

天弘国证 2000 指数增强型证券投资基金

2023 年中期报告

2023 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:2023 年 08 月 31 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2023年08月29日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2023年03月23日起至2023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	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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	13
§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（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	52
7.1 期末基金资产组合情况	52
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	52
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	54
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	73
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	75
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	75
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	75
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	75
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	76
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	76
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	76
7.12 投资组合报告附注	76
§8 基金份额持有人信息	77
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	77
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	78

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.....	78
§9 开放式基金份额变动.....	78
§10 重大事件揭示.....	79
10.1 基金份额持有人大会决议.....	79
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.....	79
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	79
10.4 基金投资策略的改变.....	79
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	79
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.....	79
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	80
10.8 其他重大事件.....	81
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	82
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.....	82
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	82
§12 备查文件目录.....	82
12.1 备查文件目录.....	82
12.2 存放地点.....	82
12.3 查阅方式.....	82

§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	327,231,526.90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	91,460,023.34份	235,771,503.56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	秦一楠
	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 (2023年03月23日（基金合同生效日）-2023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	-1,308,211.68	-1,212,038.97
本期利润	-327,067.92	3,538,044.55
加权平均基金份额本期利润	-0.0029	0.0251
本期加权平均净值利润率	-0.30%	2.55%
本期基金份额净值增长率	0.02%	-0.06%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2023年06月30日)	
期末可供分配利润	-1,071,492.84	-2,944,731.45
期末可供分配基金份额利润	-0.0117	-0.0125
期末基金资产净值	91,475,655.03	235,624,361.89
期末基金份额净值	1.0002	0.9994
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2023年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	0.02%	-0.06%

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

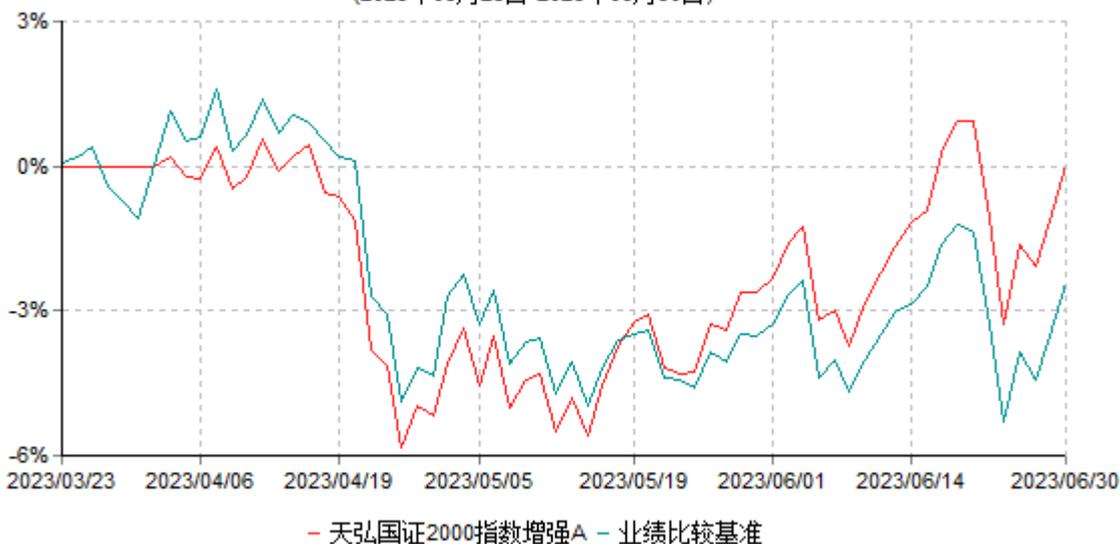
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.70%	1.10%	1.18%	1.05%	1.52%	0.05%
过去三个月	0.02%	0.97%	-2.42%	0.95%	2.44%	0.02%
自基金合同生效日起至 今	0.02%	0.91%	-2.39%	0.92%	2.41%	-0.01%

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	2.68%	1.10%	1.18%	1.05%	1.50%	0.05%
过去三个月	-0.05%	0.97%	-2.42%	0.95%	2.37%	0.02%
自基金合同生效日起至 今	-0.06%	0.91%	-2.39%	0.92%	2.33%	-0.01%

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-2023年06月30日)



注：1、本基金合同于2023年03月23日生效，本基金合同生效起至披露时点不满1年。

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，截止本报告期末本基金仍处于建仓期。

§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6月30日，公司共管理运作180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	指数与数量投资部总经理、本基金基金经理	2023年03月	-	13年	男，金融数学与计算硕士。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3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

报告期内，国证2000指数走势波动较大。近期主题投资活跃，AI、TMT相关板块涨幅较大，其他板块则乏善可陈。而国证2000指数中计算机、传媒、通信等行业均占比不小，因此指数虽然在近期整体表现与市场整体水平大致持平，但报告期间也常跟随热点板块走出较强行情。

基金管理人以量化投资模型为基础，在严格控制行业偏离和风格偏离的条件下构建投资组合，后续仍将按既定策略进行投资运作。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2023年06月30日，天弘国证2000指数增强A基金份额净值为1.0002元，天弘国证2000指数增强C基金份额净值为0.9994元。报告期内份额净值增长率天弘国证2000指数增强A为0.02%，同期业绩比较基准增长率为-2.39%；天弘国证2000指数增强C为-0.06%，同期业绩比较基准增长率为-2.39%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

策略上基本保持既有策略整体框架不变，继续迭代选股因子。不对风格、行业做过多暴露。投资端将坚持按照量化模型结果进行组合构建。

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2023年03月23日至2023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：2023年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年06月30日
资产：		
银行存款	6.4.7.1	15,939,507.85
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	6.4.7.2	292,937,406.92
其中：股票投资		290,915,021.71
基金投资		-
债券投资		2,022,385.21
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	-
债权投资		-
其中：债券投资		-
资产支持证券投资		-
其他投资		-
其他债权投资		-
其他权益工具投资		-
应收清算款		-
应收股利		-

应收申购款		19,685,257.23
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.5	-
资产总计		328,562,172.00
负债和净资产	附注号	本期末 2023年06月30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		1,250,536.48
应付管理人报酬		128,867.42
应付托管费		21,477.89
应付销售服务费		40,146.29
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	21,127.00
负债合计		1,462,155.08
净资产：		
实收基金	6.4.7.7	327,231,526.90
其他综合收益		-
未分配利润	6.4.7.8	-131,509.98
净资产合计		327,100,016.92
负债和净资产总计		328,562,172.00

注：1.报告截止日2023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1.0002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0.9994元；基金份额总额327,231,526.90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91,460,023.34份，天弘国证2000指数增强型证券投资基金C类基金份额235,771,503.56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06月30日，无上一年度可比期间(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：2023年03月23日（基金合同生效日）至2023年06月30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06月30 日
一、营业总收入		3,814,331.39
1.利息收入		57,785.37
其中：存款利息收入	6.4.7.9	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		-
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-2,141,142.29
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-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	1,912,406.30
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-

3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	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	166,461.03
减：二、营业总支出		603,354.76
1. 管理人报酬		400,789.15
2. 托管费		66,798.16
3. 销售服务费		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	23,884.57
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,210,976.63
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,210,976.63
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		3,210,976.63

6.3 净资产（基金净值）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06月30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06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	-	-	-	-
加：会计政策变	-	-	-	-

更				
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	306,148,939.63	-	-	306,148,939.63
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基金净值变动数（净值减少以“-”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基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	327,231,526.90	-	-131,509.98	327,100,016.92

值)				
----	--	--	--	--

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:

韩歆毅(代)

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2023年03月23日(基金合同生效日)至2023年06月30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06月30日的财务状况以及2023年03月23日(基金合同生效日)至2023年06月30日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 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06月30日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 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或金融负债。

(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商业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商业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。

6.4.4.4 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。

6.4.4.5 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。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 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。

6.4.4.8 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基金净值比例计算的金额。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基金净值比例计算的金额。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)。

6.4.4.9 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确认为利息收入,将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投资收益。

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。

6.4.4.10 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。

6.4.4.11 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。

6.4.4.12 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。

6.4.4.13 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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

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。

(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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	
	2023年06月30日	
活期存款	1,919,537.03	
等于：本金	1,919,254.24	
加：应计利息	282.79	
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	14,019,970.82	
等于：本金	14,018,600.90	
加：应计利息	1,369.92	
减：坏账准备	-	
合计	15,939,507.85	

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2023年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动

股票		285,184,774.43	-	290,915,021.71	5,730,247.28
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	1,998,620.00	22,785.21	2,022,385.21	980.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	1,998,620.00	22,785.21	2,022,385.21	980.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		287,183,394.43	22,785.21	292,937,406.92	5,731,227.28

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 2023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	21,127.00
合计	21,127.00

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 2023年03月23日（基金合同生效日）至2023年06月30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	12,204,862.70	12,204,862.70
本期赎回（以“-”号填列）	-49,423,281.03	-49,423,281.03
本期末	91,460,023.34	91,460,023.34

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 2023年03月23日（基金合同生效日）至2023年06月30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	174,955,887.02	174,955,887.02
本期赎回（以“-”号填列）	-116,654,881.42	-116,654,881.42
本期末	235,771,503.56	235,771,503.56

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。

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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-1,308,211.68	981,143.76	-327,067.92
本期基金份额交易产生的变动数	236,718.84	105,980.77	342,699.61
其中：基金申购款	-143,044.97	-186,214.83	-329,259.80
基金赎回款	379,763.81	292,195.60	671,959.41
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,071,492.84	1,087,124.53	15,631.69

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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-1,212,038.97	4,750,083.52	3,538,044.55
本期基金份额交易产生的变动数	-1,732,692.48	-1,952,493.74	-3,685,186.22
其中：基金申购款	-2,298,130.41	-1,571,385.60	-3,869,516.01
基金赎回款	565,437.93	-381,108.14	184,329.79
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,944,731.45	2,797,589.78	-147,141.67

6.4.7.9 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06月30日

活期存款利息收入	27,484.44
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	30,300.93
结算备付金利息收入	-
其他	-
合计	57,785.37

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
	2023年03月23日（基金合同生效日）至2023年06月30日
卖出股票成交总额	318,476,397.68
减：卖出股票成本总额	321,700,833.09
减：交易费用	829,204.70
买卖股票差价收入	-4,053,640.11

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 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06月30日
债券投资收益——利息收入	91.52
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
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	91.52

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 2023年03月23日（基金合同生效日）至2023年06月30日
股票投资产生的股利收益	1,912,406.30
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	1,912,406.30

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年03月23日（基金合同生效日）至2023年06月30日
1.交易性金融资产	5,731,227.28
——股票投资	5,730,247.28
——债券投资	980.00
——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	5,731,227.28

6.4.7.17 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06月30日
基金赎回费收入	166,455.83
基金转换费收入	5.20
合计	166,461.03

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 2023年03月23日（基金合同生效日）至2023年06月30日
审计费用	21,127.00
信息披露费	-
证券出借违约金	-
汇划手续费	1,957.57
开户费	800.00
合计	23,884.57

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 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	400,789.15
其中：支付销售机构的客户维护费	193,979.60

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
	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	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		
	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
天弘基金管理有限公司	-	362.61	362.61
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

本基金本报告期末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

本基金本报告期末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

本基金本报告期末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

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。

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 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
中国农业银行股份有限公司	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

本基金本报告期无利润分配事项。

6.4.12 期末（2023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
301395	仁信新材	2023-06-21	1个月内（含）	新股未上市	26.68	26.68	3,160	84,308.80	84,308.80	-
301486	致尚科技	2023-06-30	1个月内（含）	新股未上市	57.66	57.66	1,402	80,839.32	80,839.32	-
301292	海科新源	2023-06-29	1个月内（含）	新股未上市	19.99	19.99	3,494	69,845.06	69,845.06	-
301488	豪恩汽电	2023-06-26	1个月内（含）	新股未上市	39.78	39.78	1,645	65,438.10	65,438.10	-
688603	天承科技	2023-06-30	1个月内（含）	新股未上市	55.00	55.00	1,043	57,365.00	57,365.00	-
301261	恒工精密	2023-06-2	1个月内（含）	新股未上	36.90	36.90	1,325	48,892.50	48,892.50	-

		9		市						
301202	朗威股份	2023-06-28	1个月内(含)	新股未上市	25.82	25.82	1,623	41,905.86	41,905.86	-
688472	阿特斯	2023-06-02	6个月	科创板打新限售	11.10	17.04	717	7,958.70	12,217.68	-
688361	中科飞测	2023-05-12	6个月	科创板打新限售	23.60	64.67	173	4,082.80	11,187.91	-
688443	智翔金泰	2023-06-13	6个月	科创板打新限售	37.88	29.49	373	14,129.24	10,999.77	-
301320	豪江智能	2023-06-01	6个月	创业板打新限售	13.06	20.62	531	6,934.86	10,949.22	-
301325	曼恩斯特	2023-05-04	6个月	创业板打新限售	76.80	107.95	100	7,680.00	10,795.00	-
688629	C华丰	2023-06-16	6个月	科创板打新限售	9.26	18.59	554	5,130.04	10,298.86	-
688469	中芯集成	2023-04-28	6个月	科创板打新限售	5.69	5.41	1,856	10,560.64	10,040.96	-
688582	N芯动	2023-06-2	6个月	科创板打	26.74	40.68	229	6,123.46	9,315.72	-

		1		新限售						
301315	威士顿	2023-06-13	6个月	创业板打新限售	32.29	51.12	173	5,586.17	8,843.76	-
688562	航天软件	2023-05-15	6个月	科创板打新限售	12.68	22.31	357	4,526.76	7,964.67	-
688543	国科军工	2023-06-14	6个月	科创板打新限售	43.67	53.05	147	6,419.49	7,798.35	-
688576	西山科技	2023-05-30	6个月	科创板打新限售	135.80	120.41	63	8,555.40	7,585.83	-
301295	C美硕	2023-06-19	6个月	创业板打新限售	37.40	36.07	202	7,554.80	7,286.14	-
301399	英特科技	2023-05-16	6个月	创业板打新限售	43.99	51.57	141	6,202.59	7,271.37	-
688620	C安凯微	2023-06-15	6个月	科创板打新限售	10.68	12.34	582	6,215.76	7,181.88	-
301210	N金杨	2023-06-21	6个月	创业板打新限售	57.88	49.17	145	8,392.60	7,129.65	-

301225	恒勃股份	2023-06-08	6个月	创业板打新限售	35.66	33.26	195	6,953.70	6,485.70	-
301262	海看股份	2023-06-13	6个月	创业板打新限售	30.22	25.50	254	7,675.88	6,477.00	-
301382	蜂助手	2023-05-09	6个月	创业板打新限售	23.80	32.84	193	4,593.40	6,338.12	-
688523	航天环宇	2023-05-26	6个月	科创板打新限售	21.86	23.85	259	5,661.74	6,177.15	-
301397	C溯联	2023-06-15	6个月	创业板打新限售	53.27	40.20	153	8,150.31	6,150.60	-
688458	美芯晟	2023-05-15	6个月	科创板打新限售	75.00	90.76	67	5,025.00	6,080.92	-
688334	西高院	2023-06-09	6个月	科创板打新限售	14.16	16.21	372	5,267.52	6,030.12	-
688593	新相微	2023-05-25	6个月	科创板打新限售	11.18	14.59	401	4,483.18	5,850.59	-
301376	致欧科技	2023-06-1	6个月	创业板打	24.66	22.51	259	6,386.94	5,830.09	-

		4		新限售						
688429	C时创	2023-06-20	6个月	科创板打新限售	19.20	25.53	222	4,262.40	5,667.66	-
688552	航天南湖	2023-05-08	6个月	科创板打新限售	21.17	23.50	239	5,059.63	5,616.50	-
688512	慧智微	2023-05-08	6个月	科创板打新限售	20.92	19.16	289	6,045.88	5,537.24	-
300804	C广康	2023-06-15	6个月	创业板打新限售	42.45	32.97	165	7,004.25	5,440.05	-
688581	安杰思	2023-05-12	6个月	科创板打新限售	125.80	118.03	46	5,786.80	5,429.38	-
301170	C锡南	2023-06-16	6个月	创业板打新限售	34.00	34.93	150	5,100.00	5,239.50	-
301305	朗坤环境	2023-05-15	6个月	创业板打新限售	25.25	19.69	264	6,666.00	5,198.16	-
688570	天玛智控	2023-05-29	6个月	科创板打新限售	30.26	25.33	204	6,173.04	5,167.32	-

301232	飞沃科技	2023-06-08	6个月	创业板打新限售	72.50	58.42	87	6,307.50	5,082.54	-
301332	德尔玛	2023-05-09	6个月	创业板打新限售	14.81	13.73	366	5,420.46	5,025.18	-
301355	南王科技	2023-06-02	6个月	创业板打新限售	17.55	16.75	289	5,071.95	4,840.75	-
688631	C莱斯	2023-06-19	6个月	科创板打新限售	25.28	29.87	161	4,070.08	4,809.07	-
301428	世纪恒通	2023-05-10	6个月	创业板打新限售	26.35	30.60	152	4,005.20	4,651.20	-
301323	新莱福	2023-05-29	6个月	创业板打新限售	39.06	39.36	114	4,452.84	4,487.04	-
688623	双元科技	2023-05-31	6个月	科创板打新限售	125.88	86.79	48	6,042.24	4,165.92	-
301337	亚华电子	2023-05-16	6个月	创业板打新限售	32.60	30.37	125	4,075.00	3,796.25	-
688479	友车科技	2023-05-0	6个月	科创板打	33.99	29.49	125	4,248.75	3,686.25	-

		4		新限售						
001380	华纬科技	2023-05-09	6个月	新股锁定	28.84	30.78	106	3,057.04	3,262.68	-
001282	三联锻造	2023-05-15	6个月	新股锁定	27.93	33.03	63	1,759.59	2,080.89	-
603172	万丰股份	2023-04-28	6个月	新股锁定	14.58	16.13	109	1,589.22	1,758.17	-
001324	长青科技	2023-05-12	6个月	新股锁定	18.88	19.60	79	1,491.52	1,548.40	-

注：1、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起6个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后6个月内不得转让。

2、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于6个月的限售期。

3、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。

4、创业板新股仁信新材（证券代码：301395）于2023年07月03日起上市流通，本基金获配的股数中316股根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》于上市后进入限售期，可流通日为2024年01月03日。

5、创业板新股致尚科技（证券代码：301486）于2023年07月07日起上市流通，本基金获配的股数中141股根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》于上市后进入限售期，可流通日为2024年01月08日。

6、创业板新股海科新源（证券代码：301292）于2023年07月07日起上市流通，本基金获配的股数中350股根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》于上市后进入限售期，可流通日为2024年01月08日。

7、创业板新股豪恩汽电（证券代码：301488）于2023年07月04日起上市流通，本基金获配的股数中165股根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》于上市后进入限售期，可流通日为2024年01月04日。

8、科创板新股天承科技（证券代码：688603）于2023年07月10日起上市流通，本基金获配的股数中105股根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》于上市后进入限售期，可流通日为2024年01月10日。

9、创业板新股恒工精密（证券代码：301261）于2023年07月10日起上市流通，本基金获配的股数中133股根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》于上市后进入限售期，可流通日为2024年01月10日。

10、创业板新股朗威股份（证券代码：301202）于2023年07月05日起上市流通，本基金获配的股数中163股根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》于上市后进入限售期，可流通日为2024年01月05日。

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2023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2023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，建立了以审计与风险控制委员会为核心的、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。在董事会下设立审计与风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；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及时性、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。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。

新金融工具准则将金融工具所处的信用风险状况划分为三个阶段。本基金在参考历史违约率、市场信息及行业实践的基础上，选取隐含评级AA级为低信用风险阈值，并将减值阶段划分如下：在资产负债表日，若相关债券/资产支持证券投资的发行主体的中债市场隐含评级不低于初始确认隐含评级，或不低于低信用风险阈值，则处于第一阶段；若相关债券/资产支持证券投资的发行主体的中债市场隐含评级低于初始确认隐含评级，且低于低信用风险阈值，则处于第二阶段；若相关债券/资产支持证券投资的发行主体中债市场隐含评级下调至C，或出现其他认定为违约的情形时，则处于第三阶段。

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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2023年06月30日
A-1	-
A-1以下	-
未评级	2,022,385.21
合计	2,022,385.21

注：未评级债券为国债、政策性金融债、央票或其他未经第三方评级机构进行债项评级的债券。

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2023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 2023 年 06 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	15,939,507.85	-	-	-	15,939,507.85
交易性金融资产	2,022,385.21	-	-	290,915,021.71	292,937,406.92
应收申购款	-	-	-	19,685,257.23	19,685,257.23
资产总计	17,961,893.06	-	-	310,600,278.94	328,562,172.00
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,250,536.48	1,250,536.48
应付管理人报酬	-	-	-	128,867.42	128,867.42
应付托管费	-	-	-	21,477.89	21,477.89
应付销售服务费	-	-	-	40,146.29	40,146.29
其他负债	-	-	-	21,127.00	21,127.00
负债总计	-	-	-	1,462,155.08	1,462,155.08
利率敏感度缺口	17,961,893.06	-	-	309,138,123.86	327,100,016.92

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2023年06月30日，本基金持有的交易性债券投资占基金净资产的比例为0.62%，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金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 2023年06月30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	290,915,021.71	88.94
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	290,915,021.71	88.94

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 2023年06月30日
	业绩比较基准上升5%	16,567,615.86
	业绩比较基准下降5%	-16,567,615.86

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

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年06月30日
第一层次	290,171,649.86
第二层次	2,470,979.85
第三层次	294,777.21
合计	292,937,406.92

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2023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。

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	290,915,021.71	88.54
	其中：股票	290,915,021.71	88.54
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,022,385.21	0.62
	其中：债券	2,022,385.21	0.62
	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	15,939,507.85	4.85
8	其他各项资产	19,685,257.23	5.99
9	合计	328,562,172.00	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	569,210.00	0.17
B	采矿业	2,466,351.00	0.75
C	制造业	202,161,632.88	61.80
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,307,728.00	1.32
E	建筑业	6,961,458.00	2.13

F	批发和零售业	10,076,052.60	3.08
G	交通运输、仓储和邮政业	4,161,490.20	1.27
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	37,073,040.64	11.33
J	金融业	1,106,910.80	0.34
K	房地产业	3,344,558.00	1.02
L	租赁和商务服务业	2,118,538.10	0.65
M	科学研究和技术服务业	2,509,852.80	0.77
N	水利、环境和公共设施管理业	2,447,364.00	0.75
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	720,756.00	0.22
Q	卫生和社会工作	71,604.00	0.02
R	文化、体育和娱乐业	6,197,127.00	1.89
S	综合	32,180.00	0.01
	合计	286,325,854.02	87.53

注：本报告期末，因基金申购导致本基金投资于天弘国证2000指数增强指数成份股和备选成份股的比例被动低于基金资产净值的90%，已在法定时限内调整完毕。

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	-	-
C	制造业	1,061,088.88	0.32
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	5,830.09	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	2,179,892.00	0.67
H	住宿和餐饮业	-	-

I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,285,492.08	0.39
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	51,666.48	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	5,198.16	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	4,589,167.69	1.40

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	600326	西藏天路	518,600	3,490,178.00	1.07
2	002965	祥鑫科技	59,100	3,290,688.00	1.01
3	002658	雪迪龙	353,200	2,871,516.00	0.88
4	002380	科远智慧	114,400	2,665,520.00	0.81
5	300130	新国都	93,200	2,640,356.00	0.81
6	601126	四方股份	169,800	2,579,262.00	0.79
7	300212	易华录	76,900	2,555,387.00	0.78
8	002929	润建股份	58,700	2,548,167.00	0.78
9	300206	理邦仪器	150,800	2,274,064.00	0.70
10	300570	太辰光	41,400	2,264,994.00	0.69

11	600105	永鼎股份	293,100	2,183,595.00	0.67
12	003031	中瓷电子	16,108	2,144,296.96	0.66
13	002517	恺英网络	135,400	2,131,196.00	0.65
14	300258	精锻科技	146,200	2,118,438.00	0.65
15	600312	平高电气	170,700	2,114,973.00	0.65
16	300394	天孚通信	19,400	2,072,502.00	0.63
17	600072	中船科技	73,200	2,062,044.00	0.63
18	000837	秦川机床	125,700	2,046,396.00	0.63
19	688668	鼎通科技	20,700	2,024,460.00	0.62
20	300286	安科瑞	52,900	2,002,794.00	0.61
21	600391	航发科技	81,000	1,952,910.00	0.60
22	688037	芯源微	11,092	1,896,177.40	0.58
23	002324	普利特	128,500	1,833,695.00	0.56
24	002851	麦格米特	50,100	1,827,147.00	0.56
25	300045	华力创通	157,000	1,821,200.00	0.56
26	002746	仙坛股份	226,800	1,787,184.00	0.55
27	600129	太极集团	29,900	1,778,751.00	0.54
28	688208	道通科技	58,625	1,776,923.75	0.54
29	300745	欣锐科技	40,200	1,775,634.00	0.54
30	000928	中钢国际	183,300	1,768,845.00	0.54
31	300860	锋尚文化	31,900	1,768,536.00	0.54
32	688733	壹石通	55,800	1,727,568.00	0.53
33	300545	联得装备	60,300	1,674,531.00	0.51
34	002609	捷顺科技	142,900	1,666,214.00	0.51
35	301155	海力风电	21,600	1,664,928.00	0.51
36	002777	久远银海	46,900	1,663,543.00	0.51
37	002045	国光电器	103,400	1,660,604.00	0.51
38	603118	共进股份	123,500	1,641,315.00	0.50
39	600502	安徽建工	309,000	1,631,520.00	0.50
40	600993	马应龙	57,500	1,599,075.00	0.49
41	600531	豫光金铅	253,200	1,595,160.00	0.49

42	300224	正海磁材	123,700	1,590,782.00	0.49
43	000811	冰轮环境	99,900	1,574,424.00	0.48
44	002387	维信诺	166,700	1,528,639.00	0.47
45	002284	亚太股份	170,400	1,528,488.00	0.47
46	300765	新诺威	118,560	1,528,238.40	0.47
47	300602	飞荣达	98,300	1,522,667.00	0.47
48	002957	科瑞技术	74,500	1,510,115.00	0.46
49	601882	海天精工	45,000	1,498,500.00	0.46
50	300075	数字政通	59,700	1,485,336.00	0.45
51	603328	依顿电子	175,200	1,450,656.00	0.44
52	603997	继峰股份	101,000	1,444,300.00	0.44
53	300811	铂科新材	24,260	1,442,014.40	0.44
54	002419	天虹股份	245,300	1,435,005.00	0.44
55	600335	国机汽车	122,500	1,396,500.00	0.43
56	300533	冰川网络	27,850	1,391,386.00	0.43
57	600537	亿晶光电	180,700	1,380,548.00	0.42
58	300291	百纳千成	194,600	1,369,984.00	0.42
59	300041	回天新材	113,260	1,336,468.00	0.41
60	301078	孩子王	116,100	1,327,023.00	0.41
61	002895	川恒股份	67,100	1,321,870.00	0.40
62	601975	招商南油	457,700	1,309,022.00	0.40
63	603058	永吉股份	133,500	1,301,625.00	0.40
64	688029	南微医学	15,799	1,288,566.44	0.39
65	300168	万达信息	113,700	1,288,221.00	0.39
66	688186	广大特材	38,342	1,247,265.26	0.38
67	600929	雪天盐业	156,300	1,241,022.00	0.38
68	000034	神州数码	46,500	1,236,435.00	0.38
69	003006	百亚股份	70,800	1,223,424.00	0.37
70	603639	海利尔	67,500	1,209,600.00	0.37
71	601801	皖新传媒	128,300	1,204,737.00	0.37
72	603818	曲美家居	222,600	1,202,040.00	0.37

73	603960	克来机电	64,200	1,197,330.00	0.37
74	600073	上海梅林	163,100	1,190,630.00	0.36
75	300887	谱尼测试	30,000	1,187,400.00	0.36
76	002334	英威腾	93,200	1,187,368.00	0.36
77	300066	三川智慧	216,500	1,182,090.00	0.36
78	600866	星湖科技	214,300	1,178,650.00	0.36
79	000726	鲁泰 A	169,700	1,160,748.00	0.35
80	600748	上实发展	291,700	1,152,215.00	0.35
81	300494	盛天网络	46,380	1,149,760.20	0.35
82	000070	特发信息	118,100	1,140,846.00	0.35
83	300510	金冠股份	162,500	1,134,250.00	0.35
84	002605	姚记科技	24,400	1,132,892.00	0.35
85	002980	华盛昌	33,500	1,120,910.00	0.34
86	603801	志邦家居	32,600	1,076,452.00	0.33
87	600986	浙文互联	164,900	1,055,360.00	0.32
88	600552	凯盛科技	88,000	1,041,920.00	0.32
89	601137	博威合金	66,200	1,030,072.00	0.31
90	000028	国药一致	23,060	1,005,646.60	0.31
91	300447	全信股份	51,900	995,961.00	0.30
92	600285	羚锐制药	61,400	986,084.00	0.30
93	002335	科华数据	27,300	981,435.00	0.30
94	603283	赛腾股份	22,000	979,000.00	0.30
95	300996	普联软件	31,320	961,524.00	0.29
96	300008	天海防务	190,300	957,209.00	0.29
97	603217	元利科技	36,300	934,725.00	0.29
98	300229	拓尔思	35,800	929,726.00	0.28
99	603012	创力集团	150,500	928,585.00	0.28
100	300613	富瀚微	16,300	924,862.00	0.28
101	603355	莱克电气	36,100	917,301.00	0.28
102	603636	南威软件	62,500	916,875.00	0.28
103	002847	盐津铺子	10,650	905,782.50	0.28

104	688018	乐鑫科技	6,967	904,455.94	0.28
105	300263	隆华科技	108,600	903,552.00	0.28
106	300442	润泽科技	29,160	896,961.60	0.27
107	603609	禾丰股份	98,500	896,350.00	0.27
108	300638	广和通	39,040	885,427.20	0.27
109	002351	漫步者	42,500	878,900.00	0.27
110	000055	方大集团	177,400	878,130.00	0.27
111	600199	金种子酒	36,900	876,006.00	0.27
112	002783	凯龙股份	104,700	873,198.00	0.27
113	000862	银星能源	112,700	863,282.00	0.26
114	002261	拓维信息	44,500	859,295.00	0.26
115	601929	吉视传媒	463,500	852,840.00	0.26
116	300161	华中数控	15,900	850,968.00	0.26
117	002401	中远海科	31,700	834,344.00	0.26
118	000731	四川美丰	102,000	831,300.00	0.25
119	600210	紫江企业	153,000	813,960.00	0.25
120	605168	三人行	9,345	803,109.30	0.25
121	300806	斯迪克	42,100	788,112.00	0.24
122	002342	巨力索具	192,000	787,200.00	0.24
123	300409	道氏技术	62,400	784,368.00	0.24
124	603556	海兴电力	31,000	782,440.00	0.24
125	300881	盛德鑫泰	23,700	780,915.00	0.24
126	300762	上海瀚讯	66,200	779,174.00	0.24
127	002139	拓邦股份	59,400	775,170.00	0.24
128	300593	新雷能	33,700	772,067.00	0.24
129	002667	威领股份	45,900	770,202.00	0.24
130	600266	城建发展	151,600	770,128.00	0.24
131	605138	盛泰集团	88,100	768,232.00	0.23
132	000758	中色股份	162,500	767,000.00	0.23
133	000597	东北制药	147,400	765,006.00	0.23
134	300867	圣元环保	43,400	756,462.00	0.23

135	002225	濮耐股份	199,700	754,866.00	0.23
136	688578	艾力斯	28,000	754,600.00	0.23
137	002979	雷赛智能	31,700	753,192.00	0.23
138	688100	威胜信息	24,800	739,288.00	0.23
139	300607	拓斯达	49,100	737,973.00	0.23
140	002573	清新环境	133,700	736,687.00	0.23
141	688626	翔宇医疗	16,100	732,711.00	0.22
142	002283	天润工业	113,900	731,238.00	0.22
143	000626	远大控股	98,100	730,845.00	0.22
144	000048	京基智农	36,700	716,384.00	0.22
145	002367	康力电梯	78,100	713,053.00	0.22
146	600508	上海能源	48,300	709,044.00	0.22
147	002526	山东矿机	283,300	708,250.00	0.22
148	600880	博瑞传播	126,100	706,160.00	0.22
149	300123	亚光科技	96,700	703,976.00	0.22
150	300110	华仁药业	172,100	693,563.00	0.21
151	301266	宇邦新材	9,700	682,007.00	0.21
152	002688	金河生物	142,700	673,544.00	0.21
153	688499	利元亨	10,603	673,502.56	0.21
154	600594	益佰制药	126,900	668,763.00	0.20
155	002291	遥望科技	49,500	648,450.00	0.20
156	600433	冠豪高新	189,500	646,195.00	0.20
157	603800	道森股份	23,700	644,640.00	0.20
158	301216	万凯新材	38,400	638,592.00	0.20
159	300842	帝科股份	6,800	621,792.00	0.19
160	603619	中曼石油	36,700	620,964.00	0.19
161	002391	长青股份	88,500	607,995.00	0.19
162	300219	鸿利智汇	81,900	601,965.00	0.18
163	600617	国新能源	138,600	601,524.00	0.18
164	600478	科力远	83,900	599,046.00	0.18
165	000900	现代投资	142,800	575,484.00	0.18

166	002698	博实股份	32,800	573,672.00	0.18
167	600012	皖通高速	54,600	572,208.00	0.17
168	002959	小熊电器	6,700	559,450.00	0.17
169	002206	海利得	104,300	559,048.00	0.17
170	300470	中密控股	12,080	558,337.60	0.17
171	603279	景津装备	17,800	558,208.00	0.17
172	002270	华明装备	49,900	546,405.00	0.17
173	688106	金宏气体	19,900	541,280.00	0.17
174	300226	上海钢联	16,700	541,080.00	0.17
175	300951	博硕科技	9,900	540,837.00	0.17
176	001258	立新能源	56,900	539,981.00	0.17
177	688389	普门科技	22,900	537,921.00	0.16
178	002651	利君股份	69,200	537,684.00	0.16
179	603187	海容冷链	26,420	528,135.80	0.16
180	002675	东诚药业	35,900	528,089.00	0.16
181	603690	至纯科技	15,100	526,084.00	0.16
182	605123	派克新材	4,800	521,520.00	0.16
183	600269	赣粤高速	140,500	515,635.00	0.16
184	002158	汉钟精机	20,500	511,680.00	0.16
185	603663	三祥新材	34,174	510,901.30	0.16
186	600320	振华重工	136,900	510,637.00	0.16
187	688198	佰仁医疗	4,803	509,646.33	0.16
188	300648	星云股份	15,800	508,444.00	0.16
189	603300	华铁应急	93,264	508,288.80	0.16
190	301051	信濠光电	8,400	508,116.00	0.16
191	600635	大众公用	152,100	504,972.00	0.15
192	300511	雪榕生物	65,900	500,840.00	0.15
193	603103	横店影视	29,700	500,148.00	0.15
194	605009	豪悦护理	10,400	499,200.00	0.15
195	002169	智光电气	60,200	499,058.00	0.15
196	300193	佳士科技	65,300	498,892.00	0.15

197	002448	中原内配	70,900	496,300.00	0.15
198	002986	宇新股份	17,900	493,682.00	0.15
199	688007	光峰科技	23,600	492,060.00	0.15
200	300185	通裕重工	175,400	489,366.00	0.15
201	002017	东信和平	37,310	489,134.10	0.15
202	000541	佛山照明	85,200	486,492.00	0.15
203	002782	可立克	31,800	486,222.00	0.15
204	300770	新媒股份	10,600	486,116.00	0.15
205	301087	可孚医疗	9,800	483,140.00	0.15
206	300673	佩蒂股份	34,200	478,800.00	0.15
207	605077	华康股份	18,000	476,640.00	0.15
208	688568	中科星图	5,900	475,422.00	0.15
209	301096	百诚医药	7,700	466,697.00	0.14
210	002707	众信旅游	61,900	466,107.00	0.14
211	600305	恒顺醋业	42,800	464,808.00	0.14
212	603567	珍宝岛	31,000	463,760.00	0.14
213	002930	宏川智慧	20,200	459,954.00	0.14
214	603008	喜临门	18,000	453,240.00	0.14
215	600007	中国国贸	24,400	451,888.00	0.14
216	600756	浪潮软件	27,100	450,402.00	0.14
217	605337	李子园	24,620	450,053.60	0.14
218	000682	东方电子	45,900	446,148.00	0.14
219	603699	纽威股份	29,400	437,472.00	0.13
220	000751	锌业股份	132,500	437,250.00	0.13
221	300318	博晖创新	79,900	432,259.00	0.13
222	002413	雷科防务	82,600	431,998.00	0.13
223	002097	山河智能	64,700	430,255.00	0.13
224	601619	嘉泽新能	94,500	429,975.00	0.13
225	603197	保隆科技	7,900	428,575.00	0.13
226	600300	维维股份	140,500	427,120.00	0.13
227	002479	富春环保	90,000	419,400.00	0.13

228	600572	康恩贝	61,200	419,220.00	0.13
229	000417	合肥百货	89,100	416,988.00	0.13
230	300791	仙乐健康	14,300	415,272.00	0.13
231	300181	佐力药业	33,900	413,919.00	0.13
232	002588	史丹利	67,800	412,224.00	0.13
233	002886	沃特股份	20,300	411,684.00	0.13
234	601003	柳钢股份	101,300	409,252.00	0.13
235	600728	佳都科技	58,700	406,791.00	0.12
236	688266	泽璟制药	8,700	404,985.00	0.12
236	301095	广立微	4,900	404,985.00	0.12
237	002918	蒙娜丽莎	26,200	404,528.00	0.12
238	600590	泰豪科技	56,500	402,845.00	0.12
239	600419	天润乳业	24,500	397,390.00	0.12
240	300314	戴维医疗	18,700	395,318.00	0.12
241	688526	科前生物	16,500	392,535.00	0.12
242	300131	英唐智控	74,700	392,175.00	0.12
243	002038	双鹭药业	38,600	389,474.00	0.12
244	603881	数据港	17,100	386,289.00	0.12
245	300403	汉字集团	34,600	380,254.00	0.12
246	300147	香雪制药	71,600	377,332.00	0.12
247	002237	恒邦股份	34,200	372,438.00	0.11
248	000534	万泽股份	22,200	372,294.00	0.11
249	300006	莱美药业	108,100	369,702.00	0.11
250	001696	宗申动力	51,600	365,328.00	0.11
251	603377	东方时尚	45,300	364,212.00	0.11
252	002033	丽江股份	32,800	356,864.00	0.11
253	600730	中国高科	57,600	356,544.00	0.11
254	601208	东材科技	27,900	354,330.00	0.11
255	603386	骏亚科技	30,500	346,175.00	0.11
256	002046	国机精工	27,000	344,520.00	0.11
257	002344	海宁皮城	72,100	341,033.00	0.10

258	300624	万兴科技	2,900	339,735.00	0.10
259	300031	宝通科技	13,500	333,720.00	0.10
260	600458	时代新材	27,800	333,322.00	0.10
261	688023	安恒信息	1,900	331,949.00	0.10
262	300401	花园生物	28,400	330,008.00	0.10
263	300532	今天国际	16,000	328,960.00	0.10
264	688235	百济神州	3,000	327,330.00	0.10
265	600268	国电南自	43,200	323,568.00	0.10
266	000555	神州信息	26,300	323,490.00	0.10
267	002741	光华科技	19,100	322,408.00	0.10
268	603708	家家悦	25,500	319,770.00	0.10
269	002416	爱施德	43,100	318,078.00	0.10
270	600480	凌云股份	40,200	315,972.00	0.10
271	603367	辰欣药业	20,800	315,744.00	0.10
272	601900	南方传媒	15,100	309,701.00	0.09
273	300232	洲明科技	33,800	308,932.00	0.09
274	002527	新时达	22,600	307,360.00	0.09
275	000531	穗恒运 A	42,500	307,275.00	0.09
276	600459	贵研铂业	20,000	306,000.00	0.09
277	603920	世运电路	15,600	304,668.00	0.09
278	600512	腾达建设	113,300	303,644.00	0.09
279	300109	新开源	12,200	303,414.00	0.09
280	000016	深康佳 A	64,000	302,080.00	0.09
281	603330	天洋新材	27,000	299,970.00	0.09
282	002171	楚江新材	42,000	299,040.00	0.09
283	600053	九鼎投资	24,100	298,117.00	0.09
284	688519	南亚新材	12,166	292,348.98	0.09
285	600789	鲁抗医药	45,300	290,826.00	0.09
286	603611	诺力股份	11,000	289,740.00	0.09
287	300098	高新兴	79,300	289,445.00	0.09
288	603808	歌力思	22,000	288,860.00	0.09

289	300416	苏试试验	13,380	288,472.80	0.09
290	601827	三峰环境	38,600	285,640.00	0.09
291	300820	英杰电气	3,450	284,211.00	0.09
292	300305	裕兴股份	26,300	284,040.00	0.09
293	300627	华测导航	8,700	282,489.00	0.09
294	300119	瑞普生物	15,700	279,460.00	0.09
295	688595	芯海科技	8,700	278,226.00	0.09
296	300566	激智科技	15,000	276,600.00	0.08
297	002902	铭普光磁	8,800	275,528.00	0.08
298	600738	丽尚国潮	52,400	273,528.00	0.08
299	002187	广百股份	42,000	270,480.00	0.08
300	000567	海德股份	20,840	267,168.80	0.08
301	300504	天邑股份	13,300	266,931.00	0.08
302	300036	超图软件	11,000	260,810.00	0.08
303	300715	凯伦股份	18,300	259,494.00	0.08
304	002298	中电兴发	38,000	258,400.00	0.08
305	300580	贝斯特	10,600	257,474.00	0.08
306	688798	艾为电子	4,300	254,345.00	0.08
307	600797	浙大网新	35,500	253,470.00	0.08
308	300345	华民股份	24,000	251,040.00	0.08
309	688173	希荻微	10,900	249,392.00	0.08
310	000950	重药控股	36,900	248,337.00	0.08
311	002560	通达股份	26,000	247,520.00	0.08
312	600283	钱江水利	17,000	247,350.00	0.08
313	300272	开能健康	46,500	246,450.00	0.08
314	601008	连云港	57,200	242,528.00	0.07
315	300019	硅宝科技	14,000	238,700.00	0.07
316	002060	粤水电	36,200	238,196.00	0.07
317	300236	上海新阳	6,000	237,900.00	0.07
318	000631	顺发恒业	84,200	237,444.00	0.07
319	300856	科思股份	3,000	236,310.00	0.07

320	600888	新疆众和	29,800	236,016.00	0.07
321	600477	杭萧钢构	57,600	235,584.00	0.07
322	300384	三联虹普	13,800	234,462.00	0.07
323	688088	虹软科技	5,400	230,850.00	0.07
324	603399	吉翔股份	19,800	229,086.00	0.07
325	300831	派瑞股份	17,100	225,549.00	0.07
326	600197	伊力特	8,300	225,511.00	0.07
327	688089	嘉必优	7,500	223,500.00	0.07
328	603588	高能环境	23,300	218,321.00	0.07
329	600363	联创光电	5,800	215,180.00	0.07
330	600557	康缘药业	7,800	214,188.00	0.07
331	000539	粤电力 A	29,300	213,890.00	0.07
332	603538	美诺华	11,500	211,830.00	0.06
333	000521	长虹美菱	27,700	211,628.00	0.06
334	688630	芯碁微装	2,500	210,050.00	0.06
335	688268	华特气体	2,600	209,898.00	0.06
336	600223	福瑞达	20,300	208,278.00	0.06
337	300005	探路者	24,600	206,640.00	0.06
338	002126	银轮股份	11,600	205,320.00	0.06
339	600526	菲达环保	42,000	202,440.00	0.06
340	600576	祥源文旅	25,300	201,641.00	0.06
341	002655	共达电声	15,500	201,345.00	0.06
342	002697	红旗连锁	33,900	197,976.00	0.06
343	300518	盛讯达	9,020	197,808.60	0.06
344	002948	青岛银行	62,100	194,373.00	0.06
345	301117	佳缘科技	3,000	193,860.00	0.06
346	002946	新乳业	13,500	193,725.00	0.06
347	002912	中新赛克	4,400	193,644.00	0.06
348	300194	福安药业	49,000	190,120.00	0.06
349	600710	苏美达	21,900	187,464.00	0.06
350	688676	金盘科技	6,188	187,434.52	0.06

351	688123	聚辰股份	3,480	186,945.60	0.06
352	000650	仁和药业	30,100	184,814.00	0.06
353	300855	图南股份	5,180	182,957.60	0.06
354	601965	中国汽研	8,800	181,720.00	0.06
355	600971	恒源煤电	23,300	181,507.00	0.06
356	688357	建龙微纳	2,800	181,132.00	0.06
357	300332	天壕环境	15,700	180,079.00	0.06
358	300079	数码视讯	29,500	179,950.00	0.06
359	000159	国际实业	25,300	179,630.00	0.05
360	002815	崇达技术	14,300	178,035.00	0.05
361	002293	罗莱生活	15,300	175,950.00	0.05
362	688556	高测股份	3,300	175,362.00	0.05
363	000550	江铃汽车	12,500	173,000.00	0.05
364	603105	芯能科技	10,200	172,278.00	0.05
365	688148	芳源股份	14,100	172,020.00	0.05
366	600761	安徽合力	8,600	171,398.00	0.05
367	600736	苏州高新	33,500	169,845.00	0.05
368	002753	永东股份	22,600	164,754.00	0.05
369	002996	顺博合金	13,600	164,560.00	0.05
370	603871	嘉友国际	10,220	160,556.20	0.05
371	000852	石化机械	22,300	160,337.00	0.05
372	603208	江山欧派	4,389	159,847.38	0.05
373	300674	宇信科技	8,900	157,352.00	0.05
374	002635	安洁科技	11,100	153,180.00	0.05
375	688020	方邦股份	3,000	149,910.00	0.05
376	000008	神州高铁	62,700	147,972.00	0.05
377	002233	塔牌集团	19,000	146,680.00	0.04
378	002991	甘源食品	1,900	145,730.00	0.04
379	601101	昊华能源	25,000	145,500.00	0.04
380	300047	天源迪科	17,600	143,264.00	0.04
381	002421	达实智能	40,300	141,856.00	0.04

382	002530	金财互联	15,500	140,430.00	0.04
383	603466	风语筑	9,800	136,220.00	0.04
384	300315	掌趣科技	17,100	133,380.00	0.04
385	002733	雄韬股份	7,700	133,133.00	0.04
386	301207	华兰疫苗	3,950	131,377.00	0.04
387	600428	中远海特	20,800	131,040.00	0.04
388	688019	安集科技	780	128,567.40	0.04
389	002314	南山控股	38,900	128,370.00	0.04
390	300129	泰胜风能	12,900	123,711.00	0.04
391	600586	金晶科技	15,900	122,748.00	0.04
392	002967	广电计量	6,100	122,549.00	0.04
393	603167	渤海轮渡	17,200	122,120.00	0.04
394	300702	天宇股份	4,900	118,923.00	0.04
395	300337	银邦股份	17,500	116,725.00	0.04
396	600996	贵广网络	11,800	115,876.00	0.04
397	300853	申昊科技	3,300	115,830.00	0.04
398	002937	兴瑞科技	4,700	115,620.00	0.04
399	000922	佳电股份	8,700	114,492.00	0.04
400	000789	万年青	14,700	113,925.00	0.03
401	301050	雷电微力	1,700	110,381.00	0.03
402	002318	久立特材	6,400	108,992.00	0.03
403	600643	爱建集团	21,600	108,000.00	0.03
404	003012	东鹏控股	13,300	107,597.00	0.03
405	600864	哈投股份	20,900	106,799.00	0.03
406	603989	XD艾华集	5,000	105,300.00	0.03
407	002148	北纬科技	17,000	103,700.00	0.03
408	002053	云南能投	9,200	103,224.00	0.03
409	601702	华峰铝业	7,400	101,232.00	0.03
410	300002	神州泰岳	7,200	100,800.00	0.03
411	300693	盛弘股份	2,700	99,684.00	0.03
412	300183	东软载波	6,000	99,060.00	0.03

413	603309	维力医疗	6,100	94,367.00	0.03
414	603083	剑桥科技	1,500	94,335.00	0.03
415	300664	鹏鹞环保	16,500	93,390.00	0.03
416	002807	江阴银行	24,600	90,774.00	0.03
417	002354	天娱数科	12,800	89,728.00	0.03
418	600694	大商股份	4,900	86,877.00	0.03
419	688356	键凯科技	800	85,240.00	0.03
420	688658	悦康药业	3,900	81,159.00	0.02
421	600006	东风汽车	13,600	80,376.00	0.02
422	002117	东港股份	7,400	77,996.00	0.02
423	000761	本钢板材	18,400	73,600.00	0.02
424	002524	光正眼科	11,700	71,604.00	0.02
425	600017	日照港	22,700	67,873.00	0.02
426	002424	贵州百灵	7,500	67,350.00	0.02
427	600639	浦东金桥	5,200	64,532.00	0.02
428	300546	雄帝科技	3,500	64,505.00	0.02
429	300287	飞利信	14,300	63,635.00	0.02
430	001308	康冠科技	2,300	63,158.00	0.02
431	300603	立昂技术	5,000	61,400.00	0.02
432	002197	证通电子	5,700	60,078.00	0.02
433	300322	硕贝德	7,100	60,066.00	0.02
434	002100	天康生物	7,100	58,575.00	0.02
435	300768	迪普科技	3,500	57,995.00	0.02
436	002837	英维克	1,900	56,886.00	0.02
437	002238	天威视讯	7,700	53,361.00	0.02
438	601579	会稽山	4,500	53,055.00	0.02
439	300507	苏奥传感	8,100	52,812.00	0.02
440	605377	华旺科技	2,900	52,345.00	0.02
441	603011	合锻智能	6,400	50,560.00	0.02
442	603378	亚士创能	5,500	50,105.00	0.02
443	300911	亿田智能	1,300	49,361.00	0.02

444	603728	鸣志电器	600	48,180.00	0.01
445	002678	珠江钢琴	8,000	45,840.00	0.01
446	600064	南京高科	6,800	44,948.00	0.01
447	002362	汉王科技	1,700	43,333.00	0.01
448	300249	依米康	4,400	42,768.00	0.01
449	000968	蓝焰控股	5,600	42,336.00	0.01
450	002023	海特高新	4,600	42,320.00	0.01
451	603323	苏农银行	9,900	41,679.00	0.01
452	002119	康强电子	3,200	41,504.00	0.01
453	000560	我爱我家	15,600	41,340.00	0.01
454	300319	麦捷科技	4,800	41,088.00	0.01
455	600877	电科芯片	2,700	40,338.00	0.01
456	300007	汉威科技	1,900	40,185.00	0.01
457	002285	世联行	15,500	39,680.00	0.01
458	600933	爱柯迪	1,700	39,593.00	0.01
459	002544	普天科技	1,700	38,930.00	0.01
460	601015	陕西黑猫	8,700	38,454.00	0.01
461	600366	宁波韵升	4,300	38,141.00	0.01
462	600818	中路股份	1,800	38,088.00	0.01
463	688066	航天宏图	611	37,209.90	0.01
464	300101	振芯科技	1,900	36,841.00	0.01
465	002104	恒宝股份	4,200	36,540.00	0.01
466	603533	掌阅科技	1,300	36,036.00	0.01
467	600308	华泰股份	9,660	35,935.20	0.01
468	600467	好当家	14,400	34,848.00	0.01
469	600108	亚盛集团	11,100	33,522.00	0.01
470	300616	尚品宅配	1,600	32,448.00	0.01
471	002757	南兴股份	2,000	32,260.00	0.01
472	000823	超声电子	3,300	31,284.00	0.01
473	688003	天准科技	700	31,241.00	0.01
474	000078	海王生物	9,700	31,234.00	0.01

475	603179	新泉股份	700	30,723.00	0.01
476	600603	广汇物流	4,300	29,928.00	0.01
477	300634	彩讯股份	1,100	29,040.00	0.01
478	300125	聆达股份	1,700	28,696.00	0.01
479	300032	金龙机电	4,400	27,808.00	0.01
480	000921	海信家电	1,000	26,950.00	0.01
481	002612	朗姿股份	1,100	26,158.00	0.01
482	688176	亚虹医药	2,200	25,718.00	0.01
483	000517	荣安地产	8,400	25,620.00	0.01
484	601890	亚星锚链	2,200	25,476.00	0.01
485	300620	光库科技	400	24,512.00	0.01
486	300718	长盛轴承	1,100	24,475.00	0.01
487	600602	云赛智联	1,600	24,096.00	0.01
488	603888	新华网	700	22,974.00	0.01
489	600696	岩石股份	900	22,401.00	0.01
490	000788	北大医药	3,000	20,370.00	0.01
491	600645	中源协和	1,200	20,280.00	0.01
492	300456	赛微电子	800	19,584.00	0.01
493	688408	XD中信博	200	16,866.00	0.01
494	002077	大港股份	1,100	16,445.00	0.01
495	600624	复旦复华	2,600	16,224.00	0.00
496	301039	中集车辆	1,100	14,553.00	0.00
497	000829	天音控股	1,400	12,656.00	0.00
498	002279	久其软件	1,900	12,217.00	0.00
499	002955	鸿合科技	500	11,775.00	0.00
500	600565	迪马股份	6,500	10,270.00	0.00
501	002170	芭田股份	1,400	9,618.00	0.00
502	600814	杭州解百	1,100	9,405.00	0.00
503	000815	美利云	700	8,386.00	0.00
504	002178	延华智能	2,200	8,272.00	0.00
505	002803	吉宏股份	400	8,184.00	0.00

506	002928	华夏航空	600	5,070.00	0.00
507	688278	特宝生物	100	4,391.00	0.00
508	600770	综艺股份	400	2,252.00	0.00
509	600222	太龙药业	100	588.00	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	601107	四川成渝	535,600	2,179,892.00	0.67
2	301236	软通动力	44,400	1,208,124.00	0.37
3	000790	华神科技	16,800	88,368.00	0.03
4	688443	智翔金泰	2,826	86,822.00	0.03
5	301395	仁信新材	3,160	84,308.80	0.03
6	301486	致尚科技	1,402	80,839.32	0.02
7	301292	海科新源	3,494	69,845.06	0.02
8	301488	豪恩汽电	1,645	65,438.10	0.02
9	688603	天承科技	1,043	57,365.00	0.02
10	688334	西高院	2,913	51,666.48	0.02
11	301295	C美硕	1,317	50,024.09	0.02
12	301261	恒工精密	1,325	48,892.50	0.01
13	688623	双元科技	473	43,210.67	0.01
14	301202	朗威股份	1,623	41,905.86	0.01
15	688472	阿特斯	2,255	40,455.36	0.01
16	688631	C莱斯	1,107	35,610.83	0.01
17	688582	N芯动	676	30,257.67	0.01
18	300804	C广康	865	29,457.05	0.01
19	688593	新相微	1,409	23,097.47	0.01
20	301397	C溯联	453	18,870.60	0.01
21	688570	天玛智控	630	16,515.96	0.01

22	688429	C时创	503	13,802.61	0.00
23	301323	新莱福	314	13,137.04	0.00
24	688361	中科飞测	173	11,187.91	0.00
25	301320	豪江智能	531	10,949.22	0.00
26	301325	曼恩斯特	100	10,795.00	0.00
27	688629	C华丰	554	10,298.86	0.00
28	688469	中芯集成	1,856	10,040.96	0.00
29	688552	航天南湖	400	9,688.19	0.00
30	301315	威士顿	173	8,843.76	0.00
31	688562	航天软件	357	7,964.67	0.00
32	688543	国科军工	147	7,798.35	0.00
33	688576	西山科技	63	7,585.83	0.00
34	301399	英特科技	141	7,271.37	0.00
35	688620	C安凯微	582	7,181.88	0.00
36	301210	N金杨	145	7,129.65	0.00
37	301225	恒勃股份	195	6,485.70	0.00
38	301262	海看股份	254	6,477.00	0.00
39	301382	蜂助手	193	6,338.12	0.00
40	688523	航天环宇	259	6,177.15	0.00
41	688458	美芯晟	67	6,080.92	0.00
42	301376	致欧科技	259	5,830.09	0.00
43	688512	慧智微	289	5,537.24	0.00
44	688581	安杰思	46	5,429.38	0.00
45	301170	C锡南	150	5,239.50	0.00
46	301305	朗坤环境	264	5,198.16	0.00
47	301232	飞沃科技	87	5,082.54	0.00
48	301332	德尔玛	366	5,025.18	0.00
49	301355	南王科技	289	4,840.75	0.00
50	301428	世纪恒通	152	4,651.20	0.00
51	301337	亚华电子	125	3,796.25	0.00
52	688479	友车科技	125	3,686.25	0.00

53	001380	华纬科技	106	3,262.68	0.00
54	001282	三联锻造	63	2,080.89	0.00
55	603172	万丰股份	109	1,758.17	0.00
56	001324	长青科技	79	1,548.40	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	601126	四方股份	5,683,756.00	1.74
2	688083	中望软件	5,500,575.33	1.68
3	002895	川恒股份	5,391,458.00	1.65
4	601929	吉视传媒	5,239,568.00	1.60
5	600537	亿晶光电	5,200,057.00	1.59
6	600391	航发科技	5,165,169.00	1.58
7	002782	可立克	5,143,819.00	1.57
8	002324	普利特	5,014,563.00	1.53
9	300765	新诺威	4,985,711.00	1.52
10	002387	维信诺	4,962,754.00	1.52
11	300510	金冠股份	4,958,145.00	1.52
12	300008	天海防务	4,947,901.00	1.51
13	300066	三川智慧	4,941,153.00	1.51
14	603328	XD依顿电	4,928,510.00	1.51
15	600866	星湖科技	4,919,261.21	1.50
16	600502	安徽建工	4,861,941.00	1.49
17	603960	克来机电	4,829,588.00	1.48
18	300745	欣锐科技	4,809,392.50	1.47
19	300532	今天国际	4,777,288.28	1.46
20	600929	雪天盐业	4,723,363.53	1.44

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	300533	冰川网络	5,127,231.50	1.57
2	688083	中望软件	5,058,854.78	1.55
3	300532	今天国际	4,624,532.00	1.41
4	300510	金冠股份	4,481,134.00	1.37
5	002782	可立克	4,216,888.00	1.29
6	300008	天海防务	4,093,275.00	1.25
7	601929	吉视传媒	4,042,187.00	1.24
8	603399	吉翔股份	3,897,480.44	1.19
9	600537	亿晶光电	3,887,497.76	1.19
10	300504	天邑股份	3,862,122.00	1.18
11	300765	新诺威	3,855,089.00	1.18
12	002421	达实智能	3,775,087.00	1.15
13	002387	维信诺	3,728,287.00	1.14
14	300552	万集科技	3,703,317.00	1.13
15	603800	道森股份	3,683,766.00	1.13
16	603328	XD依顿电	3,653,413.09	1.12
17	600391	航发科技	3,528,329.00	1.08
18	002895	川恒股份	3,515,494.00	1.07
19	600129	太极集团	3,503,882.00	1.07
20	600866	星湖科技	3,456,844.00	1.06

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	606,885,607.52
卖出股票收入（成交）总额	318,476,397.68

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	2,022,385.21	0.62
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,022,385.21	0.62

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	019688	22国债23	20,000	2,022,385.21	0.62

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。

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	19,685,257.23
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	19,685,257.23

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

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	301395	仁信新材	84,308.80	0.03	新股未上市
2	688443	智翔金泰	10,999.77	0.00	科创板打新限售

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)	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2000指数增强A	1,535	59,583.08	3,830,821.41	4.19%	87,629,201.93	95.81%
天弘国证2000指数增强C	11,437	20,614.80	920,191.70	0.39%	234,851,311.86	99.61%
合计	12,916	25,335.36	4,751,013.11	1.45%	322,480,513.79	98.55%

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	1,100.52	0.00%
	天弘国证2000指数增强C	92,768.64	0.04%
	合计	93,869.16	0.03%

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)	128,678,441.67	177,470,497.96

日)基金份额总额		
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	12,204,862.70	174,955,887.02
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	49,423,281.03	116,654,881.42
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	91,460,023.34	235,771,503.56

注：本基金合同于2023年03月23日生效。

§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，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》。

在本报告截止日至报告批准送出日之间，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，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**10.7.1 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	609,352,598.70	66.07%	304,728.46	69.57%	-
华安证券	2	312,888,333.36	33.93%	133,311.62	30.43%	-

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。

10.7.2 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	1,998,620.00	100.00%	-	-	-	-	-	-
------	--------------	---------	---	---	---	---	---	---

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指数增强型证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会规定媒介	2023-04-11

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

§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
二〇二三年八月三十一日