

天弘国证 2000 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: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 03 月 29 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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年03月27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。

本报告期自2023年03月23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.....	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、基金净值表现及利润分配情况.....	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	10
§4 管理人报告.....	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
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.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
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.....	16
§5 托管人报告.....	16
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	16
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.....	16
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.....	16
§6 审计报告.....	17
6.1 审计报告基本信息.....	17
6.2 审计报告的基本内容.....	17
§7 年度财务报表.....	19
7.1 资产负债表.....	19
7.2 利润表.....	21
7.3 净资产变动表.....	23
7.4 报表附注.....	24
§8 投资组合报告.....	63
8.1 期末基金资产组合情况.....	63
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	64
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.....	66
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	86
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	90
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.....	90
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.....	90
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.....	90
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.....	90
8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	90

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	91
8.12 投资组合报告附注	91
§9 基金份额持有人信息.....	92
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	92
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	92
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.....	93
§10 开放式基金份额变动.....	93
§11 重大事件揭示.....	94
11.1 基金份额持有人大会决议.....	94
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	94
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	94
11.4 基金投资策略的改变	94
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	94
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	94
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	95
11.8 其他重大事件	96
§12 影响投资者决策的其他重要信息	98
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	98
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	98
§13 备查文件目录.....	98
13.1 备查文件目录	98
13.2 存放地点	98
13.3 查阅方式.....	98

§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	196,927,968.35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	94,615,652.64份	102,312,315.71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
	联系电话	022-83310208
	电子邮箱	service@thfund.com.cn
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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.thfund.com.cn

基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	中国上海市浦东新区东育路588号前滩中心42楼
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、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	本期2023年03月23日（基金合同生效日） - 2023年12月31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	-6,578,039.20	-9,336,488.86
本期利润	-8,305,720.13	-11,105,999.16
加权平均基金份额本期利润	-0.0814	-0.0806
本期加权平均净值利润率	-8.58%	-8.45%
本期基金份额净值增长率	-8.36%	-8.58%
3.1.2 期末数据和指标	2023年末	
期末可供分配利润	-7,911,539.35	-8,773,388.56
期末可供分配基金份额利润	-0.0836	-0.0858
期末基金资产净值	86,704,113.29	93,538,927.15
期末基金份额净值	0.9164	0.9142
3.1.3 累计期末指标	2023年末	
基金份额累计净值增长率	-8.36%	-8.58%

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
过去三个月	-0.91%	1.00%	-1.03%	1.02%	0.12%	-0.02%
过去六个月	-8.38%	0.98%	-7.29%	0.98%	-1.09%	0.00%
自基金合同生效日起至今	-8.36%	0.95%	-9.51%	0.95%	1.15%	0.00%

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
过去三个月	-0.99%	1.01%	-1.03%	1.02%	0.04%	-0.01%
过去六个月	-8.53%	0.98%	-7.29%	0.98%	-1.24%	0.00%
自基金合同生效日起至今	-8.58%	0.95%	-9.51%	0.95%	0.93%	0.00%

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-2023年12月31日)



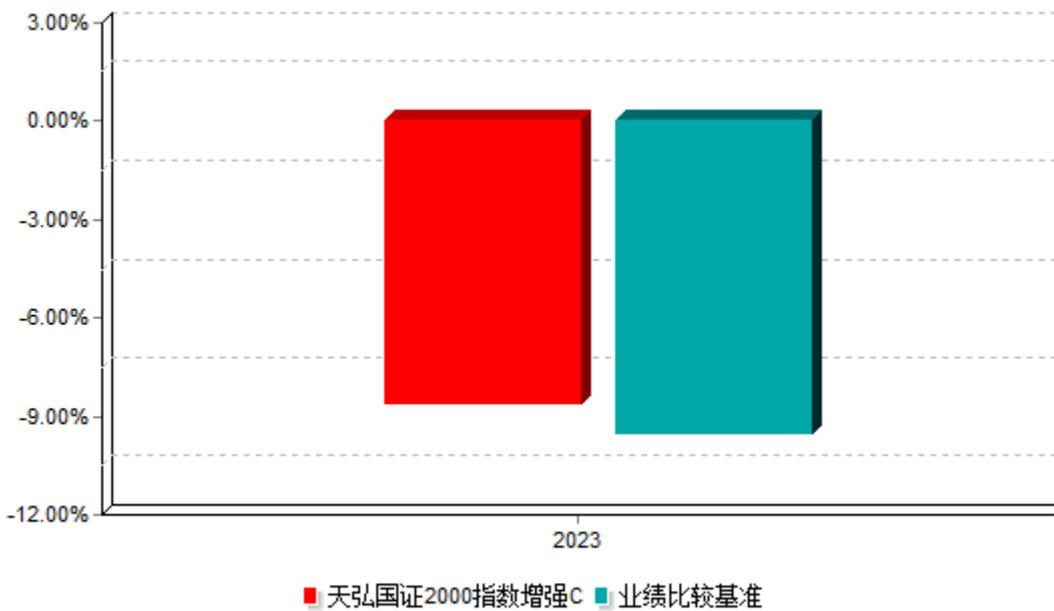
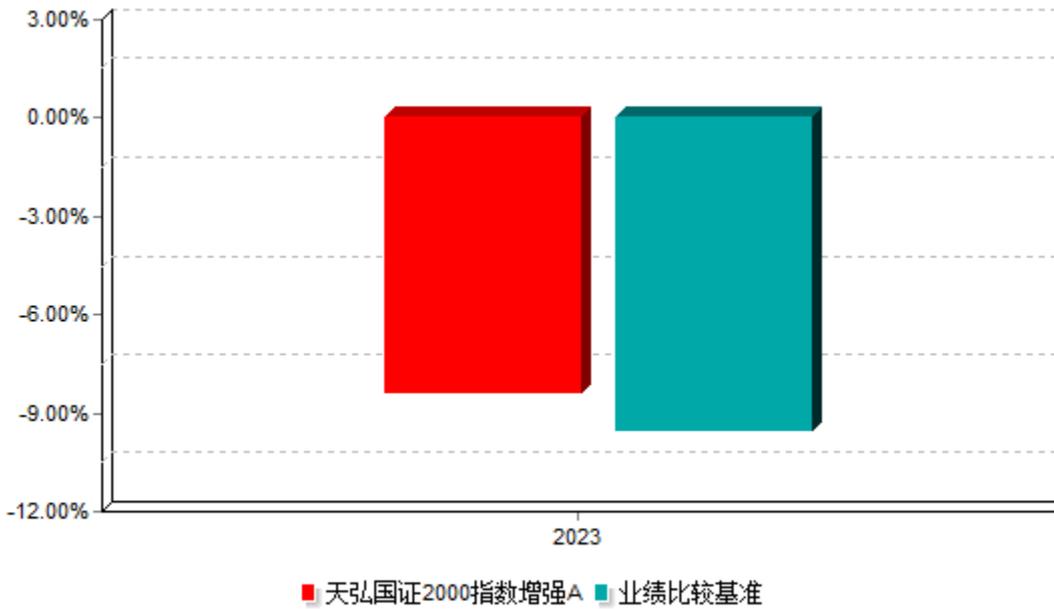
天弘国证2000指数增强C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2023年03月23日-2023年12月31日)



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。

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



注：本基金合同于2023年03月23日生效。基金合同生效当年2023年的净值增长率按照基金合同生效后当年的实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金于2023年03月23日成立，自基金合同生效以来未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

§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2023年12月31日，公司共管理运作189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	-	10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	-	13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	-	8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 公平交易制度和控制方法

基金管理人一直坚持公平对待旗下所有基金的原则，严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，在研究分析、投资决策和交易执行等各个环节落实公平交易原则。公平交易范围包括各类投资组合、所有投资交易品种、以及一级市场申购、二级市场交易等所有投资交易管理活动及授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

针对公司旗下所有投资组合的交易所公开竞价交易，通过交易系统内的公平交易程序，对于不同投资合同同日同向买卖同一证券的指令自动进行比例分配。针对场外网下交易业务，依照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部场外、网下交易业务的相关规定，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。对于以公司名义进行的交易严格按照发行分配的原则或价格优先、比例分配的原则在各投资组合间进行分配。

4.3.2 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。

4.3.3 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5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

2023年国证2000指数先涨后跌，整体小幅震荡，显著强于上证50、沪深300等大盘蓝筹指数。尤其年初受AI概念和泛科技股行情影响指数一度涨幅明显，直至四季度开始跌幅较为明显。整体来看去年指数走势反应出市场流动性逐渐萎缩，缺乏主线的状态。2023年下半年以来相当长一段时间，指数点位变化不大，结构特征亦不明晰。作为中小市值风格代表指数，国证2000指数及增强产品大幅跑赢包括主动投资基金在内的其他标的，在此基础上基金管理人以量化投资模型为工具进行增强取得一定效果。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2023年12月31日，天弘国证2000指数增强A基金份额净值为0.9164元，天弘国证2000指数增强C基金份额净值为0.9142元。报告期内份额净值增长率天弘国证2000指数增强A为-8.36%，同期业绩比较基准增长率为-9.51%；天弘国证2000指数增强C为-8.58%，同期业绩比较基准增长率为-9.51%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

以AI为代表的人工智能技术迭代周期方兴未艾，2024年是相关硬件和内容爆发的年份。以此为核心，华为鸿蒙、苹果产业链、机器人、智能驾驶等科技成长领域仍将有投资机会。这些机会在国证2000及其他小、微市值成长指数上都有映射，随着流动性改善以及市场自发寻底、见底过程逐步完成，2024年国证2000指数及相关增强产品走势仍值得期待。管理人将加速量化因子迭代，在偏离可控的基础上力争更高超额收益。

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，本基金管理人的监察稽核工作一切从合规运作、防范和控制风险、保障基金份额持有人利益出发，由独立的内控合规部门按照规定的权限和程序，认真履行职责，对公司、基金运作及员工行为的合法性、合规性进行定期和不定期监督和检查。发现问题及时提出建议并督促相关部门改进完善，及时与有关人员沟通，并定期制作监察稽核报告报公司董事会。公司经理层面成立了风险管理委员会，根据公司总体风险控制目标，分配各业务和各环节风险控制目标和要求；落实公司重大风险管理的决定或决议；听取并讨论会议成员的报告；对会议成员提出的或发现的已经存在的风险点，在充分讨论、协调基础上形成具体的风险控制措施；对潜在风险点分析讨论，拟定应对措施；对发生的风险事件和重大差错，分析原因、总结经验教训、风险定级、划分责任，向总经理办公会报告。

同时，本基金管理人根据全面性原则、独立性原则、相互制约原则、定性和定量相结合原则、重要性原则建立了一套比较完整的内部控制体系，该内部控制体系由一系列业务管理制度及相应的业务处理、控制程序组成，具体包括控制环境、风险评估、控制活动、信息和沟通、监控等要素。本基金管理人已通过了ISAE3402（《国际鉴证业务准则第3402号》）认证，获得无保留意见的控制设计适当性报告。

本报告期，本基金管理人全面开展基金运作监察稽核工作，确保基金投资、营销及后台运作等各环节的合法合规。通过定期检查、不定期抽查等工作方法，完善内部控制，基金运作没有出现违规行为。本报告期内，本基金管理人有关本基金的监察稽核主要工作如下：

- 1、在研究环节，加强研究业务独立性，注重程序合规和质量控制；在关注研究报告形式与内容的合法性基础上，跟踪检查投资备选库的入选、维护依据；进一步规范新股、新债询价、申购流程；定期检查关联方关系以及关联交易的日常维护；定期评估研究对投资的支持程度，对投资业绩的贡献度；

- 2、在投资交易环节，对投资运作过程中的风险点进行识别和监控，预防和控制由内部或外部流程、人员和系统失控而造成的损失；根据法律法规要求、基金合同约定、投资决策委员会的决定，适时提出增加或优化交易系统风控指标的建议，通过投资交易

系统控制投资风险；跟踪每日的交易行为和交易结果，发现预警信息通过电话、邮件及合规提示及时提醒，保障投资环节的合规运作；监督检查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合规执行情况，保证各投资组合场外交易的事中合规控制；

3、投资管理人员管理环节，加强对投资管理人员即时聊天工具、办公电话、移动电话、终端设备网上交易的合规监控，监督投资管理人员直系亲属账户及股票交易申报制度、交易时间移动电话集中保管制度的有效执行，采取各种有效方式杜绝老鼠仓、非公平交易及各种形式的利益输送行为；

4、基金募集与营销环节，对基金宣传推介材料及定投、费率优惠等基金销售业务活动进行事前合规检查，做到事前防范风险，保障基金营销合法合规。在基金利用互联网平台营销方面，对各类新兴业务的活动方案进行事前合规评估，保证业务开展的同时注重事前风险防范；

5、基金运营环节，加强对注册登记、会计核算、基金清算、估值业务的稽核力度，保证基金运营安全、准确；

6、信息披露环节，严格按照信息披露管理办法的规定，认真做好本基金的信息披露工作，保证信息披露的真实、准确、完整、及时。

报告期内，本基金整体运作合法合规，内部控制和风险防范措施逐步完善，保障了基金份额持有人的利益。本基金管理人将继续以合规运作、防范和控制风险、保障基金份额持有人利益出发，提高内部控制和风险管理的科学性和有效性，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

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。

4.8 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。

4.9 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2023年03月23日至2023年12月31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年度报告中的财务指标、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 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	普华永道中天审字(2024)第24880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	天弘国证2000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>(一)我们审计的内容 我们审计了天弘国证2000指数增强型证券投资基金(以下简称“天弘国证2000指数增强基金”)的财务报表,包括2023年12月31日的资产负债表,2023年3月23日(基金合同生效日)至2023年12月31日止期间的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。(二)我们的意见 我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注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”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了天弘国证2000指数增强基金2023年12月31日的财务状况以及2023年3月23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。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。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于天弘国证2000指数增强基金,并履行了职业道德</p>

	方面的其他责任。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	无
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>天弘国证2000指数增强基金的基金管理人天弘基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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。在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估天弘国证2000指数增强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,除非基金管理人管理层计划清算天弘国证2000指数增强基金、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督天弘国证2000指数增强基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<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。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:(一)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</p>

	<p>险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。(二)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。(三)评价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。(四)对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，就可能对天弘国证2000指数增强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天弘国证2000指数增强基金不能持续经营。(五)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。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	张振波 林佳璐
会计师事务所的地址	中国上海市浦东新区东育路588号前滩中心42楼
审计报告日期	2024-03-27

§7 年度财务报表

7.1 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：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	9,269,792.26
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	7.4.7.2	170,209,211.31
其中：股票投资		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	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收清算款		-
应收股利		-
应收申购款		1,434,760.59
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.5	-
资产总计		180,913,764.16
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		479,396.28
应付管理人报酬		92,080.87
应付托管费		15,346.80

应付销售服务费		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	7.4.7.6	60,000.00
负债合计		670,723.72
净资产：		
实收基金	7.4.7.7	196,927,968.35
未分配利润	7.4.7.8	-16,684,927.91
净资产合计		180,243,040.44
负债和净资产总计		180,913,764.16

注：1.报告截止日2023年12月31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0.9164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0.9142元；基金份额总额196,927,968.35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94,615,652.64份，天弘国证2000指数增强型证券投资基金C类基金份额102,312,315.71份。

2.本财务报表的实际编制期间为2023年03月23日(基金合同生效日)至2023年12月31日，无上一年度可比期间(下同)。

7.2 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：2023年03月23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03月23日（基金合同 生效日）至2023年12月31 日
一、营业总收入		-17,805,053.56
1.利息收入		72,807.64
其中：存款利息收入	7.4.7.9	72,807.64
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）		-14,598,024.01
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-16,990,328.63
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.11	2,546.58
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	-
贵金属投资收益	7.4.7.13	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-
股利收益	7.4.7.15	2,389,758.04
其他投资收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-3,497,191.23
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	217,354.04
减：二、营业总支出		1,606,665.73
1.管理人报酬		1,059,405.49
2.托管费		176,567.54
3.销售服务费		304,467.09
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	7.4.7.18	-
7.税金及附加		-
8.其他费用	7.4.7.19	66,225.61
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-19,411,719.29
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-19,411,719.29
五、其他综合收益的税后净额		-

六、综合收益总额		-19,411,719.29
----------	--	----------------

7.3 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：2023年03月23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03月23日（基金合同生效日）至2023年12月31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
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-109,220,971.28	-16,684,927.91	-125,905,899.19
（一）、综合收益总额	-	-19,411,719.29	-19,411,719.29
（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）	-109,220,971.28	2,726,791.38	-106,494,179.90
其中：1.基金申购款	333,313,466.66	-11,891,557.88	321,421,908.78
2.基金赎回款	-442,534,437.94	14,618,349.26	-427,916,088.68
（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	196,927,968.35	-16,684,927.91	180,243,040.44

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:

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

7.4 报表附注

7.4.1 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 \times 95%+银行活期存款利率(税后) \times 5%。

本财务报表由本基金的基金管理人天弘基金管理有限公司于2024年3月27日批准报出。

7.4.2 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7.4.4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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2023年03月23日(基金合同生效日)至2023年12月31日止期间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2023年12月31日的财务状况以及2023年03月23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等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历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2023年03月23日(基金合同生效日)至2023年12月31日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产、金融负债或权益工具。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、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公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金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。本基金现无金融资产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。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即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。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无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。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/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

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)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；或者(3)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。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应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，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，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。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应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

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

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。本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应

当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，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。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计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认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

本基金参与的转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率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(以下简称“证金公司”)出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息，以及出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为当期损益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

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，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 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并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1)对于证券交易所上市的股票和债券，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《中国证监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。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[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》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和可交换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布〈关于固定收益品种的估值处理标准〉的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和可交换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 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。

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	1,134,683.50
等于：本金	1,134,535.42
加：应计利息	148.08
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	8,135,108.76
等于：本金	8,134,577.96
加：应计利息	530.80
减：坏账准备	-
合计	9,269,792.26

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	173,706,402.54	-	170,209,211.31	-3,497,191.23
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	173,706,402.54	-	170,209,211.31	-3,497,191.23

7.4.7.3 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。

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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

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。

7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

7.4.7.6 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	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	60,000.00
合计	60,000.00

7.4.7.7 实收基金

7.4.7.7.1 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 2023年03月23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	128,678,441.67	128,678,441.67
本期申购	40,877,129.23	40,877,129.23
本期赎回（以“-”号填列）	-74,939,918.26	-74,939,918.26

本期末	94,615,652.64	94,615,652.64
-----	---------------	---------------

7.4.7.7.2 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 2023年03月23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	177,470,497.96	177,470,497.96
本期申购	292,436,337.43	292,436,337.43
本期赎回（以“-”号填列）	-367,594,519.68	-367,594,519.68
本期末	102,312,315.71	102,312,315.71

注：1、申购含转换转入份额；赎回含转换转出份额。

2、本基金合同于2023年03月23日生效,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。

7.4.7.8 未分配利润

7.4.7.8.1 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	-	-	-
本期期初（基金合同生效日）	-	-	-
本期利润	-6,578,039.20	-1,727,680.93	-8,305,720.13
本期基金份额交易产生的变动数	441,973.17	-47,792.39	394,180.78
其中：基金申购款	-1,164,701.10	-728,085.87	-1,892,786.97
基金赎回款	1,606,674.27	680,293.48	2,286,967.75
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-6,136,066.03	-1,775,473.32	-7,911,539.35

7.4.7.8.2 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	-	-	-
本期期初(基金合同生效日)	-	-	-
本期利润	-9,336,488.86	-1,769,510.30	-11,105,999.16
本期基金份额交易产生的变动数	2,482,566.82	-149,956.22	2,332,610.60
其中：基金申购款	-6,148,041.19	-3,850,729.72	-9,998,770.91
基金赎回款	8,630,608.01	3,700,773.50	12,331,381.51
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-6,853,922.04	-1,919,466.52	-8,773,388.56

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年03月23日(基金合同生效日)至2023年12月31日
活期存款利息收入	30,935.43
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	41,872.21
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	72,807.64

7.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期

	2023年03月23日（基金合同生效日）至2023年12月31日
卖出股票成交总额	1,092,151,893.89
减：卖出股票成本总额	1,106,938,468.72
减：交易费用	2,203,753.80
买卖股票差价收入	-16,990,328.63

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年03月23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	1,006.58
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	1,540.00
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	2,546.58

7.4.7.11.2 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03月23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	2,023,860.27
减：卖出债券（债转股及债券到期兑	1,998,620.00

付) 成本总额	
减: 应计利息总额	23,700.27
减: 交易费用	-
买卖债券差价收入	1,540.00

7.4.7.12 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。

7.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期未取得贵金属投资收益。

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 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。

7.4.7.14.2 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。

7.4.7.15 股利收益

单位: 人民币元

项目	本期 2023年03月23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	2,389,758.04
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	2,389,758.04

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位: 人民币元

项目名称	本期 2023年03月23日(基金合同生效日)至2023年12月31日
1.交易性金融资产	-3,497,191.23

——股票投资	-3,497,191.23
——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	-3,497,191.23

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年03月23日（基金合同生效日）至2023年12月31日
基金赎回费收入	217,345.79
基金转换费收入	8.25
合计	217,354.04

7.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内未发生信用减值损失。

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年03月23日（基金合同生效日）至2023年12月31日
审计费用	60,000.00
信息披露费	-

证券出借违约金	-
汇划手续费	5,425.61
开户费	800.00
合计	66,225.61

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，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

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
蚂蚁科技集团股份有限公司	基金管理人的股东
天津信托有限责任公司	基金管理人的股东
内蒙古君正能源化工集团股份有限公司	基金管理人的股东
芜湖高新投资有限公司	基金管理人的股东
新疆天瑞博丰股权投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
新疆天惠新盟股权投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
新疆天阜恒基股权投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
新疆天聚宸兴股权投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
天弘创新资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司

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。

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**

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无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03月23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	1,059,405.49
其中：应支付销售机构的客户维护费	504,793.39
应支付基金管理人的净管理费	554,612.10

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年03月23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	176,567.54

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。

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名称	本期 2023年03月23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		
	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	-	917.63	917.63
中国农业银行股份有限公司	-	9,260.56	9,260.56
合计	-	10,178.19	10,178.19

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。

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

本基金本报告期末与关联方进行过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

本基金本报告期末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。

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

本基金本报告期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。

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

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

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

本基金本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

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03月23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
中国农业银行股份有限公司	1,134,683.50	30,935.43

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。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期未在承销期内参与关联方承销证券交易。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况--固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期无利润分配事项。

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

7.4.12.1.1 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
301487	盟固利	2023-08-01	6个月	创业板打新限售	5.32	40.96	867	4,612.44	35,512.32	-
301348	蓝箭电子	2023-08-01	6个月	创业板打新限售	18.08	44.57	558	10,088.64	24,870.06	-
300904	威力传动	2023-08-02	6个月	创业板打新限售	35.41	61.53	304	10,764.64	18,705.12	-
688548	广钢气体	2023-08-08	6个月	科创板打新限售	9.87	12.75	1,260	12,436.20	16,065.00	-
301172	君逸数码	2023-07-19	6个月	创业板打新限售	31.33	38.16	404	12,657.32	15,416.64	-
301510	固高科技	2023-08-04	6个月	创业板打新限售	12.00	35.01	396	4,752.00	13,863.96	-
301421	波长光电	2023-08-16	6个月	创业板打新限售	29.38	59.37	212	6,228.56	12,586.44	-
301381	赛维时代	2023-07-05	6个月	创业板打	20.45	29.69	400	8,180.00	11,876.00	-

				新限售						
301488	豪恩汽电	2023-06-26	6个月	创业板打新限售	39.78	69.09	165	6,563.70	11,399.85	-
301526	C国际复	2023-12-19	6个月	创业板打新限售	2.66	4.45	2,503	6,657.98	11,138.35	-
688592	司南导航	2023-08-07	6个月	科创板打新限售	50.50	50.53	216	10,908.00	10,914.48	-
301509	金凯生科	2023-07-26	6个月	创业板打新限售	56.56	62.23	175	9,898.00	10,890.25	-
688627	精智达	2023-07-11	6个月	科创板打新限售	46.77	87.72	121	5,659.17	10,614.12	-
603296	华勤技术	2023-08-01	6个月	新股锁定	80.80	77.75	135	10,908.00	10,496.25	-
301498	乖宝宠物	2023-08-09	6个月	创业板打新限售	39.99	38.81	266	10,637.34	10,323.46	-
301566	N达利	2023-12-22	6个月	创业板打新限售	8.90	22.14	464	4,129.60	10,272.96	-
301370	国科	2023-07-03	6个	创业	13.39	16.01	611	8,181.29	9,782.11	-

	恒泰		月	板打 新限售							
6885 49	中巨 芯	2023- 08-30	6个 月	科创 板打 新限售	5.18	8.09	1,117	5,78 6.06	9,03 6.53	-	
3014 99	维科 精密	2023- 07-13	6个 月	创业 板打 新限售	19.50	28.93	311	6,06 4.50	8,99 7.23	-	
3015 58	三态 股份	2023- 09-21	6个 月	创业 板打 新限售	7.33	13.40	665	4,87 4.45	8,91 1.00	-	
6885 82	芯动 联科	2023- 06-21	6个 月	科创 板打 新限售	26.74	38.67	229	6,12 3.46	8,85 5.43	-	
6885 63	航材 股份	2023- 07-12	6个 月	科创 板打 新限售	78.99	60.49	144	11,37 4.56	8,71 0.56	-	
6885 73	信宇 人	2023- 08-09	6个 月	科创 板打 新限售	23.68	28.80	285	6,74 8.80	8,20 8.00	-	
6886 51	盛邦 安全	2023- 07-19	6个 月	科创 板打 新限售	39.90	46.05	178	7,10 2.20	8,19 6.90	-	
3015 18	长华 化学	2023- 07-26	6个 月	创业 板打 新限售	25.75	23.01	354	9,11 5.50	8,14 5.54	-	

				售							
3015 16	中远 通	2023- 12-01	6个 月	创业 板打 新限 售	6.87	15.51	509	3,49 6.83	7,89 4.59	-	
6886 03	天承 科技	2023- 06-30	6个 月	科创 板打 新限 售	55.00	74.14	105	5,77 5.00	7,78 4.70	-	
6886 71	碧兴 物联	2023- 08-02	6个 月	科创 板打 新限 售	36.12	34.30	226	8,16 3.12	7,75 1.80	-	
3015 33	威马 农机	2023- 08-07	6个 月	创业 板打 新限 售	29.50	33.16	225	6,63 7.50	7,46 1.00	-	
3015 19	舜禹 股份	2023- 07-19	6个 月	创业 板打 新限 售	20.93	20.21	364	7,61 8.52	7,35 6.44	-	
6886 02	康鹏 科技	2023- 07-13	6个 月	科创 板打 新限 售	8.66	11.06	657	5,68 9.62	7,26 6.42	-	
6886 52	京仪 装备	2023- 11-22	6个 月	科创 板打 新限 售	31.95	52.25	139	4,44 1.05	7,26 2.75	-	
3014 13	安培 龙	2023- 12-11	6个 月	创业 板打 新限 售	33.25	58.19	122	4,05 6.50	7,09 9.18	-	

688646	逸飞激光	2023-07-21	6个月	科创板打新限售	46.80	36.07	196	9,172.80	7,069.72	-
688591	泰凌微	2023-08-18	6个月	科创板打新限售	24.98	28.02	250	6,245.00	7,005.00	-
688720	艾森股份	2023-11-29	6个月	科创板打新限售	28.03	49.84	140	3,924.20	6,977.60	-
301292	海科新源	2023-06-29	6个月	创业板打新限售	19.99	19.35	350	6,996.50	6,772.50	-
301261	恒工精密	2023-06-29	6个月	创业板打新限售	36.90	50.85	133	4,907.70	6,763.05	-
301486	致尚科技	2023-06-30	6个月	创业板打新限售	57.66	47.25	141	8,130.06	6,662.25	-
301507	民生健康	2023-08-24	6个月	创业板打新限售	10.00	15.85	417	4,170.00	6,609.45	-
301210	金杨股份	2023-06-21	6个月	创业板打新限售	57.88	45.48	145	8,392.60	6,594.60	-
301555	惠柏	2023-10-24	6个月	创业	22.88	32.44	198	4,530.24	6,423.12	-

	新材		月	板打 新限售							
3015 05	苏州 规划	2023- 07-12	6个 月	创业 板打 新限售	26.35	35.81	178	4,69 0.30	6,37 4.18	-	
3012 72	英华 特	2023- 07-06	6个 月	创业 板打 新限售	51.39	53.38	118	6,06 4.02	6,29 8.84	-	
3013 29	信音 电子	2023- 07-05	6个 月	创业 板打 新限售	21.00	22.23	282	5,92 2.00	6,26 8.86	-	
3015 78	C辰 奕	2023- 12-21	6个 月	创业 板打 新限售	48.94	68.32	88	4,30 6.72	6,01 2.16	-	
3014 69	恒达 新材	2023- 08-10	6个 月	创业 板打 新限售	36.58	33.09	181	6,62 0.98	5,98 9.29	-	
6887 02	盛科 通信	2023- 09-06	6个 月	科创 板打 新限售	42.66	48.18	124	5,28 9.84	5,97 4.32	-	
3015 28	多浦 乐	2023- 08-17	6个 月	创业 板打 新限售	71.80	68.91	86	6,17 4.80	5,92 6.26	-	
3013 95	仁信 新材	2023- 06-21	6个 月	创业 板打 新限售	26.68	18.69	316	8,43 0.88	5,90 6.04	-	

				售							
688653	康希通信	2023-11-10	6个月	科创板打新限售	10.50	15.99	368	3,864.00	5,884.32	-	
301251	威尔高	2023-08-30	6个月	创业板打新限售	28.88	34.59	170	4,909.60	5,880.30	-	
301515	港通医疗	2023-07-13	6个月	创业板打新限售	31.16	28.27	208	6,481.28	5,880.16	-	
301418	协昌科技	2023-08-10	6个月	创业板打新限售	51.88	50.20	117	6,069.96	5,873.40	-	
301508	中机认检	2023-11-23	6个月	创业板打新限售	16.82	26.68	218	3,666.76	5,816.24	-	
688612	威迈斯	2023-07-19	6个月	科创板打新限售	47.29	37.97	153	7,235.37	5,809.41	-	
688648	中邮科技	2023-11-06	6个月	科创板打新限售	15.18	21.43	266	4,037.88	5,700.38	-	
301489	思泉新材	2023-10-16	6个月	创业板打新限售	41.66	64.11	87	3,624.42	5,577.57	-	

301568	思泰克	2023-11-21	6个月	创业板打新限售	23.23	35.58	156	3,623.88	5,550.48	-
301371	敷尔佳	2023-07-24	6个月	创业板打新限售	55.68	37.58	147	8,184.96	5,524.26	-
301459	丰茂股份	2023-12-06	6个月	创业板打新限售	31.90	39.84	135	4,306.50	5,378.40	-
301456	盘古智能	2023-07-06	6个月	创业板打新限售	37.96	30.39	174	6,605.04	5,287.86	-
301202	朗威股份	2023-06-28	6个月	创业板打新限售	25.82	31.80	163	4,208.66	5,183.40	-
688693	锆威特	2023-08-10	6个月	科创板打新限售	40.83	43.41	119	4,858.77	5,165.79	-
301393	昊帆生物	2023-07-05	6个月	创业板打新限售	67.68	59.37	86	5,820.48	5,105.82	-
601096	宏盛华源	2023-12-15	6个月	新股锁定	1.70	4.06	1,232	2,094.40	5,001.92	-
301517	陕西华达	2023-10-09	6个月	创业板打新限售	26.87	43.69	113	3,036.31	4,936.97	-

				售							
688716	中研股份	2023-09-13	6个月	科创板打新限售	29.66	36.39	134	3,974.44	4,876.26	-	
688450	光格科技	2023-07-17	6个月	科创板打新限售	53.09	36.42	131	6,954.79	4,771.02	-	
301550	斯菱股份	2023-09-06	6个月	创业板打新限售	37.56	43.57	107	4,018.92	4,661.99	-	
688719	爱科赛博	2023-09-20	6个月	科创板打新限售	69.98	60.10	75	5,248.50	4,507.50	-	
301525	儒竞科技	2023-08-23	6个月	创业板打新限售	99.57	81.46	55	5,476.35	4,480.30	-	
301529	福赛科技	2023-08-31	6个月	创业板打新限售	36.60	37.88	112	4,099.20	4,242.56	-	
301559	中集环科	2023-09-26	6个月	创业板打新限售	24.22	18.24	229	5,546.38	4,176.96	-	
301500	飞南资源	2023-09-13	6个月	创业板打新限售	23.97	20.89	195	4,674.15	4,073.55	-	

603119	浙江荣泰	2023-07-21	6个月	新股锁定	15.32	23.87	157	2,405.24	3,747.59	-
688657	浩辰软件	2023-09-25	6个月	科创板打新限售	103.40	78.23	46	4,756.40	3,598.58	-
301520	万邦医药	2023-09-18	6个月	创业板打新限售	67.88	52.74	67	4,547.96	3,533.58	-
301548	崇德科技	2023-09-11	6个月	创业板打新限售	66.80	58.99	58	3,874.40	3,421.42	-
001326	联域股份	2023-11-01	6个月	新股锁定	41.18	48.64	66	2,717.88	3,210.24	-
001239	永达股份	2023-12-04	6个月	新股锁定	12.05	19.92	151	1,819.55	3,007.92	-
601083	锦江航运	2023-11-28	6个月	新股锁定	11.25	11.07	270	3,037.50	2,988.90	-
603004	C鼎龙	2023-12-20	6个月	新股锁定	16.80	31.19	95	1,596.00	2,963.05	-
603273	天元智能	2023-10-16	6个月	新股锁定	9.50	18.97	150	1,425.00	2,845.50	-
603270	金帝股份	2023-08-25	6个月	新股锁定	21.77	29.58	92	2,002.84	2,721.36	-
603275	众辰科技	2023-08-16	6个月	新股锁定	49.97	39.70	65	3,248.05	2,580.50	-
001306	夏厦精密	2023-11-09	6个月	新股锁定	53.63	75.36	33	1,769.79	2,486.88	-
603373	安邦护卫	2023-12-13	6个月	新股锁定	19.10	34.75	69	1,317.90	2,397.75	-
6030	麦加	2023-	6个月	新股	58.08	57.81	41	2,38	2,37	-

62	芯彩	10-31	月	锁定				1.28	0.21	
001358	兴欣新材	2023-12-14	6个月	新股锁定	41.00	44.16	52	2,132.00	2,296.32	-
603107	上海汽配	2023-10-25	6个月	新股锁定	14.23	18.19	118	1,679.14	2,146.42	-
603193	润本股份	2023-10-09	6个月	新股锁定	17.38	16.66	117	2,033.46	1,949.22	-
603276	恒兴新材	2023-09-18	6个月	新股锁定	25.73	24.88	75	1,929.75	1,866.00	-
603075	热威股份	2023-09-01	6个月	新股锁定	23.10	23.31	75	1,732.50	1,748.25	-
603231	索宝蛋白	2023-12-06	6个月	新股锁定	21.29	21.53	74	1,575.46	1,593.22	-

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。

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	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000801	四川九洲	2023-12-21	拟筹划重大资产	7.70	2024-01-05	8.47	184,900	1,505,363.05	1,423,730.00	-

			重组							
688 337	普 源 精 电	202 3-1 2-2 5	重 大 事 项	43.8 7	202 4-01 -09	41.7 2	35,800	1,679,517.1 2	1,570,546.0 0	-

注:本基金截至2023年12月31日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,该类股票将在所公布事项的重大影响消除后,经交易所批准复牌。

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

截至本报告期末2023年12月31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。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2023年12月31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。

7.4.12.4 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。

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;在管理层层面设立风险管理委员会,主要负责拟定公司风险管理战略,经董事会批准后组织实施;组织实施经董事会批准的年度风险预算、风险可容忍度限额及其他量化风险管理

工具；根据公司总体风险控制目标，制定各业务和各环节风险控制目标和要求；落实公司就重大风险管理作出的决定或决议；听取并讨论会议议题，就重大风险管理事项形成决议；拟定或批准公司风险管理制度、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。风险管理部向公司首席风控官进行汇报。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，将风险控制可在可承受的范围内。

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。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末未持有短期信用评级的债券。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末未持有短期信用评级的资产支持证券。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末未持有短期信用评级的同业存单。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末未持有长期信用评级的债券。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末未持有长期信用评级的资产支持证券。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末未持有长期信用评级的同业存单。

7.4.13.3 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2023年12月31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。

7.4.13.3.1 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期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上市公司发行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7.4.12。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。

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。

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

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。

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	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	170,209,211.31	94.43

7.4.13.4.3.2 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 2023年12月31日
	业绩比较基准上升5%	9,045,349.11
	业绩比较基准下降5%	-9,045,349.11

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。

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	166,548,822.90
第二层次	2,994,276.00
第三层次	666,112.41
合计	170,209,211.31

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。

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

单位：人民币元

项目	本期 2023年03月23日（基金合同生效日）至2023年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	1,131,757.14	1,131,757.14
转出第三层次	-	276,909.45	276,909.45
当期利得或损失总额	-	-188,735.28	-188,735.28
其中：计入损益的利得或损失	-	-188,735.28	-188,735.28
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	666,112.41	666,112.41
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-168,839.93	-168,839.93

注：于2023年12月31日，本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。于2023年度，本基金从第三层次转出的交易性金

融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资。计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

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

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股票投资	666,112.41	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	0.1962~2.1988	负相关

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，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

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。

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§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	170,209,211.31	94.08
	其中：股票	170,209,211.31	94.08
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	9,269,792.26	5.12
8	其他各项资产	1,434,760.59	0.79
9	合计	180,913,764.16	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	181,807.00	0.10
B	采矿业	1,161,270.00	0.64
C	制造业	114,544,253.19	63.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,815,993.00	1.56
E	建筑业	2,181,542.00	1.21
F	批发和零售业	2,119,264.00	1.18
G	交通运输、仓储和邮政业	3,667,031.00	2.03
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	19,039,331.26	10.56
J	金融业	922,695.00	0.51
K	房地产业	2,949,039.00	1.64
L	租赁和商务服务业	1,367,895.00	0.76
M	科学研究和技术服务业	4,674,236.73	2.59
N	水利、环境和公共设施管理业	1,607,494.00	0.89
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	197,028.00	0.11
Q	卫生和社会工作	1,105,010.00	0.61
R	文化、体育和娱乐业	3,376,918.00	1.87
S	综合	19,740.00	0.01
	合计	161,930,547.18	89.84

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	-	-
C	制造业	6,477,381.19	3.59
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	149,621.11	0.08
G	交通运输、仓储和邮政业	2,988.90	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,519,378.54	0.84
J	金融业	-	-
K	房地产业	99,051.00	0.05
L	租赁和商务服务业	2,397.75	0.00
M	科学研究和技术服务业	15,724.00	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	12,121.64	0.01
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	8,278,664.13	4.59

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	300364	中文在线	67,700	1,741,921.00	0.97
2	688337	普源精电	35,800	1,570,546.00	0.87
3	300857	协创数据	28,100	1,489,019.00	0.83
4	000801	四川九洲	184,900	1,423,730.00	0.79
5	688568	中科星图	28,560	1,401,153.60	0.78
6	001696	宗申动力	202,000	1,339,260.00	0.74
7	301363	美好医疗	36,300	1,335,840.00	0.74
8	688083	中望软件	12,500	1,244,250.00	0.69
9	002296	辉煌科技	150,000	1,237,500.00	0.69
10	688559	海目星	34,100	1,217,370.00	0.68
11	603012	创力集团	204,800	1,210,368.00	0.67
12	002111	威海广泰	133,200	1,206,792.00	0.67
13	002469	三维化学	192,800	1,168,368.00	0.65
14	300259	新天科技	321,400	1,166,682.00	0.65
15	300994	久祺股份	74,700	1,098,090.00	0.61
16	300120	经纬辉开	150,800	1,094,808.00	0.61
17	601827	三峰环境	145,700	1,094,207.00	0.61
18	603558	健盛集团	112,500	1,090,125.00	0.60
19	000910	大亚圣象	135,900	1,087,200.00	0.60
20	002627	三峡旅游	203,500	1,086,690.00	0.60
21	688103	国力股份	22,000	1,086,360.00	0.60
22	300440	运达科技	143,600	1,069,820.00	0.59

23	002376	新北洋	138,700	1,056,894.00	0.59
24	688306	均普智能	187,800	1,046,046.00	0.58
25	688776	国光电气	10,470	1,019,673.30	0.57
26	603339	四方科技	85,100	1,011,839.00	0.56
27	300559	佳发教育	65,000	1,007,500.00	0.56
28	688221	前沿生物	100,200	993,984.00	0.55
29	002148	北纬科技	164,400	992,976.00	0.55
30	002524	光正眼科	149,700	965,565.00	0.54
31	688550	瑞联新材	24,000	952,320.00	0.53
32	000829	天音控股	99,200	946,368.00	0.53
33	601137	博威合金	60,900	945,777.00	0.52
34	688739	成大生物	29,000	942,790.00	0.52
35	002160	常铝股份	224,000	938,560.00	0.52
36	688357	建龙微纳	18,000	930,420.00	0.52
37	300578	会畅通讯	52,000	928,720.00	0.52
38	688526	科前生物	45,500	927,290.00	0.51
39	603668	天马科技	50,500	926,170.00	0.51
40	688378	奥来德	19,301	913,709.34	0.51
41	300386	飞天诚信	84,900	910,977.00	0.51
42	000823	超声电子	95,100	910,107.00	0.50
43	688300	联瑞新材	17,100	905,445.00	0.50
44	002448	中原内配	134,900	895,736.00	0.50
45	600855	航天长峰	83,000	889,760.00	0.49
46	688660	电气风电	172,200	885,108.00	0.49
47	605388	均瑶健康	70,100	879,054.00	0.49
48	300893	松原股份	29,900	873,977.00	0.48
49	600609	金杯汽车	179,800	873,828.00	0.48
50	300132	青松股份	166,400	868,608.00	0.48
51	688339	亿华通	18,855	862,427.70	0.48
52	002587	奥拓电子	100,000	857,000.00	0.48
53	688119	中钢洛耐	174,400	851,072.00	0.47

54	688580	伟思医疗	13,300	850,269.00	0.47
55	000601	韶能股份	198,400	849,152.00	0.47
56	605222	起帆电缆	42,500	819,400.00	0.45
57	000848	承德露露	103,700	814,045.00	0.45
58	002947	恒铭达	25,000	804,500.00	0.45
59	300265	通光线缆	86,200	798,212.00	0.44
60	688356	键凯科技	7,408	788,211.20	0.44
61	300239	东宝生物	124,300	774,389.00	0.43
62	600639	浦东金桥	76,200	770,382.00	0.43
63	000931	中关村	130,100	763,687.00	0.42
64	603859	能科科技	19,900	750,827.00	0.42
65	688110	东芯股份	21,800	750,574.00	0.42
66	300193	佳士科技	96,500	749,805.00	0.42
67	002540	亚太科技	113,000	746,930.00	0.41
68	688302	海创药业	14,246	741,789.22	0.41
69	002063	远光软件	117,300	724,914.00	0.40
70	601512	中新集团	93,200	718,572.00	0.40
71	688293	奥浦迈	12,969	715,499.73	0.40
72	603328	依顿电子	86,800	707,420.00	0.39
73	600012	皖通高速	62,200	685,444.00	0.38
74	002449	国星光电	71,500	677,105.00	0.38
75	600662	外服控股	140,300	673,440.00	0.37
76	300439	美康生物	58,000	673,380.00	0.37
77	002225	濮耐股份	175,800	664,524.00	0.37
78	002588	史丹利	103,200	658,416.00	0.37
79	688018	乐鑫科技	6,373	656,100.35	0.36
80	603093	南华期货	53,300	639,600.00	0.35
81	000503	国新健康	48,200	635,276.00	0.35
82	600284	浦东建设	99,300	625,590.00	0.35
83	300831	派瑞股份	51,000	625,260.00	0.35
84	000507	珠海港	117,000	615,420.00	0.34

85	300099	尤洛卡	98,900	612,191.00	0.34
86	688020	方邦股份	12,500	606,000.00	0.34
87	002391	长青股份	95,800	603,540.00	0.33
88	600590	泰豪科技	89,900	600,532.00	0.33
89	603698	航天工程	41,500	596,355.00	0.33
90	000859	国风新材	111,300	591,003.00	0.33
91	601163	三角轮胎	41,000	590,810.00	0.33
92	300686	智动力	55,700	589,306.00	0.33
93	300384	三联虹普	36,600	584,136.00	0.32
94	002171	楚江新材	77,600	580,448.00	0.32
95	002632	道明光学	57,500	568,100.00	0.32
96	603109	神驰机电	34,000	558,280.00	0.31
97	002301	齐心集团	78,400	557,424.00	0.31
98	002491	通鼎互联	106,100	555,964.00	0.31
99	688173	希荻微	31,409	552,484.31	0.31
100	300575	中旗股份	72,300	552,372.00	0.31
101	002378	章源钨业	96,900	548,454.00	0.30
102	688330	宏力达	19,000	539,790.00	0.30
103	600007	中国国贸	27,600	534,888.00	0.30
104	600266	城建发展	109,400	529,496.00	0.29
105	000422	湖北宜化	50,000	523,000.00	0.29
106	300639	凯普生物	54,200	506,228.00	0.28
107	002990	盛视科技	14,500	500,685.00	0.28
108	300177	中海达	68,200	490,358.00	0.27
109	300066	三川智慧	96,500	487,325.00	0.27
110	600797	浙大网新	74,100	486,096.00	0.27
111	300981	中红医疗	30,330	485,886.60	0.27
112	603212	赛伍技术	27,900	484,623.00	0.27
113	300061	旗天科技	82,600	484,036.00	0.27
114	688209	英集芯	26,800	478,648.00	0.27
115	000901	航天科技	51,300	478,116.00	0.27

116	300453	三鑫医疗	62,200	474,586.00	0.26
117	002635	安洁科技	28,900	471,937.00	0.26
118	002365	永安药业	48,200	471,396.00	0.26
119	300771	智莱科技	43,300	470,671.00	0.26
120	601811	新华文轩	33,900	463,074.00	0.26
121	603530	神马电力	22,200	460,428.00	0.26
122	688289	圣湘生物	22,900	447,695.00	0.25
123	603396	金辰股份	8,100	442,665.00	0.25
124	300110	华仁药业	104,400	440,568.00	0.24
125	002636	金安国纪	49,400	440,154.00	0.24
126	300232	洲明科技	49,600	436,480.00	0.24
127	688275	万润新能	7,000	431,690.00	0.24
128	605305	中际联合	13,200	426,492.00	0.24
129	601101	昊华能源	67,200	424,704.00	0.24
130	300020	银江技术	50,700	420,810.00	0.23
131	000531	穗恒运 A	62,700	419,463.00	0.23
132	688001	华兴源创	12,000	419,400.00	0.23
133	000949	新乡化纤	128,600	415,378.00	0.23
134	603181	皇马科技	37,900	414,247.00	0.23
135	300882	万胜智能	17,000	414,120.00	0.23
136	000928	中钢国际	70,600	411,598.00	0.23
137	600184	光电股份	36,000	411,480.00	0.23
138	000885	城发环境	36,200	410,508.00	0.23
139	688016	心脉医疗	2,100	408,723.00	0.23
140	605116	奥锐特	15,800	407,956.00	0.23
141	002519	银河电子	65,800	405,986.00	0.23
142	605399	晨光新材	29,800	404,088.00	0.22
143	002425	凯撒文化	89,900	401,853.00	0.22
144	300025	华星创业	41,800	400,862.00	0.22
145	601579	会稽山	37,200	399,528.00	0.22
146	002196	方正电机	55,500	398,490.00	0.22

147	002130	沃尔核材	52,600	397,130.00	0.22
148	002048	宁波华翔	30,000	390,300.00	0.22
149	300702	天宇股份	17,900	388,609.00	0.22
150	002302	西部建设	59,800	387,504.00	0.21
151	000791	甘肃能源	69,400	386,558.00	0.21
152	688298	东方生物	10,800	386,208.00	0.21
153	300706	阿石创	14,900	385,612.00	0.21
154	000797	中国武夷	128,900	385,411.00	0.21
155	603255	鼎际得	10,300	384,190.00	0.21
156	300039	上海凯宝	57,600	383,040.00	0.21
157	688076	诺泰生物	8,500	382,075.00	0.21
158	300040	九洲集团	68,000	380,800.00	0.21
159	300369	绿盟科技	40,300	380,029.00	0.21
160	603666	亿嘉和	12,100	379,819.00	0.21
161	688639	华恒生物	3,000	377,700.00	0.21
162	301080	百普赛斯	6,400	377,216.00	0.21
163	002119	康强电子	28,200	377,034.00	0.21
164	300048	合康新能	74,400	376,464.00	0.21
165	603676	卫信康	35,800	373,394.00	0.21
166	300436	广生堂	14,500	371,635.00	0.21
167	000555	神州信息	32,600	368,054.00	0.20
168	600986	浙文互联	67,200	366,912.00	0.20
169	688157	松井股份	6,800	366,792.00	0.20
170	300161	华中数控	10,200	366,180.00	0.20
171	002641	公元股份	72,600	365,178.00	0.20
172	300739	明阳电路	23,500	359,785.00	0.20
173	600810	神马股份	48,300	359,352.00	0.20
174	002956	西麦食品	25,000	358,250.00	0.20
175	300848	美瑞新材	18,600	355,818.00	0.20
176	603258	电魂网络	15,400	353,892.00	0.20
177	600880	博瑞传播	70,000	350,700.00	0.19

178	300585	奥联电子	20,900	350,284.00	0.19
179	603639	海利尔	22,300	350,110.00	0.19
180	601038	一拖股份	23,900	348,223.00	0.19
181	600480	凌云股份	38,000	346,180.00	0.19
182	603126	中材节能	51,000	343,740.00	0.19
183	300787	海能实业	20,400	343,128.00	0.19
184	002932	明德生物	14,900	342,253.00	0.19
185	000717	中南股份	134,700	342,138.00	0.19
186	002053	云南能投	35,100	337,662.00	0.19
187	600251	冠农股份	38,700	336,303.00	0.19
188	002277	友阿股份	82,800	333,684.00	0.19
189	002017	东信和平	31,010	322,814.10	0.18
190	688128	中国电研	15,400	316,008.00	0.18
191	002462	嘉事堂	22,200	315,462.00	0.18
192	300732	设研院	35,700	315,231.00	0.17
193	002210	飞马国际	175,200	313,608.00	0.17
194	600966	博汇纸业	50,500	313,605.00	0.17
195	688326	经纬恒润	2,700	313,335.00	0.17
196	688185	康希诺	4,200	312,984.00	0.17
197	300241	瑞丰光电	55,400	311,902.00	0.17
198	000990	诚志股份	37,100	304,591.00	0.17
199	600572	康恩贝	59,700	301,485.00	0.17
200	601886	江河集团	45,100	300,366.00	0.17
201	300673	佩蒂股份	22,400	297,920.00	0.17
202	688238	和元生物	32,800	294,872.00	0.16
203	002950	奥美医疗	31,000	293,880.00	0.16
204	000061	农产品	45,100	291,797.00	0.16
205	605009	豪悦护理	7,600	290,092.00	0.16
206	002438	江苏神通	24,000	286,800.00	0.16
207	002297	博云新材	35,900	286,123.00	0.16
208	603983	丸美股份	11,200	283,024.00	0.16

209	601609	金田股份	41,000	277,570.00	0.15
210	300674	宇信科技	17,000	276,760.00	0.15
211	300852	四会富仕	7,100	273,634.00	0.15
212	300887	谱尼测试	23,000	271,630.00	0.15
213	002582	好想你	35,400	271,518.00	0.15
214	000737	北方铜业	46,800	271,440.00	0.15
215	603610	麒盛科技	22,700	270,584.00	0.15
216	603333	尚纬股份	45,800	261,518.00	0.15
217	688327	云从科技	15,400	259,644.00	0.14
218	002975	博杰股份	6,700	255,940.00	0.14
219	002197	证通电子	24,500	254,555.00	0.14
220	300451	创业慧康	38,800	254,140.00	0.14
221	002182	宝武镁业	12,900	253,614.00	0.14
222	002214	大立科技	21,800	250,046.00	0.14
223	300237	美晨生态	116,000	248,240.00	0.14
224	000682	东方电子	30,600	246,330.00	0.14
225	300229	拓尔思	14,300	241,098.00	0.13
226	603200	上海洗霸	11,200	238,448.00	0.13
227	603979	金诚信	6,300	237,888.00	0.13
228	300709	精研科技	7,600	237,044.00	0.13
229	000600	建投能源	46,300	231,963.00	0.13
230	601019	山东出版	24,700	231,686.00	0.13
231	600825	新华传媒	51,300	229,311.00	0.13
232	605368	蓝天燃气	21,200	228,324.00	0.13
233	000090	天健集团	49,400	227,240.00	0.13
234	000561	烽火电子	26,900	225,960.00	0.13
235	000969	安泰科技	25,000	224,750.00	0.12
236	300688	创业黑马	7,800	223,938.00	0.12
237	300236	上海新阳	6,300	221,886.00	0.12
238	603897	长城科技	10,800	221,184.00	0.12
239	603901	永创智能	18,500	220,150.00	0.12

240	000055	方大集团	48,700	220,124.00	0.12
241	603256	宏和科技	26,300	218,816.00	0.12
242	688332	中科蓝讯	2,900	218,718.00	0.12
243	002959	小熊电器	4,200	218,106.00	0.12
244	300005	探路者	32,800	217,136.00	0.12
245	603520	司太立	15,400	216,832.00	0.12
246	600210	紫江企业	45,900	215,730.00	0.12
247	603533	掌阅科技	10,800	214,704.00	0.12
248	300045	华力创通	8,700	211,671.00	0.12
249	603319	湘油泵	12,000	210,480.00	0.12
250	300348	长亮科技	20,400	210,324.00	0.12
251	603033	三维股份	13,200	208,692.00	0.12
252	002324	普利特	15,600	205,140.00	0.11
253	600459	贵研铂业	14,200	203,912.00	0.11
254	603283	赛腾股份	2,800	203,168.00	0.11
255	600557	康缘药业	9,900	203,148.00	0.11
256	600320	振华重工	61,000	202,520.00	0.11
257	600933	爱柯迪	9,200	201,848.00	0.11
258	002735	王子新材	15,400	200,200.00	0.11
259	603896	寿仙谷	6,200	199,888.00	0.11
260	300513	恒实科技	16,800	199,584.00	0.11
261	600478	科力远	40,500	199,260.00	0.11
262	600199	金种子酒	10,700	198,164.00	0.11
263	300035	中科电气	18,800	198,152.00	0.11
264	002039	黔源电力	14,300	197,197.00	0.11
265	603377	东方时尚	46,800	197,028.00	0.11
266	300203	聚光科技	12,400	196,540.00	0.11
267	002354	天娱数科	35,500	195,960.00	0.11
268	002970	锐明技术	6,300	192,843.00	0.11
269	605376	博迁新材	6,800	191,760.00	0.11
270	300624	万兴科技	2,000	189,200.00	0.10

271	002100	天康生物	21,400	187,678.00	0.10
272	600576	祥源文旅	25,200	187,488.00	0.10
273	300735	光弘科技	7,900	185,966.00	0.10
274	002099	海翔药业	25,400	182,626.00	0.10
275	300766	每日互动	11,800	182,074.00	0.10
276	688048	长光华芯	2,900	181,743.00	0.10
277	300287	飞利信	45,100	181,302.00	0.10
278	600971	恒源煤电	16,200	180,630.00	0.10
279	688207	格灵深瞳	8,600	180,256.00	0.10
280	000059	华锦股份	32,600	178,974.00	0.10
281	688208	道通科技	7,500	178,125.00	0.10
282	300172	中电环保	33,100	177,747.00	0.10
283	002479	富春环保	36,600	174,582.00	0.10
284	300679	电连技术	4,200	174,300.00	0.10
285	688333	铂力特	1,500	173,850.00	0.10
286	002221	东华能源	16,400	168,920.00	0.09
287	002761	浙江建投	16,400	168,264.00	0.09
288	688183	生益电子	14,437	164,148.69	0.09
289	688320	禾川科技	4,000	164,000.00	0.09
290	301316	慧博云通	7,000	162,680.00	0.09
291	002746	仙坛股份	22,900	161,216.00	0.09
292	605007	五洲特纸	10,800	158,868.00	0.09
293	688359	三孚新科	2,300	158,447.00	0.09
294	300985	致远新能	4,200	158,382.00	0.09
295	601126	四方股份	11,100	157,176.00	0.09
296	600668	尖峰集团	14,200	156,910.00	0.09
297	300119	瑞普生物	9,500	155,705.00	0.09
298	000612	焦作万方	26,800	154,100.00	0.09
299	600628	新世界	21,600	151,416.00	0.08
300	300123	亚光科技	20,600	150,998.00	0.08
301	301096	百诚医药	2,300	149,730.00	0.08

302	600756	浪潮软件	10,600	147,022.00	0.08
303	300055	万邦达	23,200	143,144.00	0.08
304	002308	威创股份	44,100	142,884.00	0.08
305	688077	大地熊	5,900	140,715.00	0.08
306	002997	瑞鹄模具	4,200	139,944.00	0.08
307	002515	金字火腿	24,000	135,360.00	0.08
308	688365	光云科技	12,400	135,036.00	0.07
309	603337	杰克股份	6,200	133,920.00	0.07
310	603611	诺力股份	7,000	132,510.00	0.07
311	688505	复旦张江	14,300	131,989.00	0.07
312	002948	青岛银行	43,000	131,150.00	0.07
313	300081	恒信东方	11,300	130,515.00	0.07
314	300870	欧陆通	2,900	128,383.00	0.07
315	688299	长阳科技	9,200	128,340.00	0.07
316	300331	苏大维格	5,100	127,398.00	0.07
317	000655	金岭矿业	17,600	126,192.00	0.07
318	002838	道恩股份	9,800	125,538.00	0.07
319	688277	天智航	9,500	125,210.00	0.07
320	002649	博彦科技	10,100	123,927.00	0.07
321	300871	回盛生物	8,500	122,910.00	0.07
322	300143	盈康生命	11,500	122,245.00	0.07
323	600571	信雅达	8,800	121,000.00	0.07
324	603477	巨星农牧	3,200	119,904.00	0.07
325	300134	大富科技	11,600	119,712.00	0.07
326	603113	金能科技	14,800	119,436.00	0.07
327	000915	华特达因	4,100	118,736.00	0.07
328	000923	河钢资源	6,800	114,240.00	0.06
329	300374	中铁装配	9,300	113,739.00	0.06
330	688322	奥比中光	3,000	112,740.00	0.06
331	688578	艾力斯	2,700	112,482.00	0.06
332	300188	美亚柏科	7,000	112,140.00	0.06

333	688680	海优新材	1,700	111,605.00	0.06
334	000919	金陵药业	14,100	110,967.00	0.06
335	688313	仕佳光子	8,700	110,577.00	0.06
336	688348	昱能科技	900	110,142.00	0.06
337	300705	九典制药	3,300	109,659.00	0.06
338	300168	万达信息	12,700	107,696.00	0.06
339	300021	大禹节水	22,400	106,624.00	0.06
340	600908	无锡银行	21,100	106,555.00	0.06
341	688661	和林微纳	2,300	105,386.00	0.06
342	603393	新天然气	3,400	103,938.00	0.06
343	688663	新风光	3,700	103,748.00	0.06
344	002768	国恩股份	4,800	102,816.00	0.06
345	600694	大商股份	6,000	101,340.00	0.06
346	002083	孚日股份	20,100	101,304.00	0.06
347	601200	上海环境	10,800	97,092.00	0.05
348	002452	长高电新	13,400	95,140.00	0.05
349	000731	四川美丰	12,800	94,720.00	0.05
350	688148	芳源股份	12,300	94,341.00	0.05
351	300533	冰川网络	3,400	94,180.00	0.05
352	002611	东方精工	18,800	93,248.00	0.05
353	603508	思维列控	5,900	92,630.00	0.05
354	301090	华润材料	8,300	90,138.00	0.05
355	002651	利君股份	13,000	89,960.00	0.05
356	000681	视觉中国	6,100	89,670.00	0.05
357	605507	国邦医药	5,100	89,556.00	0.05
358	002283	天润工业	15,300	89,505.00	0.05
359	000685	中山公用	12,200	89,182.00	0.05
360	300043	星辉娱乐	24,000	89,040.00	0.05
361	605333	沪光股份	4,400	87,560.00	0.05
362	300825	阿尔特	6,300	86,625.00	0.05
363	688368	晶丰明源	800	86,352.00	0.05

364	603128	华贸物流	11,500	84,985.00	0.05
365	002367	康力电梯	11,200	84,224.00	0.05
366	688235	百济神州	600	83,424.00	0.05
367	300125	聆达股份	6,600	83,226.00	0.05
368	002194	武汉凡谷	8,400	82,824.00	0.05
369	600073	上海梅林	12,100	82,401.00	0.05
370	300933	中辰股份	8,700	82,215.00	0.05
371	002483	润邦股份	15,700	81,954.00	0.05
372	300314	戴维医疗	5,400	81,756.00	0.05
373	605198	安德利	3,500	81,550.00	0.05
374	600508	上海能源	5,600	77,616.00	0.04
375	603348	文灿股份	2,000	77,600.00	0.04
376	603367	辰欣药业	5,300	77,592.00	0.04
377	603920	世运电路	4,200	76,776.00	0.04
378	600125	铁龙物流	12,400	75,020.00	0.04
379	600903	贵州燃气	9,500	74,955.00	0.04
380	301219	腾远钴业	1,800	70,866.00	0.04
381	688089	嘉必优	3,900	69,810.00	0.04
382	300366	创意信息	5,300	69,536.00	0.04
383	300785	值得买	3,150	68,859.00	0.04
384	603416	信捷电气	1,800	67,608.00	0.04
385	600449	宁夏建材	3,700	66,341.00	0.04
386	688366	昊海生科	600	64,974.00	0.04
387	601700	风范股份	12,800	64,128.00	0.04
388	002851	麦格米特	2,600	63,960.00	0.04
389	002733	雄韬股份	4,200	63,168.00	0.04
390	002546	新联电子	12,600	63,000.00	0.03
391	600771	广誉远	2,300	62,077.00	0.03
392	300634	彩讯股份	3,000	61,410.00	0.03
393	301270	汉仪股份	1,500	59,625.00	0.03
394	002233	塔牌集团	8,300	58,764.00	0.03

395	300667	必创科技	3,300	56,628.00	0.03
396	002919	名臣健康	2,200	56,408.00	0.03
397	002534	西子洁能	4,500	56,205.00	0.03
398	601388	怡球资源	21,200	55,544.00	0.03
399	603569	长久物流	4,400	54,516.00	0.03
400	600525	长园集团	10,100	54,035.00	0.03
401	688088	虹软科技	1,300	53,352.00	0.03
402	002915	中欣氟材	2,900	52,954.00	0.03
403	300895	铜牛信息	1,600	52,896.00	0.03
404	600610	中毅达	5,600	52,584.00	0.03
405	002467	二六三	11,300	52,432.00	0.03
406	300222	科大智能	7,000	51,520.00	0.03
407	600496	精工钢构	16,800	51,240.00	0.03
408	688027	国盾量子	400	51,160.00	0.03
409	300318	博晖创新	7,900	49,296.00	0.03
410	000049	德赛电池	1,800	48,816.00	0.03
411	605060	联德股份	2,600	48,620.00	0.03
412	002987	京北方	2,600	48,308.00	0.03
413	301015	百洋医药	1,300	46,618.00	0.03
414	600201	生物股份	4,300	46,311.00	0.03
415	002829	星网宇达	1,700	45,968.00	0.03
416	600643	爱建集团	8,900	45,390.00	0.03
417	600877	电科芯片	3,100	43,369.00	0.02
418	600312	平高电气	3,400	43,146.00	0.02
419	603466	风语筑	3,000	43,140.00	0.02
420	603076	乐惠国际	1,600	42,880.00	0.02
421	600446	金证股份	3,700	42,809.00	0.02
422	000913	钱江摩托	3,400	42,398.00	0.02
423	300079	数码视讯	7,300	41,537.00	0.02
424	300853	申昊科技	1,500	40,800.00	0.02
425	688259	创耀科技	600	40,758.00	0.02

426	605068	明新旭腾	1,800	40,392.00	0.02
427	603667	五洲新春	1,700	39,780.00	0.02
428	300481	濮阳惠成	2,200	38,390.00	0.02
429	300328	宜安科技	5,400	37,584.00	0.02
430	002860	星帅尔	2,900	37,555.00	0.02
431	600537	亿晶光电	6,800	37,468.00	0.02
432	002126	银轮股份	2,000	37,340.00	0.02
433	002163	海南发展	4,100	37,228.00	0.02
434	002815	崇达技术	3,800	36,404.00	0.02
435	605266	健之佳	600	35,640.00	0.02
436	603138	海量数据	2,000	35,600.00	0.02
437	300659	中孚信息	1,500	33,330.00	0.02
438	003013	地铁设计	2,000	32,780.00	0.02
439	688262	国芯科技	1,100	32,274.00	0.02
440	688019	安集科技	200	31,952.00	0.02
441	300566	激智科技	1,700	31,756.00	0.02
442	000735	罗牛山	5,500	31,735.00	0.02
443	002911	佛燃能源	2,700	30,942.00	0.02
444	300087	荃银高科	3,600	30,168.00	0.02
445	688176	亚虹医药	2,700	29,106.00	0.02
446	300303	聚飞光电	4,900	29,057.00	0.02
447	002334	英威腾	3,300	28,809.00	0.02
448	603915	国茂股份	1,700	28,016.00	0.02
449	600158	中体产业	3,600	28,008.00	0.02
450	002688	金河生物	5,800	27,898.00	0.02
451	300551	古鳌科技	1,600	27,840.00	0.02
452	300638	广和通	1,440	27,403.20	0.02
453	300183	东软载波	1,700	25,653.00	0.01
454	300525	博思软件	1,700	25,364.00	0.01
455	300632	光莆股份	2,000	25,240.00	0.01
456	603018	华设集团	3,300	25,080.00	0.01

457	003012	东鹏控股	3,000	24,750.00	0.01
458	603871	嘉友国际	1,400	22,204.00	0.01
459	600189	泉阳泉	2,000	20,920.00	0.01
460	603186	华正新材	600	20,820.00	0.01
461	002803	吉宏股份	1,000	20,560.00	0.01
462	000628	高新发展	400	19,872.00	0.01
463	300592	华凯易佰	800	19,816.00	0.01
464	600620	天宸股份	2,100	19,740.00	0.01
465	300770	新媒股份	500	19,340.00	0.01
466	300627	华测导航	600	18,612.00	0.01
467	301239	普瑞眼科	200	17,200.00	0.01
468	300128	锦富技术	3,700	17,057.00	0.01
469	601619	嘉泽新能	4,700	16,591.00	0.01
470	600477	杭萧钢构	5,000	16,450.00	0.01
471	002891	中宠股份	600	15,810.00	0.01
472	600691	阳煤化工	4,800	15,408.00	0.01
473	002913	奥士康	500	15,325.00	0.01
474	603063	禾望电气	600	15,000.00	0.01
475	603208	江山欧派	500	14,845.00	0.01
476	688798	艾为电子	200	13,806.00	0.01
477	603167	渤海轮渡	1,500	13,320.00	0.01
478	002315	焦点科技	400	13,252.00	0.01
479	000543	皖能电力	2,100	13,146.00	0.01
480	603990	麦迪科技	1,000	12,920.00	0.01
481	300617	安靠智电	400	12,144.00	0.01
482	600757	长江传媒	1,600	11,920.00	0.01
483	301155	海力风电	200	11,830.00	0.01
484	002724	海洋王	1,400	11,508.00	0.01
485	600389	江山股份	600	10,440.00	0.01
486	000517	荣安地产	4,200	10,290.00	0.01
487	600997	开滦股份	1,300	9,919.00	0.01

488	688508	芯朋微	200	9,842.00	0.01
489	300721	怡达股份	400	5,972.00	0.00
490	688556	高测股份	116	4,522.84	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	300002	神州泰岳	157,600	1,394,760.00	0.77
2	603773	沃格光电	34,200	1,158,354.00	0.64
3	688108	赛诺医疗	79,500	997,725.00	0.55
4	688286	敏芯股份	7,000	501,900.00	0.28
5	000016	深康佳A	95,200	396,984.00	0.22
6	002109	兴化股份	64,300	304,782.00	0.17
7	603010	万盛股份	28,200	304,278.00	0.17
8	002481	双塔食品	68,700	302,967.00	0.17
9	300829	金丹科技	11,600	242,208.00	0.13
10	300394	天孚通信	2,200	201,344.00	0.11
11	002382	蓝帆医疗	28,100	187,708.00	0.10
12	603978	深圳新星	10,600	175,748.00	0.10
13	603179	新泉股份	3,400	172,414.00	0.10
14	600841	动力新科	20,900	123,519.00	0.07
15	300289	利德曼	17,100	105,165.00	0.06
16	600135	乐凯胶片	12,300	99,261.00	0.06
17	002285	世联行	41,100	99,051.00	0.05
18	300891	惠云钛业	9,700	94,090.00	0.05
19	603303	得邦照明	7,100	91,235.00	0.05
20	002996	顺博合金	8,000	87,360.00	0.05
21	002298	中电兴发	14,500	83,520.00	0.05
22	688196	卓越新能	2,100	70,497.00	0.04

23	002589	瑞康医药	21,100	68,997.00	0.04
24	600746	江苏索普	9,100	66,612.00	0.04
25	002986	宇新股份	4,000	62,400.00	0.03
26	603123	翠微股份	4,700	50,055.00	0.03
27	002793	罗欣药业	8,400	45,024.00	0.02
28	301487	盟固利	867	35,512.32	0.02
29	002753	永东股份	4,000	33,000.00	0.02
30	000566	海南海药	6,500	29,380.00	0.02
31	301348	蓝箭电子	558	24,870.06	0.01
32	002387	维信诺	1,800	20,178.00	0.01
33	300196	长海股份	1,800	19,584.00	0.01
34	300904	威力传动	304	18,705.12	0.01
35	688548	广钢气体	1,260	16,065.00	0.01
36	301172	君逸数码	404	15,416.64	0.01
37	301510	固高科技	396	13,863.96	0.01
38	301421	波长光电	212	12,586.44	0.01
39	301381	赛维时代	400	11,876.00	0.01
40	301488	豪恩汽电	165	11,399.85	0.01
41	301526	C国际复	2,503	11,138.35	0.01
42	688592	司南导航	216	10,914.48	0.01
43	301509	金凯生科	175	10,890.25	0.01
44	688627	精智达	121	10,614.12	0.01
45	603296	华勤技术	135	10,496.25	0.01
46	301498	乖宝宠物	266	10,323.46	0.01
47	301566	N达利	464	10,272.96	0.01
48	301370	国科恒泰	611	9,782.11	0.01
49	688549	中巨芯	1,117	9,036.53	0.01
50	301499	维科精密	311	8,997.23	0.00
51	301558	三态股份	665	8,911.00	0.00
52	688582	芯动联科	229	8,855.43	0.00
53	688563	航材股份	144	8,710.56	0.00

54	688573	信宇人	285	8,208.00	0.00
55	688651	盛邦安全	178	8,196.90	0.00
56	301518	长华化学	354	8,145.54	0.00
57	301262	海看股份	254	7,912.10	0.00
58	301516	中远通	509	7,894.59	0.00
59	688603	天承科技	105	7,784.70	0.00
60	688671	碧兴物联	226	7,751.80	0.00
61	301533	威马农机	225	7,461.00	0.00
62	301519	舜禹股份	364	7,356.44	0.00
63	688602	康鹏科技	657	7,266.42	0.00
64	688652	京仪装备	139	7,262.75	0.00
65	301413	安培龙	122	7,099.18	0.00
66	688646	逸飞激光	196	7,069.72	0.00
67	688591	泰凌微	250	7,005.00	0.00
68	688720	艾森股份	140	6,977.60	0.00
69	301292	海科新源	350	6,772.50	0.00
70	301261	恒工精密	133	6,763.05	0.00
71	301486	致尚科技	141	6,662.25	0.00
72	301507	民生健康	417	6,609.45	0.00
73	301210	金杨股份	145	6,594.60	0.00
74	301555	惠柏新材	198	6,423.12	0.00
75	301505	苏州规划	178	6,374.18	0.00
76	301272	英华特	118	6,298.84	0.00
77	301329	信音电子	282	6,268.86	0.00
78	301578	C辰奕	88	6,012.16	0.00
79	301469	恒达新材	181	5,989.29	0.00
80	688702	盛科通信	124	5,974.32	0.00
81	301528	多浦乐	86	5,926.26	0.00
82	301395	仁信新材	316	5,906.04	0.00
83	688653	康希通信	368	5,884.32	0.00
84	301251	威尔高	170	5,880.30	0.00

85	301515	港通医疗	208	5,880.16	0.00
86	301418	协昌科技	117	5,873.40	0.00
87	301508	中机认检	218	5,816.24	0.00
88	688612	威迈斯	153	5,809.41	0.00
89	688648	中邮科技	266	5,700.38	0.00
90	301489	思泉新材	87	5,577.57	0.00
91	301568	思泰克	156	5,550.48	0.00
92	301371	敷尔佳	147	5,524.26	0.00
93	301399	英特科技	141	5,396.07	0.00
94	301459	丰茂股份	135	5,378.40	0.00
95	301456	盘古智能	174	5,287.86	0.00
96	301202	朗威股份	163	5,183.40	0.00
97	688693	锆威特	119	5,165.79	0.00
98	301393	昊帆生物	86	5,105.82	0.00
99	601096	宏盛华源	1,232	5,001.92	0.00
100	301517	陕西华达	113	4,936.97	0.00
101	688716	中研股份	134	4,876.26	0.00
102	688450	光格科技	131	4,771.02	0.00
103	301305	朗坤环境	264	4,765.20	0.00
104	301550	斯菱股份	107	4,661.99	0.00
105	688719	爱科赛博	75	4,507.50	0.00
106	301525	儒竞科技	55	4,480.30	0.00
107	301355	南王科技	289	4,378.35	0.00
108	301529	福赛科技	112	4,242.56	0.00
109	301559	中集环科	229	4,176.96	0.00
110	301500	飞南资源	195	4,073.55	0.00
111	603119	浙江荣泰	157	3,747.59	0.00
112	688657	浩辰软件	46	3,598.58	0.00
113	301520	万邦医药	67	3,533.58	0.00
114	301548	崇德科技	58	3,421.42	0.00
115	001326	联域股份	66	3,210.24	0.00

116	001239	永达股份	151	3,007.92	0.00
117	601083	锦江航运	270	2,988.90	0.00
118	603004	C鼎龙	95	2,963.05	0.00
119	603273	天元智能	150	2,845.50	0.00
120	603270	金帝股份	92	2,721.36	0.00
121	603275	众辰科技	65	2,580.50	0.00
122	001306	夏厦精密	33	2,486.88	0.00
123	603373	安邦护卫	69	2,397.75	0.00
124	603062	麦加芯彩	41	2,370.21	0.00
125	001358	兴欣新材	52	2,296.32	0.00
126	603107	上海汽配	118	2,146.42	0.00
127	603193	润本股份	117	1,949.22	0.00
128	603276	恒兴新材	75	1,866.00	0.00
129	603075	热威股份	75	1,748.25	0.00
130	603231	索宝蛋白	74	1,593.22	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	688083	中望软件	7,546,086.64	4.19
2	300510	金冠股份	7,433,449.00	4.12
3	603328	依顿电子	6,812,956.00	3.78
4	601126	四方股份	6,634,377.00	3.68
5	300130	新国都	6,396,480.00	3.55
6	600266	城建发展	5,848,412.00	3.24
7	300066	三川智慧	5,555,739.00	3.08
8	000726	鲁泰 A	5,477,853.00	3.04
9	600073	上海梅林	5,416,577.49	3.01

10	300008	天海防务	5,415,516.00	3.00
11	002387	维信诺	5,405,520.00	3.00
12	002895	川恒股份	5,391,458.00	2.99
13	601929	吉视传媒	5,254,473.00	2.92
14	600537	亿晶光电	5,237,716.00	2.91
15	600391	航发科技	5,165,169.00	2.87
16	002782	可立克	5,143,819.00	2.85
17	688018	乐鑫科技	5,087,681.82	2.82
18	300765	新诺威	5,067,050.00	2.81
19	002324	普利特	5,014,563.00	2.78
20	300745	欣锐科技	4,939,920.50	2.74
21	603960	克来机电	4,938,160.00	2.74
22	600866	星湖科技	4,936,821.21	2.74
23	600502	安徽建工	4,861,941.00	2.70
24	300258	精锻科技	4,807,269.00	2.67
25	300181	佐力药业	4,806,257.26	2.67
26	002965	祥鑫科技	4,792,690.00	2.66
27	300532	今天国际	4,777,288.28	2.65
28	600129	太极集团	4,767,091.23	2.64
29	600929	雪天盐业	4,723,363.53	2.62
30	603800	道森股份	4,704,240.00	2.61
31	603399	吉翔股份	4,696,918.00	2.61
32	002957	科瑞技术	4,667,880.00	2.59
33	300552	万集科技	4,522,292.60	2.51
34	300533	冰川网络	4,450,140.00	2.47
35	600748	上实发展	4,307,171.00	2.39
36	300504	天邑股份	4,290,560.00	2.38
37	002421	达实智能	4,262,851.00	2.37
38	002746	仙坛股份	4,191,502.00	2.33
39	002783	凯龙股份	4,175,547.80	2.32
40	603609	禾丰股份	4,164,847.00	2.31

41	000928	中钢国际	4,082,826.00	2.27
42	603386	骏亚科技	4,015,711.00	2.23
43	002609	捷顺科技	4,013,192.00	2.23
44	300394	天孚通信	3,857,918.00	2.14
45	603058	永吉股份	3,849,243.00	2.14
46	688198	佰仁医疗	3,821,574.62	2.12
47	300212	易华录	3,782,058.65	2.10
48	300602	飞荣达	3,775,144.00	2.09
49	601827	三峰环境	3,764,870.00	2.09
50	603012	创力集团	3,716,936.00	2.06
51	002658	雪迪龙	3,677,777.00	2.04
52	002517	恺英网络	3,648,402.00	2.02
53	300545	联得装备	3,643,661.00	2.02

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。

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	300510	金冠股份	7,903,100.00	4.38
2	300130	新国都	6,863,432.00	3.81
3	300533	冰川网络	6,661,374.00	3.70
4	601126	四方股份	6,454,415.00	3.58
5	600266	城建发展	6,215,855.12	3.45
6	603328	依顿电子	6,201,457.09	3.44
7	688083	中望软件	5,744,982.45	3.19
8	002387	维信诺	5,553,600.00	3.08
9	300008	天海防务	5,500,311.00	3.05
10	300765	新诺威	5,454,176.60	3.03

11	600129	太极集团	5,418,746.00	3.01
12	600391	航发科技	5,358,822.00	2.97
13	300258	精锻科技	5,298,941.50	2.94
14	300745	欣锐科技	5,167,609.09	2.87
15	600537	亿晶光电	5,166,045.07	2.87
16	000726	鲁泰A	4,982,394.00	2.76
17	601929	吉视传媒	4,960,174.00	2.75
18	300532	今天国际	4,916,974.00	2.73
19	600073	上海梅林	4,914,269.00	2.73
20	002895	川恒股份	4,902,103.00	2.72
21	002324	普利特	4,694,637.00	2.60
22	600866	星湖科技	4,656,025.00	2.58
23	600502	安徽建工	4,655,748.00	2.58
24	002782	可立克	4,652,405.00	2.58
25	002965	祥鑫科技	4,647,468.00	2.58
26	600748	上实发展	4,640,794.40	2.57
27	300066	三川智慧	4,629,986.00	2.57
28	600929	雪天盐业	4,597,873.00	2.55
29	603960	克来机电	4,557,231.52	2.53
30	002957	科瑞技术	4,536,116.00	2.52
31	688018	乐鑫科技	4,464,498.96	2.48
32	603800	道森股份	4,417,171.00	2.45
33	000928	中钢国际	4,305,311.00	2.39
34	603058	永吉股份	4,298,572.00	2.38
35	300394	天孚通信	4,230,853.00	2.35
36	300181	佐力药业	4,182,644.00	2.32
37	603399	吉翔股份	4,160,411.44	2.31
38	002783	凯龙股份	4,134,882.00	2.29
39	300504	天邑股份	4,115,896.00	2.28
40	002421	达实智能	3,902,338.00	2.17
41	603386	骏亚科技	3,892,013.00	2.16

42	002609	捷顺科技	3,891,069.00	2.16
43	300552	万集科技	3,775,221.00	2.09
44	002746	仙坛股份	3,749,888.00	2.08
45	300226	上海钢联	3,744,397.60	2.08
46	002517	恺英网络	3,727,238.94	2.07
47	300602	飞荣达	3,681,518.00	2.04
48	300206	理邦仪器	3,675,809.00	2.04
49	002658	雪迪龙	3,632,686.00	2.02

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。

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	1,280,644,871.26
卖出股票收入（成交）总额	1,092,151,893.89

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。

8.5 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。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

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

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

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.11 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本报告期内未发现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查，未发现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

8.12.2 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。

8.12.3 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	1,434,760.59
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,434,760.59

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	688337	普源精电	1,570,546.00	0.87	停牌

2	000801	四川九洲	1,423,730.00	0.79	停牌
---	--------	------	--------------	------	----

8.12.5.2 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。

8.12.6 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。

§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
天弘 国证2 000指 数增 强A	1,5 72	60,188.07	4,220,004.67	4.46%	90,395,647.97	95.54%
天弘 国证2 000指 数增 强C	4,3 18	23,694.38	690,359.05	0.67%	101,621,956.66	99.33%
合计	5,8 29	33,784.18	4,910,363.72	2.49%	192,017,604.63	97.51%

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）。

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	天弘国证2000指数增强A	9,254.22	0.01%
	天弘国证2000指数增强C	64,783.09	0.06%
	合计	74,037.31	0.04%

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	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

§10 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
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	40,877,129.23	292,436,337.43
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	74,939,918.26	367,594,519.68
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	94,615,652.64	102,312,315.71

注：本基金合同于2023年03月23日生效。

§11 重大事件揭示

11.1 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。

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

本报告期内，童建林先生任职公司风控负责人，刘荣逵先生任职公司首席信息官，马文辉先生任职公司财务负责人，朱海扬先生不再担任公司副总经理，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，韩歆毅先生代任公司总经理，郭树强先生不再担任公司总经理，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，高阳先生担任公司总经理，韩歆毅先生不再代任公司总经理，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。

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。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金应向普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）支付服务费60,000.00元。截至本报告期末，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）已为本基金提供审计服务10个月。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 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。

11.6.2 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
第一创业证券	5	1,785,160,459.89	75.48%	892,660.17	78.33%	-
华安证券	2	579,910,186.82	24.52%	247,025.51	21.67%	-

注：1、基金专用交易单元的选择标准为：该证券经营机构财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；经营行为规范，内控制度健全，最近两年未因重大违规行为受到监管机关的处罚；研究实力较强，能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、市场分析报告、行业研究报告、个股分析报告及全面的信息服务。

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。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例

第一创业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证券	3,998,780.00	100.00%	-	-	-	-	-	-

11.8 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产品资料概要	中国证监会规定媒介	2023-02-27
2	天弘国证2000指数增强型证券投资基金基金份额发售公告	中国证监会规定媒介	2023-02-27
3	天弘国证2000指数增强型证券投资基金基金合同	中国证监会规定媒介	2023-02-27
4	天弘国证2000指数增强型证券投资基金托管协议	中国证监会规定媒介	2023-02-27
5	天弘国证2000指数增强型证券投资基金招募说明书	中国证监会规定媒介	2023-02-27
6	天弘国证2000指数增强型证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会规定媒介	2023-03-24
7	天弘基金管理有限公司关于防范不法分子冒用公司名义进行诈骗活动的风险提示	中国证监会规定媒介	2023-03-24
8	天弘国证2000指数增强型证券投资基金产品资料概要（更新）	中国证监会规定媒介	2023-03-27
9	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	2023-04-01
10	天弘基金管理有限公司关于增聘天弘国证2000指数增强型证券投资基金基金经理的公告	中国证监会规定媒介	2023-04-08
11	天弘国证2000指数增强型证	中国证监会规定媒介	2023-04-11

	券投资基金招募说明书（更新）		
12	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	2023-04-11
13	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	2023-04-11
14	天弘基金管理有限公司关于天弘国证2000指数增强型证券投资基金开放日常申购、赎回、定期定额投资及转换业务的公告	中国证监会规定媒介	2023-04-14
15	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	2023-07-05
16	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	2023-07-05
17	天弘国证2000指数增强型证券投资基金2023年第2季度报告	中国证监会规定媒介	2023-07-21
18	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	2023-07-24
19	天弘国证2000指数增强型证券投资基金2023年中期报告	中国证监会规定媒介	2023-08-31
20	天弘基金管理有限公司关于终止凤凰金信（海口）基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会规定媒介	2023-09-01
21	天弘国证2000指数增强型证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会规定媒介	2023-10-21

22	天弘国证2000指数增强型证券投资基金2023年第3季度报告	中国证监会规定媒介	2023-10-25
23	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	2023-12-30

§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

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。

12.2 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。

§13 备查文件目录

13.1 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

13.2 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

13.3 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

