

# 明亚中证 1000 指数增强型证券投资基金 2023 年第 4 季度报告

2023 年 12 月 31 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

报告送出日期：2024 年 1 月 19 日

## § 1 重要提示

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

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同规定，于 2024 年 1 月 17 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 10 月 1 日起至 12 月 31 日止。

## § 2 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	209,911,747.14 份
投资目标	本基金为股票指数增强型基金，在力求对中证 1000 指数进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值；力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过 0.5%，年化跟踪误差不超过 7.75%。
投资策略	1、大类资产配置策略；2、股票投资策略：（1）指数投资策略；（2）量化增强策略（量化多因子模型、结构化风险模型、行业轮动模型、组合优化模型）；3、债券投资策略；4、衍生品投资策略（股指期货交易策略、股票期权投资策略、国债期货交易策略）；5、资产支持证券投资策略；6、可转换债券、可交换债券投资策略；7、参与融资及转融通证券出借业务投资策略。
业绩比较基准	

	中证 1000 指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。	
风险收益特征	R4	
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	
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	209,600,549.90 份	311,197.24 份

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2023 年 10 月 1 日-2023 年 12 月 31 日）	
	明亚中证 1000 指数增强 A	明亚中证 1000 指数增强 C
1. 本期已实现收益	-1,930,428.13	-12,987.77
2. 本期利润	-2,010,538.67	-14,792.87
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0363	-0.0460
4. 期末基金资产净值	189,865,003.14	281,347.28
5. 期末基金份额净值	0.9058	0.9041

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、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

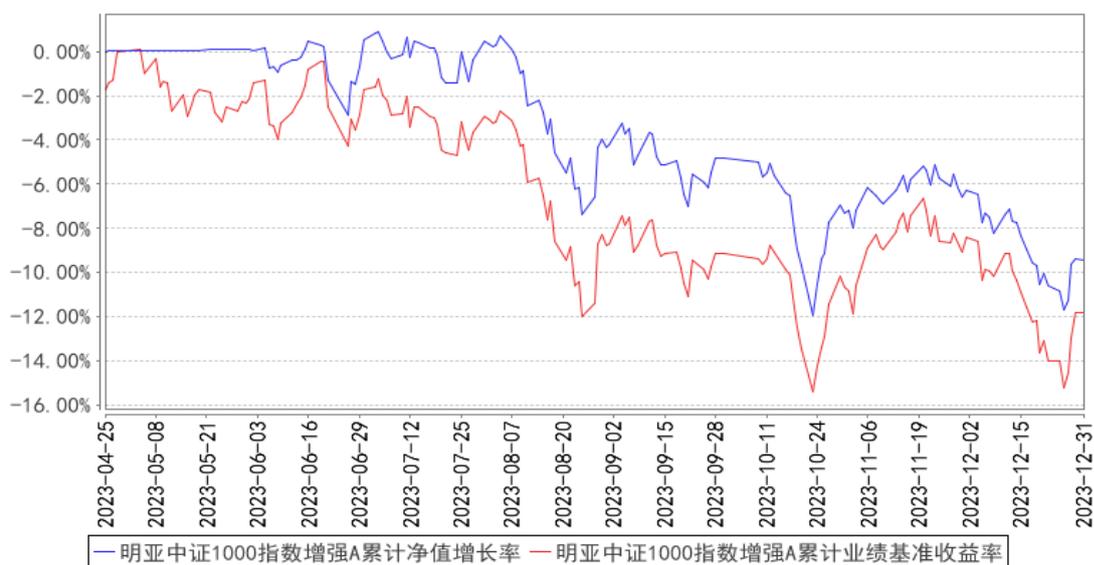
阶段	净值增长率①	净值增长率标准 差②	业绩比较基准 收益率③	业绩比较基准 收益率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	-4.81%	0.81%	-2.98%	0.98%	-1.83%	-0.17%
过去六个月	-9.87%	0.80%	-10.28%	0.95%	0.41%	-0.15%
自基金合同 生效起至今	-9.42%	0.73%	-11.83%	0.93%	2.41%	-0.20%

明亚中证 1000 指数增强 C

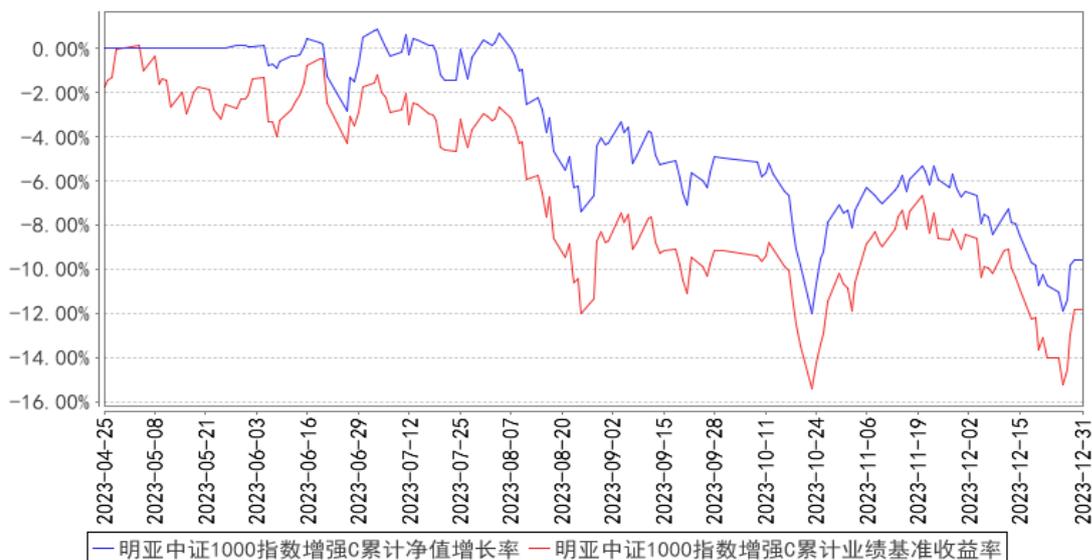
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-4.90%	0.81%	-2.98%	0.98%	-1.92%	-0.17%
过去六个月	-10.05%	0.80%	-10.28%	0.95%	0.23%	-0.15%
自基金合同生效起至今	-9.59%	0.73%	-11.83%	0.93%	2.24%	-0.20%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金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 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
何明	本基金的基金经理、研究部总监	2023年4月25日	-	23年	武汉大学国际金融硕士、英国巴斯大学MBA，曾任国投瑞银基金管理有限公司研究部研究员、研究部总监、基金经理，2020年7月加入明亚基金管理有限责任公司，现任研究部总监、权益投资部基金经理。
孔令伟	原本基金基金经理	2023年6月19日	2023年10月12日	2年	上海交通大学硕士研究生。曾先后任职于德勤永华会计师事务所(特殊普通合伙)，平安资产管理有限责任公司，上海系数投资管理合伙企业(有限合伙)。2022年7月加入明亚基金管理有限责任公司，历任量化投资部投资经理、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《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

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

报告期内，不存在基金经理兼任私募资产管理计划投资经理的情况。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

报告期内，基金管理人不存在损害基金份额持有人利益的情况。

## 4.3 公平交易专项说明

### 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

尽管四季度有万亿特别国债、中美高层峰会、美债收益率快速下行等多项利好，A 股整体未能摆脱 3 季度的弱势，投资者信心较为低迷。不过，随着成交量的萎缩，叠加 A 股整体估值水平已经处于历史偏低水平，市场下跌动能可能已经趋向衰竭，未来有较大机会逐步走出底部区域。

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，通过量化

的方法进行有效跟踪的基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争实现超越目标指数的投资收益，谋求基金资产的长期增值。本基金运用了多因子选股模型、风险模型等量化模型，在组合构建中控制与中证 1000 指数的行业偏离度、风格偏离度、个股偏离度等。同时，股票组合中 80%以上的权重为中证 1000 指数的成分股，在与中证 1000 指数保持较小的跟踪误差前提下，力争较为稳定的超额收益。

#### 4.5 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 0.9058 元，本报告期基金份额净值增长率为-4.81%，同期业绩比较基准收益率为-2.98%；截至本报告期末明亚中证 1000 指数增强 C 的基金份额净值为 0.9041 元，本报告期基金份额净值增长率为-4.90%，同期业绩比较基准收益率-2.98%。

#### 4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内，本基金存在连续二十个工作日净值低于 5000 万元的情形，截至本报告期末，本基金净值已达到 5000 万元。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量不满二百人的情形。

## § 5 投资组合报告

### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	44,612,942.00	23.44
	其中：股票	44,612,942.00	23.44
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	5,551,044.56	2.92
8	其他资产	140,137,343.40	73.64
9	合计	190,301,329.96	100.00

## 5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 5.2.1 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	431,344.00	0.23
C	制造业	28,273,815.00	14.87
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,950,596.00	1.03
E	建筑业	1,279,026.00	0.67
F	批发和零售业	1,062,966.00	0.56
G	交通运输、仓储和邮政业	1,927,252.00	1.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,751,435.00	1.97
J	金融业	858,300.00	0.45
K	房地产业	837,260.00	0.44
L	租赁和商务服务业	419,537.00	0.22
M	科学研究和技术服务业	212,550.00	0.11
N	水利、环境和公共设施管理业	641,362.00	0.34
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	216,852.00	0.11
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	41,862,295.00	22.02

### 5.2.2 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	-	-
C	制造业	1,540,798.00	0.81
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	353,732.00	0.19
G	交通运输、仓储和邮政业	210,249.00	0.11
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	433,850.00	0.23
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	212,018.00	0.11
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,750,647.00	1.45

### 5.2.3 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。

### 5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 5.3.1 报告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前十名股票投资明细

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	603396	金辰股份	4,700	256,855.00	0.14
2	002096	南岭民爆	24,600	254,856.00	0.13
3	002635	安洁科技	15,500	253,115.00	0.13
4	688639	华恒生物	2,000	251,800.00	0.13
5	603212	赛伍技术	14,300	248,391.00	0.13
6	300323	华灿光电	33,600	245,952.00	0.13
7	300401	花园生物	20,700	244,467.00	0.13
8	688209	英集芯	13,600	242,896.00	0.13
9	603877	太平鸟	14,200	242,536.00	0.13
10	600312	平高电气	18,700	237,303.00	0.12

#### 5.3.2 报告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前五名股票投资明细

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	002282	博深股份	28,200	228,420.00	0.12
2	002743	富煌钢构	37,300	223,054.00	0.12
3	300281	金明精机	36,900	221,031.00	0.12
4	603012	创力集团	37,300	220,443.00	0.12
5	300440	运达科技	29,200	217,540.00	0.11

### 5.4 报告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。

### 5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

## 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资 明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

## 5.7 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。

## 5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

## 5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量 (买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动 (元)	风险说明
IM2403	中证 1000 股指期货 2403	1	1,169,320.00	-39,860.00	-
公允价值变动总额合计 (元)					-39,860.00
股指期货投资本期收益 (元)					-214,820.00
股指期货投资本期公允价值变动 (元)					64,460.00

### 5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

## 5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

### 5.10.1 本期国债期货投资政策

本基金本报告期末未持有国债期货

### 5.10.2 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 5.11 投资组合报告附注

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内受到公开谴责、处罚的情况。

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。

### 5.11.1 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	140,318.40
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	139,997,025.00
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	140,137,343.40

### 5.11.2 报告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。

### 5.11.3 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 5.11.3.1 报告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。

#### 5.11.3.2 报告期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前十名股票中不存在流通受限情况。

### 5.11.4 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。

## §6 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
报告期期初基金份额总额	49,241,691.09	325,968.29
报告期期间基金总申购份额	160,415,725.36	5,310.96
减:报告期期间基金总赎回份额	56,866.55	20,082.01
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	209,600,549.90	311,197.24

## § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

### 7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期内，基金管理人未持有本基金份额。

### 7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期内，本基金管理人未运用固有资金投资本基金。

## § 8 影响投资者决策的其他重要信息

### 8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比(%)
机构	1	20231001-20231231	0.00	67,514,111.79	0.00	67,514,111.79	32.16
机构	2	20231001-20231231	0.00	55,339,236.30	0.00	55,339,236.30	26.36

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

#### 2、大额申购风险

若投资者大额申购，基金所投资的标的资产未及时准备，导致净值涨幅可能会因此降低。

## 8.2 影响投资者决策的其他重要信息

无。

## § 9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予明亚中证 1000 指数增强型证券投资基金募集注册的文件；
- 2、《明亚中证 1000 指数增强型证券投资基金基金合同》；
- 3、《明亚中证 1000 指数增强型证券投资基金托管协议》；
- 4、基金管理人业务资格批件、营业执照。

### 9.2 存放地点

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

### 9.3 查阅方式

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

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

明亚基金管理有限责任公司

2024 年 1 月 19 日