

天弘国证 2000 指数增强型证券投资基金

2024 年中期报告

2024 年 06 月 30 日

基金管理人:天弘基金管理有限公司

基金托管人:中国农业银行股份有限公司

送出日期:2024 年 08 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。本中期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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年08月28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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2024年01月01日起至2024年06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	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	9
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 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§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 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
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	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	58
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	60
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	60
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	60
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	60
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	60
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	60
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	60
7.12 投资组合报告附注	60
§8 基金份额持有人信息	61
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	61
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	62

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.....	62
§9 开放式基金份额变动.....	63
§10 重大事件揭示.....	63
10.1 基金份额持有人大会决议.....	63
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.....	63
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	63
10.4 基金投资策略的改变.....	64
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	64
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	64
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	64
10.8 其他重大事件.....	65
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	65
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.....	65
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	65
§12 备查文件目录.....	65
12.1 备查文件目录.....	66
12.2 存放地点.....	66
12.3 查阅方式.....	66

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	天弘国证2000指数增强型证券投资基金	
基金简称	天弘国证2000指数增强	
基金主代码	017547	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2023年03月23日	
基金管理人	天弘基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	170,652,655.25份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	天弘国证2000指数增强A	天弘国证2000指数增强C
下属分级基金的交易代码	017547	017548
报告期末下属分级基金的份额总额	81,427,665.19份	89,224,990.06份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票型指数增强基金，在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，力争获取高于标的指数的投资收益。
投资策略	本基金采用指数增强型投资策略，以国证2000指数作为基金投资组合的标的指数，结合深入的宏观面、基本面研究及数量化投资技术，在指数化投资基础上优化调整投资组合，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%，年跟踪误差不超过7.75%，以实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人将采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。本基金运作过程中，当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照基金份额持

	有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。主要产品投资策略包括：资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、参与融资及转融通证券出借业务策略等。
业绩比较基准	国证2000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，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。

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		天弘基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	童建林	任航
	联系电话	022-83310208	010-66060069
	电子邮箱	service@thfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		95046	95599
传真		022-83865564	010-68121816
注册地址		天津自贸试验区（中心商务区）新华路3678号宝风大厦23层	北京市东城区建国门内大街69号
办公地址		天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层	北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9
邮政编码		300203	100031
法定代表人		韩歆毅	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.thfund.com.cn

基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公地址
------------	------------------

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	天弘基金管理有限公司	天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2024年01月01日-2024年06月30日)	
	天弘国证2000指数 增强A	天弘国证2000指数 增强C
本期已实现收益	-11,401,959.10	-12,526,941.94
本期利润	-14,274,780.01	-15,251,872.02
加权平均基金份额本期利润	-0.1633	-0.1560
本期加权平均净值利润率	-20.41%	-19.55%
本期基金份额净值增长率	-17.25%	-17.37%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2024年06月30日)	
期末可供分配利润	-19,679,527.55	-21,821,007.33
期末可供分配基金份额利润	-0.2417	-0.2446
期末基金资产净值	61,748,137.64	67,403,982.73
期末基金份额净值	0.7583	0.7554
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2024年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	-24.17%	-24.46%

注：1、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，开放式基金的申购赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、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。

3、期末可供分配利润为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。

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

天弘国证2000指数增强A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-7.03%	1.54%	-8.54%	1.50%	1.51%	0.04%
过去三个月	-6.39%	1.58%	-11.29%	1.60%	4.90%	-0.02%
过去六个月	-17.25%	2.09%	-18.67%	2.02%	1.42%	0.07%
过去一年	-24.19%	1.61%	-24.60%	1.57%	0.41%	0.04%
自基金合同生效日起至今	-24.17%	1.49%	-26.41%	1.45%	2.24%	0.04%

天弘国证2000指数增强C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-7.05%	1.54%	-8.54%	1.50%	1.49%	0.04%
过去三个月	-6.46%	1.58%	-11.29%	1.60%	4.83%	-0.02%
过去六个月	-17.37%	2.09%	-18.67%	2.02%	1.30%	0.07%
过去一年	-24.41%	1.61%	-24.60%	1.57%	0.19%	0.04%
自基金合同生效日起至今	-24.46%	1.49%	-26.41%	1.45%	1.95%	0.04%

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

天弘国证2000指数增强A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2023年03月23日-2024年06月30日)



天弘国证2000指数增强C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2023年03月23日-2024年06月30日)



注：1、本基金合同于2023年03月23日生效。

2、按照本基金合同的约定，基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。本基金的建仓期为2023年03月23日至2023年09月22日，建仓期结束时及至报告期末，各项资产配置比例均符合基金合同的约定。

§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

天弘基金管理有限公司（以下简称“公司”或“本基金管理人”）经中国证监会证监基金字[2004]164号文批准，于2004年11月8日正式成立，注册资本金为5.143亿元人民币，总部设在天津，在北京、上海、广州、深圳、四川、浙江设有分公司。公司股权结构为：

股东名称	股权比例
蚂蚁科技集团股份有限公司	51%
天津信托有限责任公司	16.8%
内蒙古君正能源化工集团股份有限公司	15.6%
芜湖高新投资有限公司	5.6%
新疆天瑞博丰股权投资合伙企业（有限合伙）	3.5%
新疆天惠新盟股权投资合伙企业（有限合伙）	2%
新疆天阜恒基股权投资合伙企业（有限合伙）	2%
新疆天聚宸兴股权投资合伙企业（有限合伙）	3.5%
合计	100%

截至2024年6月30日，公司共管理运作197只公募基金，公司业务范围涵盖二级市场股票投资、债券投资、现金管理、衍生品投资等。公司始终秉承“稳健理财，值得信赖”的理念，坚持为投资者带来优质的基金产品和理财服务。

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		
张戈	本基金基金经理	2023年04月	-	11年	男，管理科学与工程专业博士。历任建信基金管理有限责任公司研究员、投资经理，大家保险资产管理公司投资经理。2022年9月加盟本公司。
杨超	指数与数量投资部	2023	-	14年	男，金融数学与计算硕士。

	总经理、本基金基金经理	年03月			历任建信基金管理有限责任公司基金经理助理、泰达宏利基金管理有限公司基金经理。2019年1月加盟本公司。
王帅	本基金基金经理助理	2023年04月	-	9年	男，数量经济学专业硕士。2015年6月加盟本公司，历任助理研究员、研究员、高级研究员、投资经理。

注：1、上述任职日期/离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2、本基金基金经理助理协助基金经理进行投资、研究、头寸管理等日常工作。

3、证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金按照国家法律法规及基金合同的相关约定进行操作，不存在违法违规及未履行基金合同承诺的情况。

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其配套规则和其他相关法律法规、基金合同的有关规定，勤勉尽责地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。

本报告期内，本基金运作合法合规，不存在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 公平交易制度的执行情况

公平交易的执行情况包括：建立统一的研究平台和公共信息平台，保证各组合得到公平的投资资讯；公平对待不同投资组合，禁止各投资组合之间进行以利益输送为目的的投资交易活动；在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，严格执行授权审批程序；实行集中交易制度和公平交易分配制度；建立不同投资组合投资信息的管理及保密制度，保证不同投资组合经理之间的重大非公开投资信息的相互隔离；加强对投资交易行为的监察稽核力度，建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估体系等。

报告期内，公司公平交易程序运作良好，未出现异常情况；场外、网下业务公平交易制度执行情况良好，未出现异常情况。

公司对旗下各投资组合的交易行为进行监控和分析，对各投资组合不同时间窗口（1日、3日、5日）内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验，未发现违反公平交易原则的异常交易。

本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况，公司旗下各基金不存在因非公平交易等导致的利益输送行为，公平交易制度的整体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，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%的交易次数为1次，投资组合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易，未导致不公平交易和利益输送。

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

2024年一季度，国证2000指数大幅波动。受中小盘股票大幅下跌影响，春节前指数快速下跌；二季度受到市场风格偏向大盘价值股、以及市场流动性衰退的影响，国证2000指数依然表现不佳。基金管理人通过迭代选股因子，优化风险控制参数，取得一定效果。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2024年06月30日，天弘国证2000指数增强A基金份额净值为0.7583元，天弘国证2000指数增强C基金份额净值为0.7554元。报告期内份额净值增长率天弘国证2000指数增强A为-17.25%，同期业绩比较基准增长率为-18.67%；天弘国证2000指数增强C为-17.37%，同期业绩比较基准增长率为-18.67%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

国证2000指数成分股分散，行业分布均匀，上半年走势主要受到市场风格和流动性影响。在高股息投资，中特估概念等投资导向占主流的情况下，小市值成长股长期处于逆风状态。叠加全市场流动性在二季度末出现显著衰减，以及量化行业受到政策监管等因素影响，指数跌幅显著。展望未来，随着国民经济逐渐见底企稳，权益市场整体有可能筑底企稳，风格偏好有望提升，有利于小市值成长股走出估值修复行情。此外，后续市场风格可能存在高低切换的需要，叠加前期小市值指数跌幅较大，国证2000指数有可能底部反弹。

管理人团队在二季度积极调整策略，在选股和风险控制两端都进行了模型更新迭代，产品超额收益有明显改善。后续管理人将继续迭代选股因子，优化风险控制方案和交易成本控制方案，力争超额收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构，负责制定公司所管理基金的基本估值政策，对公司旗下基金已采用的估值政策、方法、流程的执行情况进行审核监

督，对因经营环境或市场变化等导致需调整已实施的估值政策、方法和流程的，负责审查批准基金估值政策、方法和流程的变更和执行。确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益。估值委员会成员由公司分管投资的高级管理人员、督察长、首席风控官、分管估值业务高级管理人员以及研究管理人员组成。

公司基金估值委员会下设基金估值工作小组，由具备丰富专业知识、两年以上基金行业相关领域工作经历、熟悉基金投资品种定价及基金估值法律法规、具备较强专业胜任能力的基金经理（投资经理）、股票/债券研究员、基金运营部、风险管理部和内控合规部的相关人员组成。

基金经理作为估值工作小组的成员之一，在基金估值定价过程中，充分表达对相关问题及定价方案的意见或建议，参与估值方案提议的制定。但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任。会计师事务所对估值委员会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。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

报告期内，本基金管理人未与任何第三方签订与估值相关的定价服务协议。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内本基金管理人无应说明预警信息。

§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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人-天弘基金管理有限公司2024年01月01日至2024年06月30日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为,天弘基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;在报告期内,严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认为,天弘基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的本基金中期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金持有人利益的行为。

§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：天弘国证2000指数增强型证券投资基金

报告截止日：2024年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	6,641,274.68	9,269,792.26
结算备付金		-	-
存出保证金		-	-
交易性金融资产	6.4.7.2	123,145,647.50	170,209,211.31
其中：股票投资		123,145,647.50	170,209,211.31
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-

应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		273,447.95	1,434,760.59
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		130,060,370.13	180,913,764.16
负债和净资产	附注号	本期末	上年度末
		2024年06月30日	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	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		723,614.18	479,396.28
应付管理人报酬		65,881.84	92,080.87
应付托管费		10,980.30	15,346.80
应付销售服务费		17,170.09	23,899.77
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	6.4.7.6	90,603.35	60,000.00
负债合计		908,249.76	670,723.72
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	170,652,655.25	196,927,968.35
未分配利润	6.4.7.8	-41,500,534.88	-16,684,927.91
净资产合计		129,152,120.37	180,243,040.44
负债和净资产总计		130,060,370.13	180,913,764.16

注：1.报告截止日2024年06月30日，天弘国证2000指数增强型证券投资基金A类基金份额净值0.7583元，天弘国证2000指数增强型证券投资基金C类基金份额净值0.7554

元；基金份额总额170,652,655.25份，其中天弘国证2000指数增强型证券投资基金A类基金份额81,427,665.19份，天弘国证2000指数增强型证券投资基金C类基金份额89,224,990.06份。

2.本财务报表的比较期间为2023年03月23日(基金合同生效日)至2023年06月30日(下同)。

6.2 利润表

会计主体：天弘国证2000指数增强型证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年01月01日至 2024年06月30日	上年度可比期间 2023年03月23日（基金 合同生效日）至2023年 06月30日
一、营业总收入		-28,806,308.98	3,814,331.39
1.利息收入		9,194.70	57,785.37
其中：存款利息收入	6.4.7.9	9,194.70	57,785.37
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		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-” 填列）		-23,272,240.99	-2,141,142.29
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-24,736,876.29	-4,053,640.11
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	91.52
资产支持证券投资 收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-

股利收益	6.4.7.15	1,464,635.30	1,912,406.30
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.16	-5,597,750.99	5,731,227.28
4.汇兑收益(损失以“-”号填列)		-	-
5.其他收入(损失以“-”号填列)	6.4.7.17	54,488.30	166,461.03
减：二、营业总支出		720,343.05	603,354.76
1.管理人报酬		439,620.27	400,789.15
2.托管费		73,270.01	66,798.16
3.销售服务费		115,845.54	111,882.88
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	6.4.7.18	-	-
7.税金及附加		-	-
8.其他费用	6.4.7.19	91,607.23	23,884.57
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-29,526,652.03	3,210,976.63
减：所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-29,526,652.03	3,210,976.63
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-29,526,652.03	3,210,976.63

6.3 净资产变动表

会计主体：天弘国证2000指数增强型证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	196,927,968.35	-16,684,927.91	180,243,040.44
二、本期期初净资产	196,927,968.35	-16,684,927.91	180,243,040.44
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-26,275,313.10	-24,815,606.97	-51,090,920.07
（一）、综合收益总额	-	-29,526,652.03	-29,526,652.03
（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）	-26,275,313.10	4,711,045.06	-21,564,268.04
其中：1.基金申购款	78,992,667.89	-17,445,481.97	61,547,185.92
2.基金赎回款	-105,267,980.99	22,156,527.03	-83,111,453.96
（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	170,652,655.25	-41,500,534.88	129,152,120.37
项目	上年度可比期间 2023年03月23日（基金合同生效日）至2023年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-
二、本期期初净资产	306,148,939.63	-	306,148,939.63

产			
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	21,082,587.27	-131,509.98	20,951,077.29
（一）、综合收益总额	-	3,210,976.63	3,210,976.63
（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）	21,082,587.27	-3,342,486.61	17,740,100.66
其中：1.基金申购款	187,160,749.72	-4,198,775.81	182,961,973.91
2.基金赎回款	-166,078,162.45	856,289.20	-165,221,873.25
（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	327,231,526.90	-131,509.98	327,100,016.92

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：

高阳

薄贺龙

薄贺龙

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

天弘国证2000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]2906号《关于准予天弘国证2000指数增强型证券投资基金注册的批复》准予注册，由天弘基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘国证2000指数增强型证券投资基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集

人民币306,030,372.66元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2023)第0193号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《天弘国证2000指数增强型证券投资基金合同》于2023年3月23日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为306,148,939.63份基金份额，其中认购资金利息折合118,566.97份基金份额。本基金的基金管理人为天弘基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《天弘国证2000指数增强型证券投资基金合同》和《天弘国证2000指数增强型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金根据所收取认购/申购费用、赎回费用、销售服务费方式的差异，将基金份额分为不同的类别。其中：1、在投资人认购/申购、赎回基金时收取认购/申购费用、赎回费用，并不再从本类别基金财产中计提销售服务费的基金份额，称为A类基金份额。2、在投资人认购/申购基金时不收取认购/申购费用、赎回时收取赎回费用，且从本类别基金财产中计提销售服务费的基金份额，称为C类基金份额。本基金A类和C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算并公布基金份额净值和基金份额累计净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘国证2000指数增强型证券投资基金合同》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允许上市的股票、存托凭证)、债券(包括国债、金融债、地方政府债、企业债、公司债、次级债、可转换债券(含可分离交易可转债)、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券)、货币市场工具、同业存单、银行存款、债券回购、股指期货、资产支持证券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(但须符合中国证监会相关规定)。本基金可以根据相关法律法规的规定参与融资和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。基金的投资组合比例为：本基金投资于股票的资产不低于基金资产的90%，投资于标的指数成份股、备选成份股的资产的比例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投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，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：国证2000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

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)

颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《天弘国证2000指数增强型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2024年度上半年财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2024年06月30日的财务状况以及2024年度上半年的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[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[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告2023年第39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日
活期存款	500,100.06
等于：本金	500,000.00
加：应计利息	100.06
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	6,141,174.62
等于：本金	6,140,796.56

加：应计利息	378.06
减：坏账准备	-
合计	6,641,274.68

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	132,240,589.72	-	123,145,647.50	-9,094,942.22
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	132,240,589.72	-	123,145,647.50	-9,094,942.22

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	89,507.60
其他应付款	1,095.75
合计	90,603.35

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 天弘国证2000指数增强A

金额单位：人民币元

项目 (天弘国证2000指数增强A)	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	94,615,652.64	94,615,652.64
本期申购	10,081,594.53	10,081,594.53
本期赎回（以“-”号填列）	-23,269,581.98	-23,269,581.98
本期末	81,427,665.19	81,427,665.19

6.4.7.7.2 天弘国证2000指数增强C

金额单位：人民币元

项目 (天弘国证2000指数增强C)	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	102,312,315.71	102,312,315.71

本期申购	68,911,073.36	68,911,073.36
本期赎回（以“-”号填列）	-81,998,399.01	-81,998,399.01
本期末	89,224,990.06	89,224,990.06

注：申购含转换转入份额；赎回含转换转出份额。

6.4.7.8 未分配利润

6.4.7.8.1 天弘国证2000指数增强A

单位：人民币元

项目 (天弘国证2000指数增强A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-6,136,066.03	-1,775,473.32	-7,911,539.35
本期期初	-6,136,066.03	-1,775,473.32	-7,911,539.35
本期利润	-11,401,959.10	-2,872,820.91	-14,274,780.01
本期基金份额交易产生的变动数	1,980,262.92	526,528.89	2,506,791.81
其中：基金申购款	-1,575,685.91	-573,845.97	-2,149,531.88
基金赎回款	3,555,948.83	1,100,374.86	4,656,323.69
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-15,557,762.21	-4,121,765.34	-19,679,527.55

6.4.7.8.2 天弘国证2000指数增强C

单位：人民币元

项目 (天弘国证2000指数增强C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-6,853,922.04	-1,919,466.52	-8,773,388.56
本期期初	-6,853,922.04	-1,919,466.52	-8,773,388.56
本期利润	-12,526,941.94	-2,724,930.08	-15,251,872.02
本期基金份额交易产生的变动数	2,068,823.52	135,429.73	2,204,253.25
其中：基金申购款	-10,629,750.49	-4,666,199.60	-15,295,950.09

基金赎回款	12,698,574.01	4,801,629.33	17,500,203.34
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-17,312,040.46	-4,508,966.87	-21,821,007.33

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年01月01日至2024年06月30日	
活期存款利息收入	2,015.92	
定期存款利息收入	-	
其他存款利息收入	7,178.78	
结算备付金利息收入	-	
其他	-	
合计	9,194.70	

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年01月01日至2024年06月30日	
卖出股票成交总额	452,350,250.31	
减：卖出股票成本总额	476,376,544.22	
减：交易费用	710,582.38	
买卖股票差价收入	-24,736,876.29	

6.4.7.11 债券投资收益

本基金本报告期未取得债券投资收益。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期未取得资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期未取得贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益**6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期未取得买卖权证差价收入。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期未取得其他衍生工具投资收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
股票投资产生的股利收益	1,464,635.30
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	1,464,635.30

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
1.交易性金融资产	-5,597,750.99
——股票投资	-5,597,750.99
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——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	-5,597,750.99
----	---------------

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
基金赎回费收入	50,509.99
基金转换费收入	3,978.31
合计	54,488.30

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内未发生信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
审计费用	29,835.26
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
汇划手续费	2,099.63
合计	91,607.23

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，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

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
天弘基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
中国农业银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

注：下述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**

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

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	上年度可比期间
	2024年01月01日 至2024年06月30 日	2023年03月23日（基金合同 生效日）至2023年06月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	439,620.27	400,789.15
其中：应支付销售机构的客户维护费	191,613.99	193,979.60
应支付基金管理人的净管理费	248,006.28	206,809.55

注:1、支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值0.60%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×该日适用费率/当年天数。

2、客户维护费是指基金管理人与基金销售机构在基金销售协议中约定的依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，用以向基金销售机构支付客户服务

及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日 至2024年06月30 日	上年度可比期间 2023年03月23日（基金合同生 效日）至2023年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	73,270.01	66,798.16

注:支付基金托管人中国农业银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×该日适用费率/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售 服务费的 各关联方 名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	天弘国证2000指数增强A	天弘国证2000指数增强C	合计
天弘基金 管理有限 公司	-	572.63	572.63
中国农业 银行股份 有限公司	-	5,011.11	5,011.11
合计	-	5,583.74	5,583.74
获得销售 服务费的 各关联方 名称	上年度可比期间 2023年03月23日（基金合同生效日）至2023年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	天弘国证2000指数增强A	天弘国证2000指数增强C	合计
天弘基金 管理有限	-	362.61	362.61

公司			
中国农业 银行股份 有限公司	-	4,008.41	4,008.41
合计	-	4,371.02	4,371.02

注：1、支付基金销售机构的销售服务费按前一日各级基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给天弘基金管理有限公司，再由天弘基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。天弘国证2000指数增强C按0.30%计提销售服务费。销售服务费的计算公式为：

日销售服务费=前一日各级基金资产净值×该日适用费率/当年天数。

2、天弘国证2000指数增强A不收取销售服务费。

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过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未发生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。

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未发生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。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

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

天弘国证2000指数增强A

无

天弘国证2000指数增强C

无

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年03月23日（基金合同生效日） 至2023年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	500,100.06	2,015.92	1,919,537.03	27,484.44

注：本基金由基金托管人中国农业银行股份有限公司保管的银行存款，按银行同业利率或约定利率计息。

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交易。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

天弘国证2000指数增强A

本报告期无利润分配事项。

天弘国证2000指数增强C

本报告期无利润分配事项。

6.4.12 期末（2024年06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**

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
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：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
3015	诺瓦	2024-	6个	创业	126.8	188.0	158	20,04	29,70	-

89	星云	02-01	月	板打 新限售	9	1		8.62	5.58	
3015 89	诺瓦 星云	2024- 05-30	3个 月	锁定 期送 股	-	188.0 1	126	-	23,68 9.26	-
3013 92	汇成 真空	2024- 05-28	6个 月	创业 板打 新限售	12.20	41.66	219	2,67 1.80	9,12 3.54	-
3015 38	骏鼎 达	2024- 03-13	6个 月	创业 板打 新限售	55.82	91.24	68	3,79 5.76	6,20 4.32	-
3015 38	骏鼎 达	2024- 05-22	4个 月	锁定 期送 股	-	91.24	27	-	2,46 3.48	-
3015 66	达利 凯普	2023- 12-22	6个 月	创业 板打 新限售	8.90	16.97	464	4,12 9.60	7,87 4.08	-
3015 36	星辰 科技	2024- 03-20	6个 月	创业 板打 新限售	16.16	32.27	239	3,86 2.24	7,71 2.53	-
3015 39	宏鑫 科技	2024- 04-03	6个 月	创业 板打 新限售	10.64	19.82	327	3,47 9.28	6,48 1.14	-
3015 91	肯特 股份	2024- 02-20	6个 月	创业 板打 新限售	19.43	36.98	156	3,03 1.08	5,76 8.88	-

301588	美新科技	2024-03-06	6个月	创业板打新限售	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-
301565	中仑新材	2024-06-13	6个月	创业板打新限售	11.88	18.98	281	3,338.28	5,333.38	-
301580	C爱迪特	2024-06-19	6个月	创业板打新限售	44.95	65.93	74	3,326.30	4,878.82	-
688709	成都华微	2024-01-31	6个月	科创板打新限售	15.69	18.79	255	4,000.95	4,791.45	-
301502	华阳智能	2024-01-26	6个月	创业板打新限售	28.01	37.83	119	3,333.19	4,501.77	-
301587	中瑞股份	2024-03-27	6个月	创业板打新限售	21.73	25.26	172	3,737.56	4,344.72	-
001389	广合科技	2024-03-26	6个月	新股锁定	17.43	34.56	113	1,969.59	3,905.28	-
601033	永兴股份	2024-01-11	6个月	新股锁定	16.20	15.96	218	3,531.60	3,479.28	-
688584	上海合晶	2024-02-01	6个月	科创板打新限售	22.66	15.89	205	4,645.30	3,257.45	-
603341	龙旗	2024-02-23	6个	新股	26.00	37.49	62	1,612.00	2,324.38	-

	科技		月	锁定						
001387	雪祺电气	2024-01-04	6个月	新股锁定	15.38	15.25	106	1,630.28	1,616.50	-
001387	雪祺电气	2024-06-03	2个月	锁定期送股	-	15.25	31	-	472.75	-
001359	平安电工	2024-03-19	6个月	新股锁定	17.39	20.60	95	1,652.05	1,957.00	-
603082	北自科技	2024-01-23	6个月	新股锁定	21.28	29.49	64	1,361.92	1,887.36	-
603325	博隆技术	2024-01-03	6个月	新股锁定	72.46	68.06	24	1,739.04	1,633.44	-
603375	盛景微	2024-01-17	6个月	新股锁定	38.18	38.90	41	1,565.38	1,594.90	-
001379	腾达科技	2024-01-11	6个月	新股锁定	16.98	13.48	117	1,986.66	1,577.16	-
603312	西典新能	2024-01-04	6个月	新股锁定	29.02	25.36	57	1,654.14	1,445.52	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股中需要限售的部分或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

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的股票。

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

截至本报告期末2024年06月30日，本基金未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2024年06月30日，本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

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

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型指数基金，采用指数复制投资策略，按照个股在标的指数中的基准权重构建股票组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应地调整，以复制和跟踪标的指数。本基金在日常经营活动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。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，力争获取高于标的指数的投资收益。本基金的基金管理人奉行全面风险管理理念，建立了以风险委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、内控合规部、风险管理部、内审部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。在全面风险管理体系的框架下，董事会负责监督检查公司的合法合规运营、内部控制、风险管理，从而控制公司的整体运营风险。在董事会下设立风险委员会，负责审议风险管理的宏观政策，指导监督公司风险管理目标的落实等；在管理层层面设立风险管理委员会，主要负责指导、协调和监督各业务或职能部门开展风险管理工作；决定公司风险控制政策和程序，审批公司风险管理标准和重要业务风险管理口径；听取风险汇报，并就报告的重大风险管理事项进行决策；听取创新业务或产品风险评估报告；组织和协调重大风险事件的应对，直至风险得到妥善处理；审议公司重要的风险管理制度和流程。在业务操作层面风险管理职责主要由内控合规部和风险管理部负责，内控合规部负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理提供合规控制标准，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标；内控合规部对公司总经理负责，并由督察长分管。风险管理部通过投资交易系统的风控参数设置，保证各投资组合的投资比例合规；参与各投资组合新股申购、一级债申购、银行间交易等场外交易的风险识别与评估，保证各投资组合场外交易的事中合规控制；负责各投资组合投资绩效、大类风险的识别、计量和控制。风险管理部由督察长分管。内审部对公司内部控制和风险管理的有效性，经营效率和效果等方面开展独立评价活动，向总经理和督察长汇报。本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而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，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

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。本基金的活期银行存款和定期存款存放在本基金的托管人中国农业银行股份有限公司及其他具有基金托管资格的国有银行和大型股份制银行，并实施不同区间的额度管理，因而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，本基金以非约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司出借证券，本基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近1年的分类结果为A类，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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级的债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级的同业存单。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级的债券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级的同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。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。此外，基金管理人经与基金托管人协商，在确保投资者得到公平对待的前提下，可依照法律法规及基金合同的约定，综合运用各类流动性风险管理工具，对赎回申请等进行适度调整，作为特定情形下基金管理人流动性风险管理的辅助措施。

于2024年6月30日，本基金所承担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。

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严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《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的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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的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%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注6.4.12。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。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的

15%。本期末，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合法律法规的相关要求。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。本期末，本基金组合资产中7个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了交易对手管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

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。

本基金的管理人定期对组合中债券投资和资产支持证券投资部分面临的利率风险进行监控，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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2024年06月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	6,641,274.68	-	-	-	6,641,274.68
交易性金融资产	-	-	-	123,145,647.50	123,145,647.50

应收申购款	-	-	-	273,447.95	273,447.95
资产总计	6,641,274.68	-	-	123,419,095.45	130,060,370.13
负债					
应付赎回款	-	-	-	723,614.18	723,614.18
应付管理人报酬	-	-	-	65,881.84	65,881.84
应付托管费	-	-	-	10,980.30	10,980.30
应付销售服务费	-	-	-	17,170.09	17,170.09
其他负债	-	-	-	90,603.35	90,603.35
负债总计	-	-	-	908,249.76	908,249.76
利率敏感度缺口	6,641,274.68	-	-	122,510,845.69	129,152,120.37
上年度末 2023年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	9,269,792.26	-	-	-	9,269,792.26
交易性金融资产	-	-	-	170,209,211.31	170,209,211.31
应收申购款	-	-	-	1,434,760.59	1,434,760.59
资产总计	9,269,792.26	-	-	171,643,971.90	180,913,764.16
负债					
应付赎回款	-	-	-	479,396.28	479,396.28
应付管理人报酬	-	-	-	92,080.87	92,080.87
应付托管费	-	-	-	15,346.80	15,346.80
应付销售服务费	-	-	-	23,899.77	23,899.77
其他负债	-	-	-	60,000.00	60,000.00
负债总计	-	-	-	670,723.72	670,723.72
利率敏感度缺口	9,269,792.26	-	-	170,973,248.18	180,243,040.44

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2024年06月30日，本基金未持有交易性债券投资(2023年12月31日：同)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响(2023年12月31日：同)。

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。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

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。

本基金采用指数增强型投资策略，以国证2000指数作为基金投资组合的标的指数，结合深入的宏观面、基本面研究及数量化投资技术，在指数化投资基础上优化调整投资组合。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于股票的资产不低于基金资产的90%，投资于标的指数成份股、备选成份股的资产的比例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。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，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。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日		上年度末 2023年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	123,145,647.50	95.35	170,209,211.31	94.43
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	123,145,647.50	95.35	170,209,211.31	94.43

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币元)	
		本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
	业绩比较基准上升5%	6,613,428.05	9,045,349.11
	业绩比较基准下降5%	-6,613,428.05	-9,045,349.11

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	122,992,162.28	166,548,822.90
第二层次	-	2,994,276.00
第三层次	153,485.22	666,112.41
合计	123,145,647.50	170,209,211.31

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的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

于2024年06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(2023年12月31日：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	123,145,647.50	94.68
	其中：股票	123,145,647.50	94.68
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	6,641,274.68	5.11
8	其他各项资产	273,447.95	0.21
9	合计	130,060,370.13	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	379,873.00	0.29
B	采矿业	3,169,029.00	2.45
C	制造业	81,250,890.21	62.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,362,797.00	3.38
E	建筑业	1,836,772.00	1.42
F	批发和零售业	2,858,115.60	2.21
G	交通运输、仓储和邮政业	2,262,520.00	1.75
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	13,087,281.69	10.13
J	金融业	1,440,620.00	1.12
K	房地产业	2,524,660.00	1.95
L	租赁和商务服务业	1,349,357.00	1.04
M	科学研究和技术服务业	3,884,720.30	3.01
N	水利、环境和公共设施管理业	630,760.00	0.49
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	264,244.00	0.20
Q	卫生和社会工作	238,206.00	0.18
R	文化、体育和娱乐业	1,049,922.00	0.81
S	综合	-	-

	合计	120,589,767.80	93.37
--	----	----------------	-------

7.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	354,438.00	0.27
C	制造业	2,140,328.61	1.66
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	-	-
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	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	1,896.81	0.00
M	科学研究和技术服务业	55,737.00	0.04
N	水利、环境和公共设施管理业	3,479.28	0.00
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	2,555,879.70	1.98

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	300045	华力创通	69,900	1,233,735.00	0.96
2	002106	莱宝高科	111,500	1,215,350.00	0.94
3	601369	陕鼓动力	142,600	1,143,652.00	0.89
4	603337	杰克股份	43,400	1,142,288.00	0.88
5	603299	苏盐井神	119,700	1,137,150.00	0.88
6	002315	焦点科技	42,000	1,132,320.00	0.88
7	000550	江铃汽车	51,700	1,122,407.00	0.87
8	002140	东华科技	143,000	1,108,250.00	0.86
9	002980	华盛昌	50,400	1,103,256.00	0.85
10	688222	成都先导	96,808	1,098,770.80	0.85
11	603053	成都燃气	113,600	1,097,376.00	0.85
12	300441	鲍斯股份	183,500	1,088,155.00	0.84
13	600618	氯碱化工	123,000	1,079,940.00	0.84
14	000795	英洛华	190,500	1,055,370.00	0.82
15	300685	艾德生物	59,400	1,047,816.00	0.81
16	300369	绿盟科技	198,000	1,011,780.00	0.78
17	000920	沃顿科技	136,800	1,002,744.00	0.78
18	688365	光云科技	165,348	995,394.96	0.77
19	688588	凌志软件	144,803	991,900.55	0.77
20	002158	汉钟精机	59,300	991,496.00	0.77
21	688123	聚辰股份	16,275	990,008.25	0.77
22	600971	恒源煤电	82,300	982,662.00	0.76
23	000923	河钢资源	56,900	979,818.00	0.76
24	002017	东信和平	116,810	973,027.30	0.75
25	002449	国星光电	133,200	948,384.00	0.73
26	688018	乐鑫科技	9,481	935,585.08	0.72
27	001338	永顺泰	93,400	915,320.00	0.71

28	002267	陕天然气	120,100	907,956.00	0.70
29	688088	虹软科技	31,140	898,700.40	0.70
30	300384	三联虹普	66,700	875,104.00	0.68
31	601512	中新集团	114,500	872,490.00	0.68
32	300679	电连技术	21,400	860,922.00	0.67
33	300634	彩讯股份	50,800	854,964.00	0.66
34	688138	XD清溢光	39,188	842,542.00	0.65
35	603103	横店影视	60,300	834,552.00	0.65
36	301219	腾远钴业	21,400	818,764.00	0.63
37	301050	雷电微力	16,900	813,904.00	0.63
38	002107	沃华医药	207,100	813,903.00	0.63
39	688408	中信博	8,833	813,342.64	0.63
40	688510	航亚科技	42,995	791,537.95	0.61
41	600776	东方通信	80,200	788,366.00	0.61
42	000600	建投能源	123,800	779,940.00	0.60
43	300657	弘信电子	51,800	778,036.00	0.60
44	300048	合康新能	167,400	775,062.00	0.60
45	002845	同兴达	58,600	774,692.00	0.60
46	300113	顺网科技	74,800	765,952.00	0.59
47	000551	创元科技	87,500	763,875.00	0.59
48	000848	承德露露	97,100	763,206.00	0.59
49	300492	华图山鼎	8,100	763,020.00	0.59
50	300193	佳士科技	102,800	762,776.00	0.59
51	600351	亚宝药业	135,600	760,716.00	0.59
52	002215	诺普信	102,100	760,645.00	0.59
53	688150	莱特光电	39,017	756,929.80	0.59
54	601700	风范股份	171,800	754,202.00	0.58
55	603408	建霖家居	57,100	753,149.00	0.58
56	603212	赛伍技术	68,000	750,720.00	0.58
57	002697	红旗连锁	162,100	750,523.00	0.58
58	605183	XD确成股	48,000	742,080.00	0.57

59	000797	中国武夷	317,700	740,241.00	0.57
60	002543	万和电气	74,100	738,036.00	0.57
61	600897	厦门空港	58,500	737,685.00	0.57
62	601008	连云港	214,300	737,192.00	0.57
63	003039	顺控发展	58,800	736,764.00	0.57
64	603897	长城科技	41,900	735,345.00	0.57
65	002801	微光股份	38,700	733,752.00	0.57
66	603013	亚普股份	54,200	730,074.00	0.57
67	603367	辰欣药业	52,200	727,668.00	0.56
68	000931	中关村	205,500	725,415.00	0.56
69	605018	长华集团	79,900	723,894.00	0.56
70	300453	三鑫医疗	112,600	719,514.00	0.56
71	603093	南华期货	82,200	711,852.00	0.55
72	601886	江河集团	143,900	702,232.00	0.54
73	600114	东睦股份	47,000	676,330.00	0.52
74	002707	众信旅游	110,900	636,566.00	0.49
75	002412	汉森制药	123,000	635,910.00	0.49
76	300857	协创数据	10,800	615,600.00	0.48
77	002833	弘亚数控	32,400	590,976.00	0.46
78	601566	九牧王	69,600	586,032.00	0.45
79	600480	凌云股份	59,400	583,902.00	0.45
80	603308	应流股份	46,500	577,530.00	0.45
81	605007	五洲特纸	45,000	568,350.00	0.44
82	688608	恒玄科技	3,726	545,411.88	0.42
83	603039	泛微网络	17,100	543,096.00	0.42
84	601500	通用股份	100,900	538,806.00	0.42
85	300439	美康生物	58,300	534,028.00	0.41
86	300011	鼎汉技术	106,700	532,433.00	0.41
87	000973	佛塑科技	132,000	487,080.00	0.38
88	300522	世名科技	43,300	478,465.00	0.37
89	000969	安泰科技	58,500	463,905.00	0.36

90	002237	恒邦股份	40,300	463,853.00	0.36
91	002839	张家港行	114,900	461,898.00	0.36
92	600449	宁夏建材	39,200	460,600.00	0.36
93	601326	秦港股份	144,400	457,748.00	0.35
94	600458	时代新材	44,600	450,460.00	0.35
95	000543	皖能电力	48,900	432,765.00	0.34
96	601126	四方股份	22,500	432,450.00	0.33
97	605116	奥锐特	17,000	425,510.00	0.33
98	002245	蔚蓝锂芯	54,700	423,925.00	0.33
99	002332	仙琚制药	36,800	419,888.00	0.33
100	600420	国药现代	39,200	418,656.00	0.32
101	600285	羚锐制药	17,100	413,991.00	0.32
102	603283	赛腾股份	5,400	412,560.00	0.32
103	300079	数码视讯	101,300	411,278.00	0.32
104	300986	志特新材	59,200	400,784.00	0.31
105	002351	漫步者	30,400	399,760.00	0.31
106	688399	硕世生物	5,900	398,958.00	0.31
107	300031	宝通科技	27,700	398,049.00	0.31
108	601827	三峰环境	46,800	397,332.00	0.31
109	300674	宇信科技	35,800	396,664.00	0.31
110	300638	广和通	23,100	395,010.00	0.31
111	300870	欧陆通	9,100	394,758.00	0.31
112	002519	银河电子	79,900	392,309.00	0.30
113	603730	岱美股份	38,840	386,069.60	0.30
114	002020	京新药业	36,700	384,249.00	0.30
115	002469	三维化学	67,400	384,180.00	0.30
116	300962	中金辐照	28,100	383,284.00	0.30
117	600459	贵研铂业	28,300	382,333.00	0.30
118	002238	天威视讯	48,600	381,510.00	0.30
119	601616	广电电气	131,100	381,501.00	0.30
120	000029	深深房A	35,700	379,491.00	0.29

121	603698	航天工程	31,600	378,252.00	0.29
122	002782	可立克	33,900	375,612.00	0.29
123	603297	永新光学	6,200	375,038.00	0.29
124	002852	道道全	51,800	372,960.00	0.29
125	603629	利通电子	20,200	372,892.00	0.29
126	603515	欧普照明	21,500	372,810.00	0.29
127	605016	百龙创园	18,300	372,771.00	0.29
128	300005	探路者	74,400	372,744.00	0.29
129	688560	明冠新材	34,800	370,620.00	0.29
130	002912	中新赛克	20,900	370,348.00	0.29
131	603399	吉翔股份	59,800	370,162.00	0.29
132	601101	昊华能源	40,100	368,519.00	0.29
133	688798	艾为电子	6,500	368,030.00	0.28
134	600201	生物股份	50,900	366,989.00	0.28
135	000811	冰轮环境	37,800	364,770.00	0.28
136	688179	阿拉丁	37,700	364,559.00	0.28
137	603489	八方股份	13,500	364,230.00	0.28
138	300307	慈星股份	61,200	364,140.00	0.28
139	300377	赢时胜	71,400	362,712.00	0.28
140	603158	腾龙股份	51,200	360,448.00	0.28
141	002053	云南能投	29,700	359,073.00	0.28
142	300858	科拓生物	24,300	357,696.00	0.28
143	300389	艾比森	29,100	357,348.00	0.28
144	300667	必创科技	26,400	357,192.00	0.28
145	600335	XD国机汽	61,800	356,586.00	0.28
146	688336	三生国健	17,500	356,125.00	0.28
147	000758	中色股份	69,800	354,584.00	0.27
148	002979	雷赛智能	19,400	353,080.00	0.27
149	301316	慧博云通	24,000	352,320.00	0.27
150	002907	华森制药	27,700	349,574.00	0.27
151	688699	明微电子	11,000	349,250.00	0.27

152	600628	新世界	64,400	349,048.00	0.27
153	688108	赛诺医疗	38,777	346,666.38	0.27
154	688380	中微半导	20,700	346,104.00	0.27
155	688372	伟测科技	8,700	342,171.00	0.26
156	300341	麦克奥迪	39,400	338,052.00	0.26
157	002970	锐明技术	9,300	335,079.00	0.26
158	002988	豪美新材	21,800	334,630.00	0.26
159	600210	紫江企业	62,500	332,500.00	0.26
160	603727	博迈科	25,100	330,316.00	0.26
161	002419	天虹股份	78,600	328,548.00	0.25
162	300559	佳发教育	32,800	313,896.00	0.24
163	603556	海兴电力	6,700	313,761.00	0.24
164	601702	华峰铝业	16,700	304,942.00	0.24
165	688025	杰普特	7,500	302,925.00	0.23
166	300768	迪普科技	25,300	299,805.00	0.23
167	002035	华帝股份	47,200	294,056.00	0.23
168	300134	大富科技	43,000	293,260.00	0.23
169	003040	楚天龙	23,200	285,360.00	0.22
170	603239	浙江仙通	20,800	285,168.00	0.22
171	300039	上海凯宝	53,000	283,550.00	0.22
172	603258	电魂网络	17,500	282,625.00	0.22
173	603949	雪龙集团	25,000	281,500.00	0.22
174	600987	航民股份	39,700	280,282.00	0.22
175	600237	铜峰电子	53,600	279,792.00	0.22
176	000906	浙商中拓	41,400	279,036.00	0.22
177	002041	登海种业	34,200	276,336.00	0.21
178	600882	妙可蓝多	22,100	275,587.00	0.21
179	600266	城建发展	70,800	264,792.00	0.21
180	300783	三只松鼠	12,100	264,627.00	0.20
181	605098	行动教育	6,200	264,244.00	0.20
182	002933	新兴装备	11,400	261,174.00	0.20

183	688371	菲沃泰	25,700	258,028.00	0.20
184	002139	拓邦股份	24,100	255,942.00	0.20
185	002623	亚玛顿	15,000	249,450.00	0.19
186	002556	辉隆股份	59,300	247,281.00	0.19
187	300226	上海钢联	14,400	243,936.00	0.19
188	688621	阳光诺和	5,655	241,468.50	0.19
189	300194	福安药业	64,300	240,482.00	0.19
190	301103	何氏眼科	11,100	238,206.00	0.18
191	300841	康华生物	4,700	238,008.00	0.18
192	600475	华光环能	26,800	233,428.00	0.18
193	603906	龙蟠科技	29,600	230,584.00	0.18
194	002534	西子洁能	23,000	230,230.00	0.18
195	002284	亚太股份	32,100	216,996.00	0.17
196	002752	昇兴股份	42,700	216,062.00	0.17
197	000810	创维数字	24,800	212,784.00	0.16
198	688586	江航装备	22,800	212,040.00	0.16
199	300493	润欣科技	24,300	196,587.00	0.15
200	300286	安科瑞	8,900	192,596.00	0.15
201	600184	光电股份	22,500	191,475.00	0.15
202	301102	兆讯传媒	16,100	189,819.00	0.15
203	688258	卓易信息	5,647	188,609.80	0.15
204	688368	晶丰明源	3,360	186,144.00	0.14
205	688127	蓝特光学	10,100	185,739.00	0.14
206	301333	诺思格	5,500	184,855.00	0.14
207	603758	秦安股份	24,300	184,680.00	0.14
208	603328	依顿电子	23,400	183,924.00	0.14
209	600229	城市传媒	26,400	181,896.00	0.14
210	000517	荣安地产	65,700	176,076.00	0.14
211	688389	普门科技	10,800	175,608.00	0.14
212	000557	西部创业	45,500	171,080.00	0.13
213	000531	穗恒运 A	31,200	166,920.00	0.13

214	300119	瑞普生物	12,200	166,164.00	0.13
215	002948	青岛银行	48,500	163,445.00	0.13
216	688076	诺泰生物	2,000	156,560.00	0.12
217	605005	合兴股份	9,800	156,408.00	0.12
218	605388	均瑶健康	27,420	150,261.60	0.12
219	000990	诚志股份	19,900	148,056.00	0.11
220	002990	盛视科技	7,300	146,949.00	0.11
221	300951	博硕科技	4,600	143,290.00	0.11
222	300592	华凯易佰	12,520	143,103.60	0.11
223	300953	震裕科技	2,600	140,920.00	0.11
224	603983	丸美股份	5,100	140,403.00	0.11
225	002023	海特高新	15,000	137,250.00	0.11
226	002706	良信股份	19,900	136,514.00	0.11
227	688378	奥来德	5,800	136,068.00	0.11
228	000544	中原环保	16,900	133,003.00	0.10
229	300978	东箭科技	14,300	131,989.00	0.10
230	688661	和林微纳	3,968	121,619.20	0.09
231	002088	鲁阳节能	9,900	119,691.00	0.09
232	300772	运达股份	12,300	118,080.00	0.09
233	002615	哈尔斯	18,800	116,560.00	0.09
234	688590	新致软件	8,948	115,429.20	0.09
235	000707	双环科技	16,600	113,544.00	0.09
236	605179	一鸣食品	12,400	113,212.00	0.09
237	603569	长久物流	16,400	112,504.00	0.09
238	605218	伟时电子	6,800	109,820.00	0.09
239	600479	千金药业	10,500	106,785.00	0.08
240	688209	英集芯	8,600	106,726.00	0.08
241	600814	杭州解百	18,000	106,200.00	0.08
242	688252	天德钰	7,300	106,069.00	0.08
243	688236	春立医疗	7,400	104,932.00	0.08
244	002837	英维克	4,900	104,811.00	0.08

245	300972	万辰集团	4,900	103,537.00	0.08
246	688362	甬矽电子	5,148	100,180.08	0.08
247	603429	集友股份	23,100	95,865.00	0.07
248	600908	无锡银行	18,000	95,760.00	0.07
249	002658	雪迪龙	18,500	94,905.00	0.07
250	002688	金河生物	26,000	94,380.00	0.07
251	300158	振东制药	24,200	92,444.00	0.07
252	300532	今天国际	7,500	92,175.00	0.07
253	002100	天康生物	13,300	92,169.00	0.07
254	601069	西部黄金	7,700	89,551.00	0.07
255	600993	马应龙	3,300	88,011.00	0.07
256	603266	天龙股份	5,100	86,292.00	0.07
257	002636	金安国纪	13,300	84,455.00	0.07
258	600312	平高电气	4,300	83,635.00	0.06
259	600523	贵航股份	8,300	82,170.00	0.06
260	000897	津滨发展	38,600	79,130.00	0.06
261	300997	欢乐家	6,600	78,012.00	0.06
262	603032	德新科技	6,800	77,724.00	0.06
263	688776	国光电气	1,400	77,560.00	0.06
264	688484	南芯科技	2,000	74,200.00	0.06
265	002034	旺能环境	5,600	72,856.00	0.06
266	002955	鸿合科技	2,900	67,802.00	0.05
267	002036	联创电子	10,000	67,500.00	0.05
268	688566	吉贝尔	2,965	66,712.50	0.05
269	688550	瑞联新材	2,769	64,213.11	0.05
270	688160	步科股份	1,600	63,984.00	0.05
271	300397	天和防务	6,800	62,560.00	0.05
272	688029	南微医学	1,000	61,560.00	0.05
273	002651	利君股份	11,000	60,390.00	0.05
274	688201	信安世纪	5,000	59,050.00	0.05
275	688800	瑞可达	2,100	58,968.00	0.05

276	300490	华自科技	8,200	58,712.00	0.05
277	603277	银都股份	1,900	57,076.00	0.04
278	600301	华锡有色	2,800	56,616.00	0.04
279	002274	华昌化工	6,600	48,972.00	0.04
280	688358	祥生医疗	1,800	46,746.00	0.04
281	601975	招商南油	12,900	46,311.00	0.04
282	300203	聚光科技	4,300	43,387.00	0.03
283	300673	佩蒂股份	3,200	41,984.00	0.03
284	688095	福昕软件	900	41,229.00	0.03
285	300131	英唐智控	9,200	40,940.00	0.03
286	605136	丽人丽妆	7,200	39,672.00	0.03
287	600645	中源协和	2,400	38,640.00	0.03
288	600874	创业环保	6,300	35,217.00	0.03
289	603368	柳药集团	2,000	35,000.00	0.03
290	300842	帝科股份	900	34,920.00	0.03
291	300378	鼎捷软件	2,000	32,540.00	0.03
292	688533	上声电子	1,200	31,044.00	0.02
293	002570	贝因美	13,000	30,420.00	0.02
294	002952	亚世光电	1,400	28,770.00	0.02
295	002297	博云新材	4,700	28,200.00	0.02
296	603859	能科科技	1,300	27,326.00	0.02
297	300468	四方精创	3,100	26,846.00	0.02
298	603929	亚翔集成	1,100	26,290.00	0.02
299	601801	皖新传媒	3,500	24,255.00	0.02
300	002302	西部建设	4,200	21,840.00	0.02
301	002790	瑞尔特	2,300	20,769.00	0.02
302	002154	报喜鸟	3,200	17,408.00	0.01
303	002296	辉煌科技	1,600	16,496.00	0.01
304	688053	思科瑞	600	14,772.00	0.01
305	002437	誉衡药业	8,500	14,450.00	0.01
306	603803	瑞斯康达	2,000	14,200.00	0.01

307	600605	汇通能源	500	12,440.00	0.01
308	688486	龙迅股份	200	11,460.00	0.01
309	002919	名臣健康	800	9,288.00	0.01
310	300406	九强生物	600	9,228.00	0.01
311	600576	祥源文旅	2,100	9,219.00	0.01
312	002961	瑞达期货	700	7,665.00	0.01
313	688508	芯朋微	200	7,274.00	0.01
314	002695	煌上煌	1,100	7,139.00	0.01
315	001337	四川黄金	300	6,963.00	0.01
316	600211	西藏药业	200	6,516.00	0.01
317	688626	XD翔宇医	200	6,348.00	0.00
318	600557	康缘药业	400	6,280.00	0.00
319	301327	华宝新能	100	5,730.00	0.00
320	688177	百奥泰	184	3,886.08	0.00
321	002892	科力尔	40	384.00	0.00
322	688235	百济神州	1	115.84	0.00
323	688206	概伦电子	2	29.70	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300615	欣天科技	38,000	363,660.00	0.28
2	000426	兴业银锡	26,100	354,438.00	0.27
3	603676	卫信康	44,000	352,440.00	0.27
4	300573	兴齐眼药	1,680	275,520.00	0.21
5	603680	今创集团	29,300	193,380.00	0.15
6	688505	复旦张江	26,700	170,880.00	0.13
7	301459	丰茂股份	3,900	154,869.00	0.12
8	300735	光弘科技	6,800	146,880.00	0.11

9	605060	联德股份	6,900	99,153.00	0.08
10	688338	赛科希德	3,800	82,270.00	0.06
11	605099	共创草坪	3,500	66,185.00	0.05
12	688278	特宝生物	1,224	65,545.20	0.05
13	601965	中国汽研	3,300	55,737.00	0.04
14	301589	诺瓦星云	284	53,394.84	0.04
15	002318	久立特材	700	16,331.00	0.01
16	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.01
17	301538	骏鼎达	95	8,667.80	0.01
18	301566	达利凯普	464	7,874.08	0.01
19	301536	星宸科技	239	7,712.53	0.01
20	301539	宏鑫科技	327	6,481.14	0.01
21	301591	肯特股份	156	5,768.88	0.00
22	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
23	301565	中仑新材	281	5,333.38	0.00
24	301580	C爱迪特	74	4,878.82	0.00
25	688709	成都华微	255	4,791.45	0.00
26	301502	华阳智能	119	4,501.77	0.00
27	301587	中瑞股份	172	4,344.72	0.00
28	001389	广合科技	113	3,905.28	0.00
29	601033	永兴股份	218	3,479.28	0.00
30	688584	上海合晶	205	3,257.45	0.00
31	300721	怡达股份	200	2,564.00	0.00
32	603341	龙旗科技	62	2,324.38	0.00
33	001387	雪祺电气	137	2,089.25	0.00
34	001359	平安电工	95	1,957.00	0.00
35	603373	安邦护卫	69	1,896.81	0.00
36	603082	北自科技	64	1,887.36	0.00
37	603325	博隆技术	24	1,633.44	0.00
38	603375	盛景微	41	1,594.90	0.00
39	001379	腾达科技	117	1,577.16	0.00

40	603312	西典新能	57	1,445.52	0.00
41	300765	新诺威	20	504.60	0.00
42	601096	宏盛华源	32	130.88	0.00
43	301526	国际复材	3	9.99	0.00

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	600312	平高电气	2,304,465.00	1.28
2	603337	杰克股份	2,068,265.00	1.15
3	000061	农产品	2,045,390.00	1.13
4	002017	东信和平	2,004,891.70	1.11
5	002961	瑞达期货	1,985,592.00	1.10
6	300842	帝科股份	1,937,713.00	1.08
7	600007	中国国贸	1,935,254.00	1.07
8	000426	兴业银锡	1,902,984.00	1.06
9	603093	南华期货	1,861,916.00	1.03
10	688365	光云科技	1,837,165.12	1.02
11	301050	雷电微力	1,790,527.00	0.99
12	688371	菲沃泰	1,771,369.30	0.98
13	000931	中关村	1,760,737.00	0.98
14	002315	焦点科技	1,741,227.00	0.97
15	300045	华力创通	1,729,029.00	0.96
16	300679	电连技术	1,694,091.00	0.94
17	300113	顺网科技	1,623,168.00	0.90
18	300441	鲍斯股份	1,619,041.00	0.90
19	688588	凌志软件	1,606,456.94	0.89
20	688222	成都先导	1,586,342.68	0.88

注：本项的"买入金额"均按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）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	600007	中国国贸	2,749,189.00	1.53
2	600312	平高电气	2,674,046.00	1.48
3	002160	常铝股份	2,344,657.00	1.30
4	000061	农产品	2,209,658.00	1.23
5	688568	中科星图	2,205,320.91	1.22
6	002588	史丹利	2,183,330.00	1.21
7	002111	威海广泰	2,111,958.91	1.17
8	002130	沃尔核材	2,077,747.00	1.15
9	601811	新华文轩	1,947,454.00	1.08
10	000426	兴业银锡	1,923,009.00	1.07
11	002961	瑞达期货	1,882,444.00	1.04
12	688337	普源精电	1,865,470.29	1.03
13	300364	中文在线	1,836,761.00	1.02
14	300002	神州泰岳	1,771,218.00	0.98
15	301301	川宁生物	1,732,643.00	0.96
16	002469	三维化学	1,698,840.00	0.94
17	600012	皖通高速	1,691,243.00	0.94
18	300842	帝科股份	1,688,090.60	0.94
19	601827	三峰环境	1,670,834.00	0.93
20	603012	创力集团	1,662,271.00	0.92

注：本项的"卖出金额"均按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）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	434,910,731.40
卖出股票收入（成交）总额	452,350,250.31

注：本项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）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

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券发行主体中，【深圳市华盛昌科技实业股份有限公司】于2024年03月28日收到国家外汇管理局深圳市分局出具公开处罚的通报。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

7.12.2 基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

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	273,447.95
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	273,447.95

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不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持 有 人 户 数	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总 份额	持有份额	占总份 额比例

	(户)			比例		
天弘国证2000指数增强A	1,746	46,636.69	4,021,903.87	4.94%	77,405,761.32	95.06%
天弘国证2000指数增强C	3,780	23,604.49	102,564.10	0.11%	89,122,425.96	99.89%
合计	5,470	31,197.93	4,124,467.97	2.42%	166,528,187.28	97.58%

注：机构/个人投资者持有基金份额占总份额比例的计算中，针对分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

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	天弘国证2000指数增强A	9,435.55	0.01%
	天弘国证2000指数增强C	64,369.93	0.07%
	合计	73,805.48	0.04%

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	天弘国证2000指数增强A	0
	天弘国证2000指数增强C	0

	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	天弘国证2000指数增强A	0
	天弘国证2000指数增强C	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	天弘国证2000指数增强 A	天弘国证2000指数增强 C
基金合同生效日(2023年03月23日)基金份额总额	128,678,441.67	177,470,497.96
本报告期期初基金份额总额	94,615,652.64	102,312,315.71
本报告期基金总申购份额	10,081,594.53	68,911,073.36
减：本报告期基金总赎回份额	23,269,581.98	81,998,399.01
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	81,427,665.19	89,224,990.06

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金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

本报告期内，聂挺进先生担任公司副总经理，具体信息请参见基金管理人在规定媒介披露的《天弘基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。

本报告期内，本基金的基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期内，未发生涉及基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略没有改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金所聘用的会计师事务所未发生变化。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员未发生受稽查或处罚的情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本基金托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中无受稽查或处罚等情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

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	
第一创业证券	5	680,103,325.06	76.71%	340,089.91	79.55%	-
华安证券	2	206,503,534.38	23.29%	87,411.04	20.45%	-

注：1、基金专用交易单元的选择标准为：财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强；具有较强的综合服务能力，能及时、全面提供高质量的关于宏观策略、行业、资本市场、个股分析的研究服务及丰富全面的信息咨询服务；具有较强的证券交易服务能力，能够提供安全、便捷、优质的证券交易服务及合理的佣金费率。

2、基金专用交易单元的选择程序：本基金管理人根据上述标准进行考察后，确定选用交易席位的证券经营机构。然后基金管理人和被选用的证券经营机构签订经纪服务协议。

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	天弘国证2000指数增强型证券投资基金2023年第4季度报告	中国证监会规定媒介	2024-01-22
2	天弘基金将严格落实《证监会新闻发言人就“两融”融券业务有关情况答记者问》相关要求	中国证监会规定媒介	2024-02-06
3	天弘国证2000指数增强型证券投资基金2023年年度报告	中国证监会规定媒介	2024-03-29
4	天弘基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定媒介	2024-03-30
5	天弘国证2000指数增强型证券投资基金2024年第1季度报告	中国证监会规定媒介	2024-04-22
6	天弘国证2000指数增强型证券投资基金（A类份额）基金产品资料概要（更新）	中国证监会规定媒介	2024-06-28
7	天弘国证2000指数增强型证券投资基金（C类份额）基金产品资料概要（更新）	中国证监会规定媒介	2024-06-28

§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**

本报告期内，本基金未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过本基金总份额20%的情况。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准天弘国证2000指数增强型证券投资基金募集的文件
- 2、天弘国证2000指数增强型证券投资基金基金合同
- 3、天弘国证2000指数增强型证券投资基金托管协议
- 4、天弘国证2000指数增强型证券投资基金招募说明书
- 5、报告期内在指定报刊上披露的各项公告
- 6、中国证监会规定的其他文件

12.2 存放地点

天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层

12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公场所及网站或基金托管人的办公场所免费查阅备查文件，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

公司网站：www.thfund.com.cn

天弘基金管理有限公司
二〇二四年八月三十日