	盛达资源	20,500	226,525.00	0.27
141	600483	福能股份	27,150	224,530.50	0.26
142	002838	道恩股份	17,456	223,611.36	0.26
143	600876	洛阳玻璃	15,700	220,271.00	0.26
144	600284	浦东建设	34,900	219,870.00	0.26
145	601163	三角轮胎	15,100	217,591.00	0.25
146	688235	百济神州	1,555	216,207.20	0.25
147	600641	万业企业	12,500	215,750.00	0.25
148	603197	保隆科技	3,825	215,730.00	0.25
149	000869	张裕 A	8,900	214,846.00	0.25
150	603093	南华期货	17,900	214,800.00	0.25
151	603301	振德医疗	8,700	213,150.00	0.25
152	603567	珍宝岛	17,500	212,800.00	0.25
153	002163	海南发展	23,200	210,656.00	0.25
154	600320	振华重工	63,400	210,488.00	0.25
155	002051	中工国际	25,600	207,872.00	0.24
156	600612	老凤祥	3,000	207,000.00	0.24
157	000875	吉电股份	47,000	206,800.00	0.24
158	600929	雪天盐业	31,900	205,755.00	0.24
159	000966	长源电力	45,700	202,451.00	0.24
160	000902	新洋丰	17,700	201,603.00	0.24
161	601001	晋控煤业	16,200	199,746.00	0.23
162	603229	奥翔药业	15,100	199,471.00	0.23
163	603236	移远通信	3,700	198,875.00	0.23
164	600225	卓朗科技	51,800	196,840.00	0.23
165	601952	苏垦农发	19,200	196,608.00	0.23

166	600618	氯碱化工	21,600	196,560.00	0.23
167	000555	神州信息	17,400	196,446.00	0.23
168	603043	广州酒家	10,000	195,300.00	0.23
169	002318	久立特材	9,800	194,824.00	0.23
170	601222	林洋能源	30,000	191,700.00	0.22
171	601921	浙版传媒	24,600	187,944.00	0.22
171	688409	富创精密	2,400	187,944.00	0.22
172	002635	安洁科技	11,500	187,795.00	0.22
173	002847	盐津铺子	2,700	187,596.00	0.22
174	001308	康冠科技	6,600	184,668.00	0.22
175	600595	中孚实业	52,900	184,092.00	0.22
176	600480	凌云股份	20,200	184,022.00	0.22
177	603766	隆鑫通用	35,200	181,632.00	0.21
178	600728	佳都科技	31,700	181,324.00	0.21
179	600643	爱建集团	35,300	180,030.00	0.21
180	600602	云赛智联	15,400	178,178.00	0.21
181	300171	东富龙	9,800	176,302.00	0.21
182	600138	中青旅	16,500	175,230.00	0.21
183	002932	明德生物	7,600	174,572.00	0.20
184	002866	传艺科技	8,200	174,004.00	0.20
185	600098	广州发展	32,400	173,988.00	0.20
186	000088	盐田港	35,300	172,264.00	0.20
187	000550	江铃汽车	9,000	171,270.00	0.20
188	300428	立中集团	8,100	171,072.00	0.20
189	002053	云南能投	17,700	170,274.00	0.20
190	002859	洁美科技	6,800	169,660.00	0.20
191	002249	大洋电机	33,800	167,986.00	0.20
192	300767	震安科技	9,600	166,848.00	0.20
193	600908	无锡银行	32,900	166,145.00	0.19
194	002145	中核钛白	37,000	165,760.00	0.19
195	600055	万东医疗	9,500	162,260.00	0.19
196	688023	安恒信息	1,442	159,903.38	0.19
197	688318	财富趋势	1,235	155,980.50	0.18
198	000403	派林生物	5,700	155,268.00	0.18
199	603989	艾华集团	7,200	154,944.00	0.18
200	601200	上海环境	17,200	154,628.00	0.18
201	688037	芯源微	1,150	153,651.50	0.18
202	300348	长亮科技	14,600	150,526.00	0.18
203	300856	科思股份	2,400	149,352.00	0.17
204	603132	金徽股份	10,900	149,112.00	0.17
205	601609	金田股份	21,900	148,263.00	0.17
206	603105	芯能科技	12,800	148,224.00	0.17
207	300457	赢合科技	8,000	147,520.00	0.17

208	002815	崇达技术	15,300	146,574.00	0.17
209	603733	仙鹤股份	8,900	143,646.00	0.17
210	600507	方大特钢	31,100	143,371.00	0.17
211	600502	安徽建工	30,600	142,290.00	0.17
212	002004	华邦健康	30,500	142,130.00	0.17
213	002332	仙琚制药	11,000	140,470.00	0.16
214	600323	瀚蓝环境	8,100	140,373.00	0.16
215	002724	海洋王	16,900	138,918.00	0.16
216	600216	浙江医药	12,900	138,417.00	0.16
217	601126	四方股份	9,700	137,352.00	0.16
218	688326	经纬恒润	1,181	137,055.05	0.16
219	600776	东方通信	11,800	133,222.00	0.16
220	688660	电气风电	25,800	132,612.00	0.16
221	301071	力量钻石	4,100	132,430.00	0.15
222	603876	鼎胜新材	10,400	130,312.00	0.15
223	000685	中山公用	17,800	130,118.00	0.15
224	002987	京北方	7,000	130,060.00	0.15
225	601619	嘉泽新能	36,800	129,904.00	0.15
226	002467	二六三	27,900	129,456.00	0.15
227	600361	创新新材	25,400	127,254.00	0.15
228	300639	凯普生物	13,600	127,024.00	0.15
229	002612	朗姿股份	6,600	126,918.00	0.15
230	002832	比音勒芬	4,000	126,800.00	0.15
231	600997	开滦股份	16,400	125,132.00	0.15
232	688327	云从科技	7,400	124,764.00	0.15
233	000543	皖能电力	19,900	124,574.00	0.15
234	688110	东芯股份	3,600	123,948.00	0.15
235	002302	西部建设	18,800	121,824.00	0.14
236	002677	浙江美大	12,000	121,320.00	0.14
237	300133	华策影视	20,400	119,748.00	0.14
238	601918	新集能源	22,500	118,575.00	0.14
239	600877	声光电科	8,400	117,516.00	0.14
240	600648	外高桥	11,900	117,334.00	0.14
241	600201	生物股份	10,800	116,316.00	0.14
242	600477	杭萧钢构	34,300	112,847.00	0.13
243	301155	海力风电	1,900	112,385.00	0.13
244	002727	一心堂	4,800	111,168.00	0.13
245	002537	海联金汇	16,500	109,890.00	0.13
245	600874	创业环保	19,800	109,890.00	0.13
246	688337	普源精电	2,500	109,675.00	0.13
247	601969	海南矿业	16,600	109,394.00	0.13
248	603170	宝立食品	6,400	108,224.00	0.13
249	000682	东方电子	13,400	107,870.00	0.13

250	600456	宝钛股份	3,400	106,726.00	0.12
251	300315	掌趣科技	20,700	106,605.00	0.12
252	603027	千禾味业	6,500	105,105.00	0.12
253	300443	金雷股份	3,800	104,842.00	0.12
254	600976	健民集团	1,600	104,400.00	0.12
255	688289	圣湘生物	5,321	104,025.55	0.12
256	002967	广电计量	6,700	100,567.00	0.12
257	002705	新宝股份	6,900	100,533.00	0.12
258	688158	优刻得	6,043	99,407.35	0.12
259	301367	怡和嘉业	800	97,400.00	0.11
260	688185	康希诺	1,300	96,876.00	0.11
261	603915	国茂股份	5,600	92,288.00	0.11
262	000913	钱江摩托	7,400	92,278.00	0.11
263	002402	和而泰	6,400	91,456.00	0.11
264	600775	南京熊猫	6,900	91,425.00	0.11
265	600645	中源协和	4,400	89,188.00	0.10
266	600210	紫江企业	18,900	88,830.00	0.10
267	002837	英维克	3,200	87,936.00	0.10
268	600577	精达股份	21,200	87,768.00	0.10
269	300455	航天智装	7,300	87,162.00	0.10
270	000915	华特达因	3,000	86,880.00	0.10
271	600197	伊力特	3,900	84,825.00	0.10
272	688639	华恒生物	673	84,730.70	0.10
273	600360	华微电子	11,700	84,591.00	0.10
274	603556	海兴电力	2,900	84,187.00	0.10
275	688152	麒麟信安	1,200	84,084.00	0.10
276	600559	老白干酒	3,700	83,435.00	0.10
277	000681	视觉中国	5,600	82,320.00	0.10
278	603533	掌阅科技	4,100	81,508.00	0.10
279	300525	博思软件	5,400	80,568.00	0.09
280	002320	海峡股份	13,800	80,454.00	0.09
281	000657	中钨高新	9,200	78,016.00	0.09
282	000025	特力A	4,900	77,959.00	0.09
283	601678	滨化股份	18,400	77,464.00	0.09
284	301239	普瑞眼科	900	77,400.00	0.09
285	603308	应流股份	5,400	77,382.00	0.09
286	688266	泽璟制药	1,447	76,604.18	0.09
287	000818	航锦科技	2,400	75,312.00	0.09
288	605222	起帆电缆	3,900	75,192.00	0.09
289	002773	康弘药业	4,000	73,760.00	0.09
290	688050	爱博医疗	421	72,428.84	0.08
291	300627	华测导航	2,300	71,346.00	0.08
292	300284	苏交科	12,900	70,305.00	0.08

293	600993	马应龙	2,900	70,122.00	0.08
294	000990	诚志股份	8,500	69,785.00	0.08
295	002233	塔牌集团	9,600	67,968.00	0.08
296	688315	诺禾致源	2,900	67,686.00	0.08
297	300602	飞荣达	3,700	66,859.00	0.08
298	603588	高能环境	10,200	66,708.00	0.08
299	002190	成飞集成	3,500	66,395.00	0.08
300	000034	神州数码	2,200	65,802.00	0.08
301	603055	台华新材	5,400	65,016.00	0.08
302	002701	奥瑞金	15,500	64,170.00	0.08
303	688019	安集科技	400	63,904.00	0.07
304	002023	海特高新	6,900	62,790.00	0.07
305	002226	江南化工	14,200	62,196.00	0.07
306	603439	贵州三力	3,200	60,416.00	0.07
307	688133	泰坦科技	1,300	60,255.00	0.07
308	002446	盛路通信	7,200	59,760.00	0.07
309	603936	博敏电子	5,600	58,464.00	0.07
310	600012	皖通高速	5,300	58,406.00	0.07
311	603279	景津装备	2,600	57,486.00	0.07
312	002041	登海种业	4,300	56,889.00	0.07
313	688139	海尔生物	1,400	56,728.00	0.07
314	688127	蓝特光学	2,430	56,594.70	0.07
315	002034	旺能环境	3,700	56,425.00	0.07
316	002221	东华能源	5,400	55,620.00	0.07
317	603888	新华网	2,200	55,418.00	0.06
318	601369	陕鼓动力	6,700	53,466.00	0.06
319	300775	三角防务	1,900	53,010.00	0.06
320	000028	国药一致	1,800	52,182.00	0.06
321	688617	惠泰医疗	134	52,059.00	0.06
322	002243	力合科创	6,500	51,675.00	0.06
323	688700	东威科技	800	48,816.00	0.06
324	600073	上海梅林	7,100	48,351.00	0.06
325	601949	中国出版	5,900	47,672.00	0.06
326	603678	火炬电子	1,800	47,646.00	0.06
327	603171	税友股份	1,300	45,994.00	0.05
328	600621	华鑫股份	3,200	45,024.00	0.05
329	603566	普莱柯	1,900	43,035.00	0.05
330	600639	浦东金桥	4,200	42,462.00	0.05
331	002959	小熊电器	800	41,544.00	0.05
332	002215	诺普信	5,000	41,300.00	0.05
333	603690	至纯科技	1,600	41,120.00	0.05
334	600211	西藏药业	800	39,040.00	0.05
335	002768	国恩股份	1,800	38,556.00	0.05

336	688190	云路股份	511	36,602.93	0.04
337	601019	山东出版	3,800	35,644.00	0.04
338	002378	章源钨业	6,000	33,960.00	0.04
339	002351	漫步者	1,900	33,573.00	0.04
340	002839	张家港行	8,200	31,816.00	0.04
341	688278	特宝生物	600	31,410.00	0.04
342	600685	中船防务	1,200	30,660.00	0.04
343	300475	香农芯创	900	30,411.00	0.04
344	002421	达实智能	9,200	29,624.00	0.03
345	300236	上海新阳	800	28,176.00	0.03
346	002807	江阴银行	7,700	27,335.00	0.03
347	688031	星环科技	400	26,028.00	0.03
348	688575	亚辉龙	1,100	25,157.00	0.03
349	688048	长光华芯	400	25,068.00	0.03
350	000582	北部湾港	3,300	24,783.00	0.03
351	002605	姚记科技	1,100	24,442.00	0.03
352	301039	中集车辆	2,600	24,388.00	0.03
353	600586	金晶科技	3,600	24,048.00	0.03
354	300476	胜宏科技	1,300	23,985.00	0.03
355	601330	绿色动力	3,600	23,904.00	0.03
356	002003	伟星股份	2,200	23,870.00	0.03
357	601606	长城军工	1,900	23,142.00	0.03
358	688322	奥比中光	615	23,111.70	0.03
359	688167	炬光科技	200	22,800.00	0.03
360	600662	外服控股	4,700	22,560.00	0.03
361	603636	南威软件	1,700	21,794.00	0.03
362	002182	宝武镁业	1,100	21,626.00	0.03
363	300674	宇信科技	1,300	21,164.00	0.02
364	000030	富奥股份	3,900	20,826.00	0.02
365	002436	兴森科技	1,400	20,622.00	0.02
366	688027	国盾量子	157	20,080.30	0.02
367	002534	西子洁能	1,500	18,735.00	0.02
368	002946	新乳业	1,600	18,368.00	0.02
369	600449	宁夏建材	1,000	17,930.00	0.02
370	688578	艾力斯	414	17,247.24	0.02
371	605365	立达信	900	16,749.00	0.02
372	688392	骄成超声	200	16,682.00	0.02
373	300747	锐科激光	700	16,471.00	0.02
374	000719	中原传媒	1,500	14,595.00	0.02
375	301286	侨源股份	500	14,530.00	0.02
376	600955	维远股份	800	14,360.00	0.02
377	601515	东风股份	3,500	14,140.00	0.02
378	688598	金博股份	200	13,980.00	0.02

379	603985	恒润股份	500	12,425.00	0.01
380	002950	奥美医疗	1,300	12,324.00	0.01
381	600971	恒源煤电	1,100	12,265.00	0.01
382	300298	三诺生物	400	12,160.00	0.01
383	603583	捷昌驱动	600	12,018.00	0.01
384	300618	寒锐钴业	400	11,316.00	0.01
385	688696	极米科技	100	11,298.00	0.01
386	002088	鲁阳节能	700	9,975.00	0.01
387	600395	盘江股份	1,600	9,872.00	0.01
388	603368	柳药集团	500	9,460.00	0.01
389	002077	大港股份	600	9,150.00	0.01
390	688261	东微半导	107	8,944.13	0.01
391	002194	武汉凡谷	900	8,874.00	0.01
392	688275	万润新能	100	6,167.00	0.01
393	301301	川宁生物	700	5,880.00	0.01
394	688380	中微半导	159	3,793.74	0.00
395	688733	壹石通	100	2,927.00	0.00
396	688389	普门科技	100	2,251.00	0.00
397	688526	科前生物	43	876.34	0.00
398	688339	亿华通	17	777.58	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300532	今天国际	12,200	200,324.00	0.23
2	603444	吉比特	800	196,096.00	0.23
3	688208	道通科技	8,200	194,750.00	0.23
4	603050	科林电气	8,200	147,190.00	0.17
5	002540	亚太科技	21,500	142,115.00	0.17
6	300491	通合科技	5,600	124,768.00	0.15
7	601857	中国石油	14,800	104,488.00	0.12
8	300759	康龙化成	3,400	98,532.00	0.12
9	300015	爱尔眼科	5,000	79,100.00	0.09
10	601728	中国电信	13,300	71,953.00	0.08
11	688182	灿勤科技	3,900	69,342.00	0.08
12	000728	国元证券	7,600	51,908.00	0.06
13	688566	吉贝尔	1,600	50,224.00	0.06
14	688159	有方科技	1,300	48,945.00	0.06
15	000630	铜陵有色	12,100	39,688.00	0.05
16	002296	辉煌科技	4,400	36,300.00	0.04
17	600779	水井坊	600	35,262.00	0.04
18	600516	方大炭素	6,400	33,536.00	0.04

19	002303	美盈森	9,300	32,643.00	0.04
20	002600	领益智造	3,900	26,364.00	0.03
21	603611	诺力股份	1,300	24,609.00	0.03
22	002271	东方雨虹	1,200	23,040.00	0.03
23	600737	中粮糖业	2,700	22,248.00	0.03
24	600050	中国联通	5,000	21,900.00	0.03
25	002919	名臣健康	800	20,512.00	0.02
26	000554	泰山石油	3,400	19,618.00	0.02
27	300533	冰川网络	400	11,080.00	0.01
28	000563	陕国投 A	2,700	8,208.00	0.01
29	002179	中航光电	200	7,800.00	0.01
30	688699	明微电子	178	7,182.30	0.01
31	688277	天智航	100	1,318.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	002851	麦格米特	2,598,584.00	3.04
2	300002	神州泰岳	2,478,235.00	2.90
3	688711	宏微科技	2,418,075.82	2.83
4	300377	赢时胜	2,348,931.00	2.75
5	688016	心脉医疗	2,304,588.42	2.70
6	603298	杭叉集团	2,298,460.00	2.69
7	002332	仙琚制药	2,287,648.00	2.68
8	000875	吉电股份	2,284,443.00	2.67
9	300638	广和通	2,277,169.04	2.66
10	600933	爱柯迪	2,211,700.00	2.59
11	002402	和而泰	2,208,523.00	2.58
12	600761	安徽合力	2,162,622.00	2.53
13	300476	胜宏科技	2,154,536.00	2.52
14	600129	太极集团	2,145,549.00	2.51
15	002467	二六三	2,106,938.98	2.46
16	300394	天孚通信	2,101,304.00	2.46
17	002139	拓邦股份	2,076,145.00	2.43
18	600323	瀚蓝环境	2,072,674.00	2.42
19	601801	皖新传媒	2,060,243.00	2.41
20	688050	爱博医疗	2,033,402.25	2.38
21	002108	沧州明珠	2,023,262.00	2.37
22	603300	华铁应急	2,018,506.00	2.36
23	688556	高测股份	2,014,101.59	2.36

24	002847	盐津铺子	1,999,630.00	2.34
25	688568	中科星图	1,995,774.52	2.33
26	600510	黑牡丹	1,975,211.00	2.31
27	600312	平高电气	1,964,204.66	2.30
28	688037	芯源微	1,954,404.12	2.29
29	688578	艾力斯	1,948,573.32	2.28
30	603027	千禾味业	1,945,744.00	2.28
31	002484	江海股份	1,937,761.00	2.27
32	002044	美年健康	1,934,758.00	2.26
33	000921	海信家电	1,929,443.00	2.26
34	600120	浙江东方	1,916,030.00	2.24
35	002472	双环传动	1,903,018.00	2.23
36	002545	东方铁塔	1,900,323.00	2.22
37	300627	华测导航	1,891,721.00	2.21
38	601222	林洋能源	1,890,471.00	2.21
39	002283	天润工业	1,886,126.00	2.21
40	002276	万马股份	1,885,257.00	2.21
41	300693	盛弘股份	1,879,441.00	2.20
42	600675	中华企业	1,878,543.00	2.20
43	603345	安井食品	1,864,706.00	2.18
44	600483	福能股份	1,864,381.00	2.18
45	000650	仁和药业	1,861,362.00	2.18
46	002351	漫步者	1,861,019.00	2.18
47	600648	外高桥	1,851,411.00	2.17
48	002389	航天彩虹	1,833,578.00	2.15
49	000791	甘肃能源	1,831,238.00	2.14
50	600633	浙数文化	1,830,362.00	2.14
51	601567	三星医疗	1,823,811.00	2.13
52	600583	海油工程	1,815,541.00	2.12
53	600064	南京高科	1,809,224.00	2.12
54	600710	苏美达	1,793,167.00	2.10
55	600266	城建发展	1,787,154.00	2.09
56	000811	冰轮环境	1,786,956.00	2.09
57	688190	云路股份	1,781,739.40	2.08
58	601921	浙版传媒	1,776,634.00	2.08
59	300170	汉得信息	1,765,982.00	2.07
60	002706	良信股份	1,765,428.00	2.07
61	600587	新华医疗	1,759,147.00	2.06
62	300768	迪普科技	1,758,652.00	2.06
63	605507	国邦医药	1,757,260.00	2.06
64	600055	万东医疗	1,751,059.00	2.05
65	300183	东软载波	1,749,313.00	2.05
66	601918	新集能源	1,748,344.00	2.05

67	600391	航发科技	1,744,378.00	2.04
68	002053	云南能投	1,733,939.00	2.03
69	600835	上海机电	1,729,412.00	2.02
70	600456	宝钛股份	1,726,895.00	2.02
71	688739	成大生物	1,721,283.94	2.01
72	603368	柳药集团	1,710,962.00	2.00
73	000065	北方国际	1,709,638.00	2.00

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值 2%或前 20 名的股票明细

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	占期末基金资产净值比例(%)
1	603298	杭叉集团	2,354,144.00	2.75
2	300394	天孚通信	2,316,450.00	2.71
3	600129	太极集团	2,223,562.00	2.60
4	300476	胜宏科技	2,214,063.00	2.59
5	002332	仙琚制药	2,199,684.00	2.57
6	688016	心脉医疗	2,163,237.45	2.53
7	002402	和而泰	2,098,162.00	2.45
8	300002	神州泰岳	2,046,503.00	2.39
9	000875	吉电股份	2,045,711.00	2.39
10	002472	双环传动	2,037,264.00	2.38
11	002467	二六三	2,035,278.00	2.38
12	002851	麦格米特	2,017,075.00	2.36
13	688578	艾力斯	1,999,368.25	2.34
14	002351	漫步者	1,980,310.00	2.32
15	688050	爱博医疗	1,946,192.76	2.28
16	002044	美年健康	1,932,058.00	2.26
17	300693	盛弘股份	1,923,411.00	2.25
18	300377	赢时胜	1,910,917.00	2.24
19	600323	瀚蓝环境	1,900,197.00	2.22
20	300638	广和通	1,877,667.00	2.20
21	300627	华测导航	1,877,499.00	2.20
22	600675	中华企业	1,827,940.60	2.14
23	603027	千禾味业	1,809,261.00	2.12
24	601801	皖新传媒	1,799,144.00	2.10
25	600761	安徽合力	1,784,499.00	2.09
26	688278	特宝生物	1,782,780.51	2.09
27	688711	宏微科技	1,773,462.44	2.07
28	002108	沧州明珠	1,772,394.00	2.07
29	688037	芯源微	1,767,738.04	2.07
30	002847	盐津铺子	1,763,350.00	2.06
31	600583	海油工程	1,758,791.00	2.06

32	600587	新华医疗	1,754,140.00	2.05
33	002484	江海股份	1,743,686.00	2.04
34	300226	上海钢联	1,741,792.00	2.04
35	603345	安井食品	1,731,816.00	2.03
36	688556	高测股份	1,731,116.84	2.03
37	600933	爱柯迪	1,723,208.00	2.02
38	688190	云路股份	1,719,310.53	2.01
39	000681	视觉中国	1,719,178.00	2.01
40	688568	中科星图	1,714,337.04	2.01

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	556,376,220.51
卖出股票收入（成交）总额	480,724,022.56

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	国家债券	4,056,789.04	4.75
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	74,904.95	0.09
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	4,131,693.99	4.83

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	019703	23 国债 10	40,000	4,056,789.04	4.75
2	113069	博 23 转债	710	71,004.67	0.08
3	127100	神码转债	39	3,900.28	0.00

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

注：本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

注：本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

当基金仓位较低以及基差负向较大时，买入期货以获取超额收益。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**8.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金本报告期末投资国债期货。

8.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末投资国债期货。

8.12 本报告期投资基金情况**8.12.1 投资政策及风险说明**

本基金本报告期末投资基金。

8.12.2 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的基金投资明细

注：本基金本报告期末未持有基金。

8.13 投资组合报告附注**8.13.1 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**

报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体中不存在被监管部门立案调查或在本报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情况。

8.13.2 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

报告期内本基金投资的前十名股票中没有在备选股票库之外的股票。

8.13.3 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	82,712.72
2	应收清算款	341,331.04
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	152,049.56
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-

9	合计	576,093.32
---	----	------------

8.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

注：本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.13.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

注：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的情况。

8.13.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

注：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的情况。

8.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

因四舍五入原因，投资组合报告中市值占资产或净值比例的分项之和与合计可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例 (%)	持有份额	占总份额比例 (%)
浙商中证 1000 指数增强 A	369	109,523.92	0.00	0.00	40,414,328.29	100.00
浙商中证 1000 指数增强 C	674	70,089.81	750,125.00	1.59	46,490,408.14	98.41
合计	1,043	84,041.09	750,125.00	0.86	86,904,736.43	99.14

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例 (%)
基金管理人所有从业人员持有本基金	浙商中证 1000 指数增强 A	198,686.30	0.4916
	浙商中证 1000 指数增强 C	200.05	0.0004

	合计	198,886.35	0.2269
--	----	------------	--------

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	浙商中证 1000 指数增强 A	0
	浙商中证 1000 指数增强 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	浙商中证 1000 指数增强 A	10~50
	浙商中证 1000 指数增强 C	0
	合计	10~50

9.4 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况

注：本基金无期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理本人及其直系亲属持有本人管理的产品情况。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

项目	浙商中证 1000 指数增强 A	浙商中证 1000 指数增强 C
基金合同生效日 (2023 年 9 月 26 日) 基金份额总额	64,484,195.10	225,586,066.38
基金合同生效日起至 报告期期末基金总申 购份额	1,500,244.81	1,033,041.26
减：基金合同生效日 起至报告期期末基金 总赎回份额	25,570,111.62	179,378,574.50
基金合同生效日起至 报告期期末基金拆分 变动份额	-	-
本报告期期末基金份 额总额	40,414,328.29	47,240,533.14

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

报告期内无基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

报告期内，基金管理人的重大人事变动：

2023 年 12 月 12 日，唐生林先生离任浙商基金管理有限公司首席信息官职务；

2023 年 12 月 21 日，鞠海洋先生担任浙商基金管理有限公司首席信息官职务。

（本报告期自 2023 年 9 月 26 日起至 2023 年 12 月 31 日止）

本报告期内，基金托管人无重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期基金管理人、基金财产、基金托管业务没有发生诉讼事项。

11.4 基金投资策略的改变

报告期内无基金投资策略的改变。

11.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内本基金未改聘为基金审计的会计师事务所，本报告年度的审计费用为 35,000.00 元。

11.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.7.1 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	管理人
受到稽查或处罚等措施的时间	2023 年 9 月 20 日
采取稽查或处罚等措施的机构	中国证券监督管理委员会浙江证监局
受到的具体措施类型	责令改正措施
受到稽查或处罚等措施的原因	公司部分业务内部控制不完善
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	基金管理人已及时按要求改正并报告
其他	-

11.7.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

注：本报告期内，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.8.1 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 (%)	
东海证券	2	367,662,570.88	35.45	163,940.30	20.74	-
东方财富证券	1	356,944,611.27	34.42	337,632.72	42.72	-
银河证券	2	158,058,356.59	15.24	149,506.12	18.91	-
国联证券	1	73,662,728.73	7.10	69,679.28	8.82	-
国投证券	2	46,191,744.00	4.45	36,953.40	4.68	-
长江证券	1	19,809,717.90	1.91	18,739.53	2.37	-
东吴证券	1	14,770,513.70	1.42	13,971.21	1.77	-
长城证券	1	-	-	-	-	-
川财证券	1	-	-	-	-	-
德邦证券	1	-	-	-	-	-
东北证券	1	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
瑞银证券	1	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
太平洋证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	1	-	-	-	-	-
中邮证券	1	-	-	-	-	-

注：1、券商专用交易单元选择标准：

基金管理人负责选择证券经营机构，选用其交易单元供本基金证券买卖专用，选择标准为：

- (1) 遵循国家及证券监管机构的各项法律法规、监管规定的要求；
- (2) 维护持有人利益，不利用基金资产进行利益输送，不承诺交易量；
- (3) 以券商服务质量作为席位选择和佣金分配的标准。

2、券商专用交易单元选择程序：

(1) 股票投资部、市场销售总部

a、专员与券商联系商讨合作意向，根据公司及基金法律文件中对券商席位的选择标准，并参考中央交易室主管的建议，确定新基金租用或基金新租用席位的所属券商以及（主）席位。

b、报公司分管领导审核通过。

(2) 中央交易室

a、专员将我公司格式版本的《证券交易席位使用协议》发送给券商相关业务联系人。

b、券商对我公司提供的协议有修改意见的，其内容若涉及股票投资部、市场销售总部、基金运营部的，由专员分别将此内容发送给上述部门审议，并由专员将我公司各职能部门反馈的意见与券商进行商议，形成一致意见后完成协议初稿，交我公司监察稽核部审核。

c、对券商和我公司双方同意的协议文本进行签字盖章。我公司盖章程序，由专员填写合同流转单，分别送达股票投资部、市场销售总部、基金运营部、监察稽核部签字，最后盖章。

3、本期内本基金券商交易单元变更情况：

(1) 本报告期内新增交易单元：国联证券（57266）、中邮证券（57420）、中泰证券（25665）、民生证券（57898）、德邦证券（57907）、东海证券（395241）、东海证券（56967）；

(2) 本报告期内无交易单元退租；

(3) 浙商中证 1000 指数增强证券投资基金与浙商惠利纯债债券型证券投资基金、浙商全景消费混合型证券投资基金、浙商智能行业优选混合型发起式证券投资基金、浙商智选领航三年持有期混合型证券投资基金、浙商智选食品饮料股票型发起式证券投资基金、浙商智选家居股票型发起式证券投资基金、浙商创业板指数增强型发起式证券投资基金、浙商智选价值混合型证券投资基金、浙商智多金稳健一年持有期混合型证券投资基金、浙商智多享稳健混合型发起式证券投资基金、浙商沪港深精选混合型证券投资基金、浙商智选新兴产业混合型证券投资基金、浙商智选先锋一年持有期混合型证券投资基金共用所有交易单元。

11.8.2 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	债券交易	债券回购交易	权证交易
-----	------	--------	------

称	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(%)
东海证券	22,987,282.00	95.13	244,920,000.00	90.91	-	-
东方财富证券	127,424.64	0.53	-	-	-	-
银河证券	50,757.08	0.21	-	-	-	-
国联证券	998,200.00	4.13	4,500,000.00	1.67	-	-
国投证券	-	-	20,000,000.00	7.42	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-
长城证券	-	-	-	-	-	-
川财证券	-	-	-	-	-	-
德邦证券	-	-	-	-	-	-
东北证券	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-
瑞银证券	-	-	-	-	-	-

上海证 券	-	-	-	-	-	-
太平洋 证券	-	-	-	-	-	-
西部证 券	-	-	-	-	-	-
中泰证 券	-	-	-	-	-	-
中信证 券	-	-	-	-	-	-
中邮证 券	-	-	-	-	-	-

11.9 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	浙商中证 1000 指数增强型证券投资 基金基金份额发售公告	中国证监会指定媒介	2023 年 8 月 22 日
2	浙商中证 1000 指数增强型证券投资 基金基金合同及招募说明书提示性公 告	中国证监会指定媒介	2023 年 8 月 22 日
3	浙商中证 1000 指数增强型证券投资 基金托管协议	中国证监会指定媒介	2023 年 8 月 22 日
4	浙商中证 1000 指数增强型证券投资 基金招募说明书	中国证监会指定媒介	2023 年 8 月 22 日
5	浙商中证 1000 指数增强型证券投资 基金基金合同	中国证监会指定媒介	2023 年 8 月 22 日
6	浙商中证 1000 指数增强型证券投资 基金基金产品资料概要	中国证监会指定媒介	2023 年 8 月 22 日
7	关于浙商中证 1000 指数增强型证券 投资基金新增销售机构的公告	中国证监会指定媒介	2023 年 8 月 28 日
8	浙商基金管理有限公司关于旗下部分 基金新增兴业银行股份有限公司银银 平台为销售机构公告	中国证监会指定媒介	2023 年 9 月 21 日
9	浙商中证 1000 指数增强型证券投资 基金基金合同生效公告	中国证监会指定媒介	2023 年 9 月 27 日
10	浙商基金管理有限公司关于浙商中证 1000 指数增强型证券投资基金可投资 科创板股票的公告	中国证监会指定媒介	2023 年 10 月 10 日
11	浙商基金管理有限公司关于旗下部分 基金参加招商银行股份有限公司费率 优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2023 年 10 月 20 日
12	浙商中证 1000 指数增强型证券投资 基金开放日常申购、赎回、转换及定	中国证监会指定媒介	2023 年 11 月 17 日

定期投资业务的公告		
-----------	--	--

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

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							
<p>(1) 赎回申请延期办理的风险机构投资者大额赎回时易构成本基金发生巨额赎回, 中小投资者可能面临小额赎回申请也需要与机构投资者按同比例部分延期办理的风险。(2) 基金净值大幅波动的风险机构投资者大额赎回时, 基金管理人进行基金财产变现可能会对基金资产净值造成较大波动;(3) 提前终止基金合同的风险机构投资者赎回后, 可能出现基金资产净值低于 5,000 万元的情形, 若连续六十个工作日出现基金资产净值低于 5,000 万元情形的, 基金管理人可能提前终止基金合同, 基金财产将进行清算。(4) 基金规模过小导致的风险机构投资者赎回后, 可能导致基金规模过小。基金可能会面临投资银行间债券、交易所债券时交易困难的情形。</p>							

注: 本基金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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

无

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准浙商大数据智选消费灵活配置混合型证券投资基金设立的相关文件;
- 2、《浙商中证 1000 指数增强型证券投资基金招募说明书》及其更新;
- 3、《浙商中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》;
- 4、《浙商中证 1000 指数增强型证券投资基金托管协议》;
- 5、基金管理人业务资格批件和营业执照;
- 6、报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告;
- 7、中国证监会要求的其他文件。

13.2 存放地点

上海市浦东新区陆家嘴西路 99 号万向大厦 10 楼

13.3 查阅方式

投资者可于本基金管理人办公时间预约查阅，或登录基金管理人网站 www.zsfund.com 查阅，还可拨打基金管理人客户服务中心电话：400-067-9908/021-60359000 查询相关信息。

浙商基金管理有限公司

2024 年 3 月 30 日