

天弘中证 1000 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01月01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	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
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	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产（基金净值）变动表	18
6.4 报表附注	21
§7 投资组合报告	54
7.1 期末基金资产组合情况	54
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	55
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	56
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	67
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	70
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	70
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	70
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	70
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	70
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	71
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	71
7.12 投资组合报告附注	71
§8 基金份额持有人信息	72
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	72
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	73

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.....	73
§9 开放式基金份额变动.....	73
§10 重大事件揭示.....	74
10.1 基金份额持有人大会决议.....	74
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.....	74
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	74
10.4 基金投资策略的改变.....	74
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	74
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.....	74
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	75
10.8 其他重大事件.....	76
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	77
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.....	77
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	77
§12 备查文件目录.....	77
12.1 备查文件目录.....	77
12.2 存放地点.....	77
12.3 查阅方式.....	77

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	天弘中证1000指数增强型证券投资基金	
基金简称	天弘中证1000指数增强	
基金主代码	014201	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022年01月04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	1,036,131,775.60份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	天弘中证1000指数增强A	天弘中证1000指数增强C
下属分级基金的交易代码	014201	014202
报告期末下属分级基金的份额总额	411,017,707.80份	625,114,067.80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，以中证1000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、其他类型资产投资策略（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）。
业绩比较基准	中证1000指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	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	证券日报
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01月01日-2023年06月30日)	
	天弘中证1000指数 增强A	天弘中证1000指数 增强C
本期已实现收益	18,425,847.42	41,117,184.98
本期利润	32,186,667.95	66,215,651.49
加权平均基金份额本期利润	0.0782	0.0823
本期加权平均净值利润率	7.76%	8.17%
本期基金份额净值增长率	7.73%	7.57%
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	3,078,797.80	1,942,996.17
期末可供分配基金份额利润	0.0075	0.0031
期末基金资产净值	414,096,505.60	627,057,063.97
期末基金份额净值	1.0075	1.0031
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	0.75%	0.31%

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

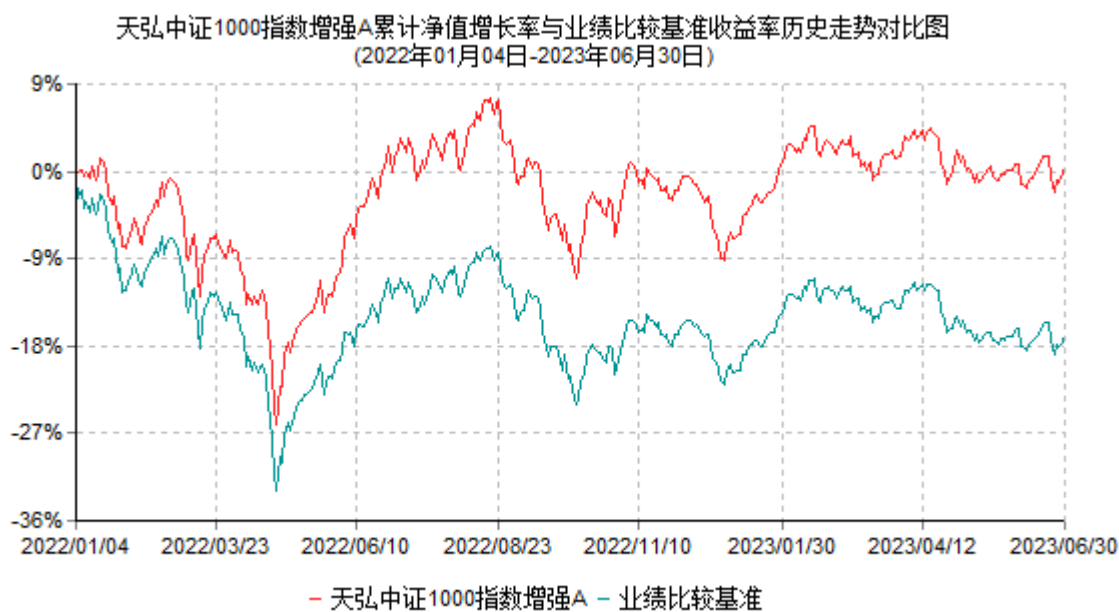
天弘中证1000指数增强A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.57%	0.95%	0.59%	0.99%	-0.02%	-0.04%
过去三个月	-1.64%	0.86%	-3.77%	0.87%	2.13%	-0.01%
过去六个月	7.73%	0.84%	4.87%	0.84%	2.86%	0.00%
过去一年	-0.59%	1.09%	-5.27%	1.05%	4.68%	0.04%
自基金合同生效日起至 今	0.75%	1.34%	-16.62%	1.33%	17.37%	0.01%

天弘中证1000指数增强C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.55%	0.95%	0.59%	0.99%	-0.04%	-0.04%
过去三个月	-1.71%	0.86%	-3.77%	0.87%	2.06%	-0.01%
过去六个月	7.57%	0.84%	4.87%	0.84%	2.70%	0.00%
过去一年	-0.89%	1.09%	-5.27%	1.05%	4.38%	0.04%
自基金合同生效日起至 今	0.31%	1.34%	-16.62%	1.33%	16.93%	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



注：1、本基金合同于2022年01月04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2022年01月04日至2022年07月03日，建仓期结束时及至报告期末，各项资产配置比例均符合基金合同的约定。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

截至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		
杨超	指数与数量投资部总经理、本基金基金经理	2022年01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。
林心龙	本基金基金经理助理	2022年01	-	8年	男，光学工程专业硕士。历任南方基金管理股份有限公

		月			司研究员、新华基金管理股份有限公司基金经理助理,2019年8月加盟本公司,历任高级研究员。
--	--	---	--	--	---

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

2023年上半年，市场整体呈现先扬后抑的震荡走势，同时在存量博弈下体现出快速轮动和结构分化的特征。具体来说：中证全指上涨2.17%，沪深300下跌0.75%，中证500上涨2.29%，创业板指下跌5.61%，中证1000上涨5.10%。报告期内，基金以基准指数为投资基础，通过选股模型围绕基准进行持续优化，力争在基准的行业分布内精选基本面更为优质的标的，并在结构化风险模型和优化器的辅助下构建收益风险比更具优势的投资组合。受益于上述策略的有效性，基金在报告期内取得了一定程度的超额收益。

投资策略方面，本基金作为股票型指数增强基金，在对基准指数进行有效跟踪的基础上，通过对市场结构及公司基本面的持续跟踪分析，利用量化选股模型及优化策略积极抽样组合，力争在控制跟踪误差的同时为投资者提供高于业绩比较基准的投资收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2023年06月30日，天弘中证1000指数增强A基金份额净值为1.0075元，天弘中证1000指数增强C基金份额净值为1.0031元。报告期内份额净值增长率天弘中证1000指数增强A为7.73%，同期业绩比较基准增长率为4.87%；天弘中证1000指数增强C为7.57%，同期业绩比较基准增长率为4.87%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2023年下半年，我们认为尽管面临全球经济复苏乏力、国内有效需求仍待释放、国际环境依然严峻复杂等诸多挑战，但经济的恢复向好趋势仍将延续，虽然恢复的速度可能不及2022年底时市场的乐观预期，但这仍将是一个斜率大于零的持续改善的过程，并且随着资产负债表和信心的不断修复而最终使经济运行进入投资、生产、消费活动相互促进的正向循环。但应注意到，随着经济转型的不断推进和经济发展中主要矛盾的变化，传统刺激政策和偏总量的货币信用工具可能会逐步让位于更加聚焦于高质量发展、现代化工业体系打造、产业链供应链安全可控等关键领域的结构性政策和工具，这一过程也将孕育出若干中长期大体量的投资机会。

证券市场方面，我们认为A股已具备较好的中长期投资价值：一方面，随着国内经济恢复向好以及海外加息节奏趋缓，资产负债表的修复和风险偏好的提升已可期待，前期制约市场向上运行的不确定因素逐渐边际好转；另一方面，经历过去一年半的调整出清，市场估值已具备吸引力，投资的收益风险比明显改善，配置价值显现。同时，在国

内流动性相对充裕以及海外通胀压力预期好转的背景下，A股料将迎来增量配置资金。总体来说，我们对国内证券市场在2023年下半年的表现持相对乐观的态度。但是，也应看到当市场整体运行在波动率较大的区间时，无论是宽基指数还是细分行业指数，预测其变化的幅度、速率以及时间窗口的难度仍然较大，当未知因素变多时，一套以概率思维为指导的行之有效的应对方法，也许比更依赖单一结果的押注式预测更加具有现实意义。因此，我们亦鼓励投资者一方面以更长期的视角进行基金配置，更多考虑业绩与估值的匹配程度以及收益风险比，同时另一方面在投资时机以及投资品种上进行一定的分散化处理，以更好的进行风险对冲，最终力争实现收益的长期积累并更充分的发挥复利效应。

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01月01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：天弘中证1000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	上年度末 2022年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	47,986,022.73	55,263,651.58
结算备付金		3,420,954.15	4,250,321.57

存出保证金		469,708.99	338,692.18
交易性金融资产	6.4.7.2	986,882,999.23	986,983,849.69
其中：股票投资		981,725,916.96	984,433,325.72
基金投资		-	-
债券投资		5,157,082.27	2,550,523.97
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		111,468.12	588,716.78
应收股利		-	-
应收申购款		6,713,166.11	4,665,133.51
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		1,045,584,319.33	1,052,090,365.31
负债和净资产	附注号	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-

应付清算款		128,203.07	-
应付赎回款		2,758,102.61	4,558,400.18
应付管理人报酬		490,259.30	553,268.49
应付托管费		81,709.88	92,211.43
应付销售服务费		141,938.68	175,982.49
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	830,536.22	700,072.42
负债合计		4,430,749.76	6,079,935.01
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	1,036,131,775.60	1,120,571,293.42
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	5,021,793.97	-74,560,863.12
净资产合计		1,041,153,569.57	1,046,010,430.30
负债和净资产总计		1,045,584,319.33	1,052,090,365.31

注：1.报告截止日2023年06月30日，天弘中证1000指数增强型证券投资基金A类基金份额净值1.0075元，天弘中证1000指数增强型证券投资基金C类基金份额净值1.0031元；基金份额总额1,036,131,775.60份，其中天弘中证1000指数增强型证券投资基金A类基金份额411,017,707.80份，天弘中证1000指数增强型证券投资基金C类基金份额625,114,067.80份。

2.本财务报表的比较期间为2022年01月04日(基金合同生效日)至2022年06月30日(下同)。

6.2 利润表

会计主体：天弘中证1000指数增强型证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2023年01月01日至 2023年06月30日	2022年01月04日(基金 合同生效日)至2022

			年06月30日
一、营业总收入		103,954,030.34	17,522,641.58
1.利息收入		317,479.24	284,410.72
其中：存款利息收入	6.4.7.9	317,479.24	284,410.72
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）		64,344,024.59	-33,375,209.45
其中：股票投资收益	6.4.7.10	52,434,788.23	-37,739,352.62
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	691,457.43	4,076.11
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-
收益			
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	11,217,778.93	4,360,067.06
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	38,859,287.04	50,377,161.97
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	433,239.47	236,278.34
减：二、营业总支出		5,551,710.90	2,553,082.17

1. 管理人报酬		3,629,807.43	2,008,343.18
2. 托管费		604,967.94	334,723.82
3. 销售服务费		1,197,914.73	158,719.71
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		1.05	-
8. 其他费用	6.4.7.19	119,019.75	51,295.46
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		98,402,319.44	14,969,559.41
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		98,402,319.44	14,969,559.41
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		98,402,319.44	14,969,559.41

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：天弘中证1000指数增强型证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01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）	1,120,571,293.42	-	-74,560,863.12	1,046,010,430.30
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）	1,120,571,293.42	-	-74,560,863.12	1,046,010,430.30
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-84,439,517.82	-	79,582,657.09	-4,856,860.73
（一）、综合收益总额	-	-	98,402,319.44	98,402,319.44
（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）	-84,439,517.82	-	-18,819,662.35	-103,259,180.17
其中：1.基金申购款	1,923,349,416.20	-	5,744,272.54	1,929,093,688.74
2.基金赎回款	-2,007,788,934.02	-	-24,563,934.89	-2,032,352,868.91
（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）	1,036,131,775.60	-	5,021,793.97	1,041,153,569.57
项目	上年度可比期间			

	2022年01月04日（基金合同生效日）至2022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）	801,558,434.01	-	-	801,558,434.01
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-262,403.92	-	10,506,655.91	10,244,251.99
（一）、综合收益总额	-	-	14,969,559.41	14,969,559.41
（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）	-262,403.92	-	-4,462,903.50	-4,725,307.42
其中：1.基金申购款	356,193,413.98	-	-26,082,399.97	330,111,014.01
2.基金赎回款	-356,455,817.90	-	21,619,496.47	-334,836,321.43
（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)	801,296,030.09	-	10,506,655.91	811,802,686.00

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

天弘中证1000指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)本基金经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2021]3444号《关于准予天弘中证1000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《天弘中证1000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,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801,034,186.25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(2022)第0015号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《天弘中证1000指数增强型证券投资基金合同》于2022年1月4日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为801,558,434.01份基金份额,其中认购资金利息折合524,247.76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《天弘中证1000指数增强型证券投资基金合同》和《天弘中证1000指数增强型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金根据所收取认购/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《天弘中证1000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：中证1000指数收益率 \times 95%+银行活期存款利率(税后) \times 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》、《天弘中证1000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年度上半年财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2023年06月30日的财务状况以及2023年度上半年的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

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

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

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

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(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	47,986,022.73	
等于：本金	47,974,835.78	
加：应计利息	11,186.95	
减：坏账准备	-	
定期存款	-	
等于：本金	-	
加：应计利息	-	
减：坏账准备	-	
其中：存款期限1个月以内	-	
存款期限1-3个月	-	
存款期限3个月以上	-	
其他存款	-	
等于：本金	-	
加：应计利息	-	
减：坏账准备	-	
合计	47,986,022.73	

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	992,778,868.20	-	981,725,916.96	-11,052,951.24
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债 交易所市场	5,098,490.00	58,102.27	5,157,082.27	490.00

券	银行间市场	-	-	-	-
	合计	5,098,490.00	58,102.27	5,157,082.27	490.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		997,877,358.20	58,102.27	986,882,999.23	-11,052,461.24

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	236.33
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	731,120.94
其中：交易所市场	731,120.94
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	99,178.95
合计	830,536.22

6.4.7.7 实收基金**6.4.7.7.1 天弘中证1000指数增强A**

金额单位：人民币元

项目 (天弘中证1000指数增强A)	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	412,377,610.84	412,377,610.84
本期申购	202,697,398.00	202,697,398.00
本期赎回（以“-”号填列）	-204,057,301.04	-204,057,301.04
本期末	411,017,707.80	411,017,707.80

6.4.7.7.2 天弘中证1000指数增强C

金额单位：人民币元

项目 (天弘中证1000指数增强C)	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	708,193,682.58	708,193,682.58
本期申购	1,720,652,018.20	1,720,652,018.20
本期赎回（以“-”号填列）	-1,803,731,632.98	-1,803,731,632.98
本期末	625,114,067.80	625,114,067.80

注：申购含转换转入份额；赎回含转换转出份额。

6.4.7.8 未分配利润**6.4.7.8.1 天弘中证1000指数增强A**

单位：人民币元

项目 (天弘中证1000指数增强A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-8,240,855.09	-18,489,555.79	-26,730,410.88
本期利润	18,425,847.42	13,760,820.53	32,186,667.95
本期基金份额交易产	222,362.53	-2,599,821.80	-2,377,459.27

生的变动数			
其中：基金申购款	1,969,828.07	-374,620.79	1,595,207.28
基金赎回款	-1,747,465.54	-2,225,201.01	-3,972,666.55
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,407,354.86	-7,328,557.06	3,078,797.80

6.4.7.8.2 天弘中证1000指数增强C

单位：人民币元

项目 (天弘中证1000指数增强C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	-16,117,999.22	-31,712,453.02	-47,830,452.24
本期利润	41,117,184.98	25,098,466.51	66,215,651.49
本期基金份额交易产生的变动数	-11,912,443.92	-4,529,759.16	-16,442,203.08
其中：基金申购款	3,030,276.53	1,118,788.73	4,149,065.26
基金赎回款	-14,942,720.45	-5,648,547.89	-20,591,268.34
本期已分配利润	-	-	-
本期末	13,086,741.84	-11,143,745.67	1,942,996.17

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
活期存款利息收入	278,269.09
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	36,019.97
其他	3,190.18
合计	317,479.24

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01月01日至2023年06月30日
卖出股票成交总额	3,342,106,669.28
减：卖出股票成本总额	3,284,287,962.50
减：交易费用	5,383,918.55
买卖股票差价收入	52,434,788.23

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01月01日至2023年06月30日
债券投资收益——利息收入	6,120.58
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	685,336.85
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	691,457.43

6.4.7.11.2 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01月01日至2023年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	5,313,367.82
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	4,565,375.00
减：应计利息总额	62,585.92
减：交易费用	70.05

买卖债券差价收入	685,336.85
----------	------------

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01月01日至2023年06月30日
股票投资产生的股利收益	11,217,778.93
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	11,217,778.93

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01月01日至2023年06月30日
1.交易性金融资产	38,859,287.04
——股票投资	38,856,092.04
——债券投资	3,195.00
——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	38,859,287.04

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
基金赎回费收入	430,671.06
基金转换费收入	2,568.41
合计	433,239.47

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01月01日至2023年06月30日
审计费用	39,671.58
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	19,840.80
合计	119,019.75

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
天弘基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
中国农业银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日 至2023年06月30 日	上年度可比期间 2022年01月04日（基金合同 生效日）至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,629,807.43	2,008,343.18
其中：支付销售机构的客户维护费	1,326,918.71	948,258.17

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01月01日 至2023年06月30 日	上年度可比期间 2022年01月04日（基金合同生 效日）至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	604,967.94	334,723.82

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01月01日至2023年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	天弘中证1000指数增强A	天弘中证1000指数增强C	合计
天弘基金 管理有限 公司	-	295,182.81	295,182.81
中国农业 银行股份 有限公司	-	17,110.51	17,110.51
合计	-	312,293.32	312,293.32
获得销售	上年度可比期间		

服务费的各关联方名称	2022年01月04日（基金合同生效日）至2022年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	天弘中证1000指数增强A	天弘中证1000指数增强C	合计
天弘基金管理有限公司	-	39,129.81	39,129.81
中国农业银行股份有限公司	-	9,853.16	9,853.16
合计	-	48,982.97	48,982.97

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。天弘中证1000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、天弘中证1000指数增强A不收取销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行过银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度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01月01日至2023年06月30日		上年度可比期间 2022年01月04日（基金合同生效日） 至2022年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	47,986,022.73	278,269.09	69,373,356.22	262,178.16

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券交易。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

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
6885	裕太	2023	6个月	科创	92.00	162.7	4,183	384,8	680,7	-

15	微	-02-01		板打 新限售		5		36.00	83.25	
301486	致尚科技	2023-06-30	1个月内 (含)	新股 未上市	57.66	57.66	4,820	277,921.20	277,921.20	-
301395	仁信新材	2023-06-21	1个月内 (含)	新股 未上市	26.68	26.68	5,196	138,629.28	138,629.28	-
301292	海科新源	2023-06-29	1个月内 (含)	新股 未上市	19.99	19.99	5,824	116,421.76	116,421.76	-
301488	豪恩汽电	2023-06-26	1个月内 (含)	新股 未上市	39.78	39.78	2,618	104,144.04	104,144.04	-
301202	朗威股份	2023-06-28	1个月内 (含)	新股 未上市	25.82	25.82	3,060	79,009.20	79,009.20	-
688603	天承科技	2023-06-30	1个月内 (含)	新股 未上市	55.00	55.00	1,391	76,505.00	76,505.00	-
301261	恒工精密	2023-06-29	1个月内 (含)	新股 未上市	36.90	36.90	1,973	72,803.70	72,803.70	-
688472	阿特斯	2023-06-02	6个月	科创板 打新限售	11.10	17.04	3,687	40,925.70	62,826.48	-
688469	中芯集成	2023-04-28	6个月	科创板 打新限售	5.69	5.41	10,702	60,894.38	57,897.82	-
688485	九州	2023-01-1	6个月	科创	17.47	15.17	3,580	62,542.60	54,308.60	-

	一轨	1		板打 新限售							
3013 58	湖南 裕能	2023 -02-0 1	6个月	创业 板打 新限售	23.77	42.89	1,260	29,95 0.20	54,04 1.40	-	
6883 61	中科 飞测	2023 -05-1 2	6个月	科创 板打 新限售	23.60	64.67	831	19,61 1.60	53,74 0.77	-	
6884 43	智翔 金泰	2023 -06-1 3	6个月	科创 板打 新限售	37.88	29.49	1,794	67,95 6.72	52,90 5.06	-	
3012 60	格力 博	2023 -01-2 0	6个月	创业 板打 新限售	30.85	23.63	2,131	65,74 1.35	50,35 5.53	-	
6885 31	日联 科技	2023 -03-2 4	6个月	科创 板打 新限售	152.3 8	135.9 7	346	52,72 3.48	47,04 5.62	-	
3013 25	曼恩 斯特	2023 -05-0 4	6个月	创业 板打 新限售	76.80	107.9 5	364	27,95 5.20	39,29 3.80	-	
6881 46	中船 特气	2023 -04-1 3	6个月	科创 板打 新限售	36.15	38.13	1,011	36,54 7.65	38,54 9.43	-	
0012 86	陕西 能源	2023 -03-3 1	6个月	新股 锁定	9.60	9.41	3,767	36,16 3.20	35,44 7.47	-	

301301	川宁生物	2022-12-20	6个月	创业板打新限售	5.00	8.96	3,574	17,870.00	32,023.04	-
001287	中电港	2023-03-30	6个月	新股锁定	11.88	21.02	1,386	16,465.68	29,133.72	-
688576	西山科技	2023-05-30	6个月	科创板打新限售	135.80	120.41	240	32,592.00	28,898.40	-
688352	颀中科技	2023-04-11	6个月	科创板打新限售	12.10	12.07	2,361	28,568.10	28,497.27	-
601061	中信金属	2023-03-30	6个月	新股锁定	6.58	7.58	3,708	24,398.64	28,106.64	-
688507	索辰科技	2023-04-10	6个月	科创板打新限售	245.56	122.11	222	36,834.00	27,108.42	-
688582	N芯动	2023-06-21	6个月	科创板打新限售	26.74	40.68	648	17,327.52	26,360.64	-
301293	三博脑科	2023-04-25	6个月	创业板打新限售	29.60	71.42	333	9,856.80	23,782.86	-
301303	真兰仪表	2023-02-13	6个月	创业板打新限售	26.80	22.32	1,058	28,354.40	23,614.56	-

688552	航天南湖	2023-05-08	6个月	科创板打新限售	21.17	23.50	956	20,238.52	22,466.00	-
688570	天玛智控	2023-05-29	6个月	科创板打新限售	30.26	25.33	884	26,749.84	22,391.72	-
301307	美利信	2023-04-14	6个月	创业板打新限售	32.34	31.86	687	22,217.58	21,887.82	-
688543	国科军工	2023-06-14	6个月	科创板打新限售	43.67	53.05	410	17,904.70	21,750.50	-
301322	绿通科技	2023-02-27	6个月	创业板打新限售	131.11	53.24	391	34,219.71	20,816.84	-
688458	美芯晟	2023-05-15	6个月	科创板打新限售	75.00	90.76	221	16,575.00	20,057.96	-
688581	安杰思	2023-05-12	6个月	科创板打新限售	125.80	118.03	163	20,505.40	19,238.89	-
301317	鑫磊股份	2023-01-12	6个月	创业板打新限售	20.67	26.17	694	14,344.98	18,161.98	-
301262	海看股份	2023-06-1	6个月	创业板打	30.22	25.50	692	20,912.24	17,646.00	-

		3		新限售							
688478	晶升股份	2023-04-13	6个月	科创板打新限售	32.52	42.37	402	13,073.04	17,032.74	-	
688562	航天软件	2023-05-15	6个月	科创板打新限售	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06	-	
301439	泓淋电力	2023-03-10	6个月	创业板打新限售	19.99	16.90	949	18,970.51	16,038.10	-	
688623	双元科技	2023-05-31	6个月	科创板打新限售	125.88	86.79	178	22,406.64	15,448.62	-	
301332	德尔玛	2023-05-09	6个月	创业板打新限售	14.81	13.73	1,122	16,616.82	15,405.06	-	
301399	英特科技	2023-05-16	6个月	创业板打新限售	43.99	51.57	293	12,889.07	15,110.01	-	
301408	华人健康	2023-02-22	6个月	创业板打新限售	16.24	16.95	879	14,274.96	14,899.05	-	
301305	朗坤环境	2023-05-15	6个月	创业板打新限售	25.25	19.69	753	19,013.25	14,826.57	-	

301397	C溯联	2023-06-15	6个月	创业板打新限售	53.27	40.20	362	19,283.74	14,552.40	-
301419	阿莱德	2023-02-02	6个月	创业板打新限售	24.80	43.85	330	8,184.00	14,470.50	-
688334	西高院	2023-06-09	6个月	科创板打新限售	14.16	16.21	888	12,574.08	14,394.48	-
688593	新相微	2023-05-25	6个月	科创板打新限售	11.18	14.59	959	10,721.62	13,991.81	-
301210	N金杨	2023-06-21	6个月	创业板打新限售	57.88	49.17	281	16,264.28	13,816.77	-
688512	慧智微	2023-05-08	6个月	科创板打新限售	20.92	19.16	721	15,083.32	13,814.36	-
301382	蜂助手	2023-05-09	6个月	创业板打新限售	23.80	32.84	408	9,710.40	13,398.72	-
301320	豪江智能	2023-06-01	6个月	创业板打新限售	13.06	20.62	642	8,384.52	13,238.04	-
688433	华曙高科	2023-04-0	6个月	科创板打	26.66	31.50	418	11,143.88	13,167.00	-

		7		新限售						
688629	C华丰	2023-06-16	6个月	科创板打新限售	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72	-
688620	C安凯微	2023-06-15	6个月	科创板打新限售	10.68	12.34	1,016	10,850.88	12,537.44	-
301360	荣旗科技	2023-04-17	6个月	创业板打新限售	71.88	92.60	134	9,631.92	12,408.40	-
301345	涛涛车业	2023-03-10	6个月	创业板打新限售	73.45	46.64	266	19,537.70	12,406.24	-
301315	威士顿	2023-06-13	6个月	创业板打新限售	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	-
688523	航天环宇	2023-05-26	6个月	科创板打新限售	21.86	23.85	472	10,317.92	11,257.20	-
603135	中重科技	2023-03-29	6个月	新股锁定	17.80	17.89	628	11,178.40	11,234.92	-
301225	恒勃股份	2023-06-08	6个月	创业板打新限售	35.66	33.26	333	11,874.78	11,075.58	-
3014	森泰	2023	6个月	创业	28.75	21.02	499	14,34	10,48	-

29	股份	-04-10		板打新限售				6.25	8.98	
601065	江盐集团	2023-03-31	6个月	新股锁定	10.36	11.84	875	9,065.00	10,360.00	-
688631	C莱斯	2023-06-19	6个月	科创板打新限售	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	-
688479	友车科技	2023-05-04	6个月	科创板打新限售	33.99	29.49	332	11,284.68	9,790.68	-
301232	飞沃科技	2023-06-08	6个月	创业板打新限售	72.50	58.42	165	11,962.50	9,639.30	-
301376	致欧科技	2023-06-14	6个月	创业板打新限售	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20	-
301355	南王科技	2023-06-02	6个月	创业板打新限售	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25	-
301357	北方长龙	2023-04-11	6个月	创业板打新限售	50.00	48.39	190	9,500.00	9,194.10	-
301386	未来电器	2023-03-21	6个月	创业板打新限售	29.99	23.79	378	11,336.22	8,992.62	-

301323	新莱福	2023-05-29	6个月	创业板打新限售	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08	-
688429	C时创	2023-06-20	6个月	科创板打新限售	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	-
301373	凌玮科技	2023-01-20	6个月	创业板打新限售	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45	-
301170	C锡南	2023-06-16	6个月	创业板打新限售	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50	-
301281	科源制药	2023-03-28	6个月	创业板打新限售	44.18	25.10	337	10,647.38	8,458.70	-
688535	华海诚科	2023-03-28	6个月	科创板打新限售	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	-
601133	柏诚股份	2023-03-31	6个月	新股锁定	11.66	12.26	664	7,742.24	8,140.64	-
301157	华塑科技	2023-03-01	6个月	创业板打新限售	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-
301295	C美硕	2023-06-19	6个月	创业板打新限售	37.40	36.07	215	8,041.00	7,755.05	-

				售							
300804	C广康	2023-06-15	6个月	创业板打新限售	42.45	32.97	226	9,593.70	7,451.22	-	
301337	亚华电子	2023-05-16	6个月	创业板打新限售	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-	
301428	世纪恒通	2023-05-10	6个月	创业板打新限售	26.35	30.60	229	6,034.15	7,007.40	-	
001380	华纬科技	2023-05-09	6个月	新股锁定	28.84	30.78	170	4,902.80	5,232.60	-	
603125	常青科技	2023-03-30	6个月	新股锁定	25.98	24.53	160	4,156.80	3,924.80	-	
001328	登康口腔	2023-03-29	6个月	新股锁定	20.68	25.49	145	2,998.60	3,696.05	-	
001282	三联锻造	2023-05-15	6个月	新股锁定	27.93	33.03	105	2,932.65	3,468.15	-	
001360	南矿集团	2023-03-31	6个月	新股锁定	15.38	14.87	177	2,722.26	2,631.99	-	
603137	恒尚节能	2023-04-10	6个月	新股锁定	15.90	17.09	139	2,210.10	2,375.51	-	
001324	长青科技	2023-05-12	6个月	新股锁定	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-	
001367	海森药业	2023-03-3	6个月	新股锁定	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-	

		0								
603172	万丰股份	2023-04-28	6个月	新股锁定	14.58	16.13	122	1,778.76	1,967.86	-

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482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。

5、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520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。

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583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262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、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306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。

9、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140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。

10、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198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。

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	上年度末 2022年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	5,157,082.27	2,550,523.97
合计	5,157,082.27	2,550,523.97

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

本基金本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级的同业存单。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级的债券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级的同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场上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	47,986,022.73	-	-	-	47,986,022.73
结算备付金	3,420,954.15	-	-	-	3,420,954.15
存出保证金	469,708.99	-	-	-	469,708.99
交易性金融资产	5,157,082.27	-	-	981,725,916.96	986,882,999.23
应收清算款	-	-	-	111,468.12	111,468.12
应收申购款	-	-	-	6,713,166.11	6,713,166.11
资产总计	57,033,768.1	-	-	988,550,551.1	1,045,584,319.

	4			9	33
负债					
应付清算款	-	-	-	128,203.07	128,203.07
应付赎回款	-	-	-	2,758,102.61	2,758,102.61
应付管理人报酬	-	-	-	490,259.30	490,259.30
应付托管费	-	-	-	81,709.88	81,709.88
应付销售服务费	-	-	-	141,938.68	141,938.68
其他负债	-	-	-	830,536.22	830,536.22
负债总计	-	-	-	4,430,749.76	4,430,749.76
利率敏感度缺口	57,033,768.14	-	-	984,119,801.43	1,041,153,569.57
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	55,263,651.58	-	-	-	55,263,651.58
结算备付金	4,250,321.57	-	-	-	4,250,321.57
存出保证金	338,692.18	-	-	-	338,692.18
交易性金融资产	2,550,523.97	-	-	984,433,325.72	986,983,849.69
应收清算款	-	-	-	588,716.78	588,716.78
应收申购款	-	-	-	4,665,133.51	4,665,133.51
资产总计	62,403,189.30	-	-	989,687,176.01	1,052,090,365.31
负债					
应付赎回款	-	-	-	4,558,400.18	4,558,400.18
应付管理人报酬	-	-	-	553,268.49	553,268.49
应付托管费	-	-	-	92,211.43	92,211.43
应付销售服务费	-	-	-	175,982.49	175,982.49
其他负债	-	-	-	700,072.42	700,072.42
负债总计	-	-	-	6,079,935.01	6,079,935.01
利率敏感度缺口	62,403,189.30	-	-	983,607,241.00	1,046,010,430.30

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0.50%(2022年12月31日：0.24%)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响(2022年12月31日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金采用指数增强型投资策略，以中证1000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		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	981,725,916.96	94.29	984,433,325.72	94.11
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	981,725,916.96	94.29	984,433,325.72	94.11

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	上年度末 2022年12月31日
	业绩比较基准上升5%	52,005,620.80	54,544,213.89
	业绩比较基准下降5%	-52,005,620.80	-54,544,213.89

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	上年度末 2022年12月31日
第一层次	978,643,410.38	983,330,530.26
第二层次	6,022,516.45	2,550,523.97
第三层次	2,217,072.40	1,102,795.46
合计	986,882,999.23	986,983,849.69

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(2022年12月31日：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	981,725,916.96	93.89
	其中：股票	981,725,916.96	93.89
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,157,082.27	0.49
	其中：债券	5,157,082.27	0.49
	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	51,406,976.88	4.92
8	其他各项资产	7,294,343.22	0.70
9	合计	1,045,584,319.33	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	19,969,990.00	1.92
B	采矿业	34,559,299.00	3.32
C	制造业	636,323,270.28	61.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	32,022,137.00	3.08
E	建筑业	20,387,421.72	1.96
F	批发和零售业	2,510,415.00	0.24
G	交通运输、仓储和邮政业	10,953,738.00	1.05
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	118,912,919.13	11.42
J	金融业	22,322,569.00	2.14
K	房地产业	25,734,441.00	2.47
L	租赁和商务服务业	10,046,457.00	0.96
M	科学研究和技术服务业	11,588,910.35	1.11
N	水利、环境和公共设施管理业	458.00	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	4,496,336.00	0.43
R	文化、体育和娱乐业	28,307,818.00	2.72
S	综合	-	-
	合计	978,136,179.48	93.95

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	3,201,761.31	0.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.00
E	建筑业	10,516.15	0.00
F	批发和零售业	81,593.61	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	119,783.56	0.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	26.87	0.00
M	科学研究和技术服务业	14,394.48	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	102,431.17	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	23,782.86	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,589,737.48	0.34

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	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资
---	------	------	-------	---------	------

号					产净值比 例(%)
1	300777	中简科技	384,600	18,176,196.00	1.75
2	002335	科华数据	475,100	17,079,845.00	1.64
3	300457	赢合科技	954,944	16,864,311.04	1.62
4	300206	理邦仪器	1,111,800	16,765,944.00	1.61
5	603328	依顿电子	1,974,219	16,346,533.32	1.57
6	002782	可立克	1,067,500	16,322,075.00	1.57
7	002258	利尔化学	1,259,420	16,259,112.20	1.56
8	601619	嘉泽新能	3,542,400	16,117,920.00	1.55
9	603690	至纯科技	437,780	15,252,255.20	1.46
10	300638	广和通	671,335	15,225,877.80	1.46
11	600320	振华重工	4,063,500	15,156,855.00	1.46
12	002234	民和股份	819,800	14,928,558.00	1.43
13	002737	葵花药业	612,300	14,903,382.00	1.43
14	603027	千禾味业	701,708	14,820,072.96	1.42
15	688083	中望软件	102,186	14,805,729.54	1.42
16	605507	国邦医药	695,100	14,784,777.00	1.42
17	300803	指南针	301,000	14,625,590.00	1.40
18	002215	诺普信	1,917,100	14,397,421.00	1.38
19	002558	巨人网络	774,700	13,890,371.00	1.33
20	600929	雪天盐业	1,733,000	13,760,020.00	1.32
21	002285	世联行	5,323,500	13,628,160.00	1.31
22	002747	埃斯顿	460,608	12,897,024.00	1.24
23	300768	迪普科技	772,600	12,801,982.00	1.23
24	600990	四创电子	404,300	12,792,052.00	1.23
25	688711	宏微科技	218,134	12,725,937.56	1.22
26	600612	老凤祥	178,900	12,501,532.00	1.20
27	600977	中国电影	876,600	12,316,230.00	1.18
28	600502	安徽建工	2,288,424	12,082,878.72	1.16
29	601567	三星医疗	921,600	11,639,808.00	1.12

30	002724	海洋王	1,330,700	11,550,476.00	1.11
31	300109	新开源	463,000	11,514,810.00	1.11
32	600583	海油工程	1,952,020	11,419,317.00	1.10
33	001696	宗申动力	1,555,400	11,012,232.00	1.06
34	000951	中国重汽	634,300	10,687,955.00	1.03
35	600266	城建发展	2,064,200	10,486,136.00	1.01
36	603103	横店影视	601,900	10,135,996.00	0.97
37	601369	陕鼓动力	1,098,000	10,002,780.00	0.96
38	000758	中色股份	2,118,200	9,997,904.00	0.96
39	688239	航宇科技	142,112	9,940,734.40	0.95
40	300224	正海磁材	761,650	9,794,819.00	0.94
41	002928	华夏航空	1,132,800	9,572,160.00	0.92
42	301031	中熔电气	69,000	9,363,990.00	0.90
43	600098	广州发展	1,461,500	9,032,070.00	0.87
44	002020	京新药业	702,500	9,006,050.00	0.87
45	301087	可孚医疗	181,550	8,950,415.00	0.86
46	002990	盛视科技	233,500	8,592,800.00	0.83
47	002017	东信和平	654,330	8,578,266.30	0.82
48	300723	一品红	288,800	8,461,840.00	0.81
49	000921	海信家电	313,300	8,443,435.00	0.81
50	603197	保隆科技	154,500	8,381,625.00	0.81
51	002641	公元股份	1,474,700	8,317,308.00	0.80
52	688088	虹软科技	194,376	8,309,574.00	0.80
53	603279	景津装备	264,817	8,304,661.12	0.80
54	002610	爱康科技	3,059,000	7,831,040.00	0.75
55	002085	万丰奥威	1,124,700	7,794,171.00	0.75
56	300226	上海钢联	234,420	7,595,208.00	0.73
57	300208	青岛中程	888,200	7,354,296.00	0.71
58	600933	爱柯迪	312,500	7,278,125.00	0.70
59	002484	江海股份	339,400	7,225,826.00	0.69
60	002967	广电计量	346,000	6,951,140.00	0.67

61	000672	上峰水泥	747,300	6,822,849.00	0.66
62	300738	奥飞数据	667,880	6,812,376.00	0.65
63	603179	新泉股份	153,200	6,723,948.00	0.65
64	688018	乐鑫科技	51,654	6,705,722.28	0.64
65	603396	金辰股份	101,700	6,671,520.00	0.64
66	002123	梦网科技	489,582	6,506,544.78	0.62
67	002695	煌上煌	591,400	6,322,066.00	0.61
68	002517	恺英网络	393,200	6,188,968.00	0.59
69	600971	恒源煤电	764,700	5,957,013.00	0.57
70	002262	恩华药业	192,400	5,931,692.00	0.57
71	300294	博雅生物	159,100	5,772,148.00	0.55
72	600197	伊力特	207,000	5,624,190.00	0.54
73	000552	甘肃能化	1,640,400	5,462,532.00	0.52
74	600572	康恩贝	796,400	5,455,340.00	0.52
75	300085	银之杰	462,900	5,443,704.00	0.52
76	600578	京能电力	1,340,000	5,239,400.00	0.50
77	688733	壹石通	167,680	5,191,372.80	0.50
78	002895	川恒股份	250,900	4,942,730.00	0.47
79	002918	蒙娜丽莎	319,700	4,936,168.00	0.47
80	688798	艾为电子	83,105	4,915,660.75	0.47
81	000058	深赛格	777,000	4,801,860.00	0.46
82	688128	中国电研	186,607	4,758,478.50	0.46
83	300143	盈康生命	391,300	4,437,342.00	0.43
84	688033	天宜上佳	230,917	4,415,133.04	0.42
85	601801	皖新传媒	436,600	4,099,674.00	0.39
86	002929	润建股份	91,100	3,954,651.00	0.38
87	600864	哈投股份	768,800	3,928,568.00	0.38
88	600478	科力远	539,100	3,849,174.00	0.37
89	002126	银轮股份	217,400	3,847,980.00	0.37
90	603733	仙鹤股份	172,800	3,602,880.00	0.35
91	601399	国机重装	1,109,900	3,529,482.00	0.34

92	601137	博威合金	222,200	3,457,432.00	0.33
93	600057	厦门象屿	383,500	3,336,450.00	0.32
94	002174	游族网络	187,000	3,141,600.00	0.30
95	600129	太极集团	52,200	3,105,378.00	0.30
96	688148	芳源股份	254,229	3,101,593.80	0.30
97	300762	上海瀚讯	261,600	3,079,032.00	0.30
98	002746	仙坛股份	389,800	3,071,624.00	0.30
99	688318	财富趋势	30,506	3,049,684.82	0.29
100	002456	欧菲光	529,400	2,964,640.00	0.28
101	603997	继峰股份	207,300	2,964,390.00	0.28
102	002124	天邦食品	622,600	2,826,604.00	0.27
103	300232	洲明科技	302,500	2,764,850.00	0.27
104	688131	皓元医药	48,475	2,762,105.50	0.27
105	300634	彩讯股份	102,100	2,695,440.00	0.26
106	688166	博瑞医药	116,342	2,558,360.58	0.25
107	300674	宇信科技	144,600	2,556,528.00	0.25
108	000065	北方国际	170,200	2,556,404.00	0.25
109	002948	青岛银行	794,300	2,486,159.00	0.24
110	300693	盛弘股份	66,500	2,455,180.00	0.24
111	600211	西藏药业	38,500	2,286,900.00	0.22
112	605296	神农集团	103,400	2,214,828.00	0.21
113	600633	浙数文化	131,400	2,129,994.00	0.20
114	002583	海能达	365,500	2,123,555.00	0.20
115	000950	重药控股	309,300	2,081,589.00	0.20
116	002060	粤水电	295,300	1,943,074.00	0.19
117	300773	拉卡拉	110,400	1,925,376.00	0.18
118	688161	威高骨科	42,512	1,841,194.72	0.18
119	300134	大富科技	164,417	1,685,274.25	0.16
120	002237	恒邦股份	136,700	1,488,663.00	0.14
121	000860	顺鑫农业	41,300	1,391,397.00	0.13
122	000885	城发环境	103,800	1,381,578.00	0.13

123	000550	江铃汽车	93,100	1,288,504.00	0.12
124	600531	豫光金铅	203,400	1,281,420.00	0.12
125	000061	农产品	211,400	1,266,286.00	0.12
126	600761	安徽合力	57,900	1,153,947.00	0.11
127	000685	中山公用	152,200	1,152,154.00	0.11
128	300133	华策影视	160,100	1,135,109.00	0.11
129	000528	柳工	143,300	1,132,070.00	0.11
130	300811	铂科新材	18,800	1,117,472.00	0.11
131	002664	信质集团	77,700	1,094,016.00	0.11
132	601965	中国汽研	51,800	1,069,670.00	0.10
133	000560	我爱我家	360,700	955,855.00	0.09
134	300767	震安科技	35,000	887,600.00	0.09
135	300737	科顺股份	85,900	786,844.00	0.08
136	601126	四方股份	48,700	739,753.00	0.07
137	000426	兴业银锡	81,100	720,168.00	0.07
138	301047	义翘神州	8,200	702,740.00	0.07
139	300672	国科微	8,100	675,135.00	0.06
140	002314	南山控股	201,300	664,290.00	0.06
141	000682	东方电子	66,300	644,436.00	0.06
142	002318	久立特材	37,700	642,031.00	0.06
143	002344	海宁皮城	135,700	641,861.00	0.06
144	600908	无锡银行	118,600	635,696.00	0.06
145	601019	山东出版	67,700	620,809.00	0.06
146	002807	江阴银行	149,600	552,024.00	0.05
147	000913	钱江摩托	30,000	546,900.00	0.05
148	002324	普利特	37,300	532,271.00	0.05
149	000923	河钢资源	38,100	514,350.00	0.05
150	688368	晶丰明源	3,899	495,991.79	0.05
151	603505	金石资源	20,900	488,015.00	0.05
152	300332	天壕环境	41,900	480,593.00	0.05
153	002605	姚记科技	10,100	468,943.00	0.05

154	300068	南都电源	24,100	466,576.00	0.04
155	601908	京运通	71,700	433,785.00	0.04
156	002158	汉钟精机	17,200	429,312.00	0.04
157	600490	鹏欣资源	108,500	399,280.00	0.04
158	688676	金盘科技	12,083	365,994.07	0.04
159	603609	禾丰股份	35,800	325,780.00	0.03
160	002051	中工国际	23,100	275,583.00	0.03
161	601028	XD玉龙股	25,240	271,330.00	0.03
162	600400	红豆股份	80,000	262,400.00	0.03
163	002698	博实股份	13,900	243,111.00	0.02
164	300775	三角防务	6,100	206,058.00	0.02
165	603567	珍宝岛	13,600	203,456.00	0.02
166	002283	天润工业	30,100	193,242.00	0.02
167	002612	朗姿股份	7,900	187,862.00	0.02
168	688206	概伦电子	6,649	186,437.96	0.02
169	600966	博汇纸业	30,000	177,600.00	0.02
170	688106	金宏气体	6,188	168,313.60	0.02
171	300633	开立医疗	2,900	158,050.00	0.02
172	300180	华峰超纤	39,500	142,595.00	0.01
173	002635	安洁科技	10,100	139,380.00	0.01
174	002701	奥瑞金	30,800	138,908.00	0.01
175	300065	海兰信	11,000	136,290.00	0.01
176	002036	联创电子	12,500	121,375.00	0.01
177	600420	国药现代	8,200	92,578.00	0.01
178	600210	紫江企业	17,400	92,568.00	0.01
179	688100	威胜信息	3,086	91,993.66	0.01
180	301080	百普赛斯	1,400	87,948.00	0.01
181	002461	珠江啤酒	9,300	81,933.00	0.01
182	603298	杭叉集团	3,100	73,005.00	0.01
183	600458	时代新材	6,000	71,940.00	0.01
184	600984	建设机械	15,200	68,704.00	0.01

185	603919	金徽酒	2,700	63,396.00	0.01
186	300185	通裕重工	21,900	61,101.00	0.01
187	000028	国药一致	1,400	61,054.00	0.01
188	000686	东北证券	8,500	58,990.00	0.01
189	002416	爱施德	7,700	56,826.00	0.01
190	301239	普瑞眼科	500	49,040.00	0.00
191	600581	八一钢铁	9,900	40,095.00	0.00
192	002233	塔牌集团	4,700	36,284.00	0.00
193	603323	苏农银行	8,100	34,101.00	0.00
194	300666	江丰电子	500	33,980.00	0.00
195	301301	川宁生物	3,574	32,023.04	0.00
196	601515	东风股份	7,300	31,974.00	0.00
197	600729	重庆百货	1,000	31,440.00	0.00
198	300765	新诺威	1,900	24,491.00	0.00
199	002611	东方精工	3,900	22,386.00	0.00
200	688598	金博股份	81	13,891.50	0.00
201	688202	美迪西	140	11,935.00	0.00
202	002044	美年健康	1,400	9,954.00	0.00
203	603043	广州酒家	300	8,478.00	0.00
204	002697	红旗连锁	1,400	8,176.00	0.00
205	688023	安恒信息	46	8,036.66	0.00
206	688389	普门科技	158	3,711.42	0.00
207	688315	诺禾致源	127	3,371.85	0.00
208	688568	中科星图	35	2,820.30	0.00
209	688268	华特气体	29	2,341.17	0.00
210	688388	嘉元科技	69	1,857.48	0.00
211	688559	海目星	38	1,786.38	0.00
212	605111	新洁能	40	1,740.80	0.00
213	003012	东鹏控股	200	1,618.00	0.00
214	688639	华恒生物	17	1,538.16	0.00
215	002961	瑞达期货	100	1,441.00	0.00

216	605365	立达信	45	674.10	0.00
217	688198	佰仁医疗	6	636.66	0.00
218	000035	中国天楹	100	458.00	0.00
219	301069	凯盛新材	11	279.84	0.00
220	688408	XD中信博	2	168.66	0.00
221	603601	再升科技	20	85.40	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	688515	裕太微	4,183	680,783.25	0.07
2	301486	致尚科技	4,820	277,921.20	0.03
3	688496	清越科技	12,000	238,560.00	0.02
4	301395	仁信新材	5,196	138,629.28	0.01
5	688620	C安凯微	10,157	135,209.66	0.01
6	301225	恒勃股份	3,324	118,422.57	0.01
7	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.01
8	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.01
9	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.01
10	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.01
11	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.01
12	688472	阿特斯	3,687	62,826.48	0.01
13	688469	中芯集成	10,702	57,897.82	0.01
14	688485	九州一轨	3,580	54,308.60	0.01
15	301358	湖南裕能	1,260	54,041.40	0.01
16	688361	中科飞测	831	53,740.77	0.01
17	688443	智翔金泰	1,794	52,905.06	0.01
18	301399	英特科技	893	50,810.01	0.00
19	301260	格力博	2,131	50,355.53	0.00

20	301305	朗坤环境	2,353	48,122.57	0.00
21	688531	日联科技	346	47,045.62	0.00
22	301325	曼恩斯特	364	39,293.80	0.00
23	688146	中船特气	1,011	38,549.43	0.00
24	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00
25	001287	中电港	1,386	29,133.72	0.00
26	688576	西山科技	240	28,898.40	0.00
27	688352	颀中科技	2,361	28,497.27	0.00
28	601061	中信金属	3,708	28,106.64	0.00
29	688507	索辰科技	222	27,108.42	0.00
30	688582	N芯动	648	26,360.64	0.00
31	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
32	301303	真兰仪表	1,058	23,614.56	0.00
33	688552	航天南湖	956	22,466.00	0.00
34	688570	天玛智控	884	22,391.72	0.00
35	301307	美利信	687	21,887.82	0.00
36	688543	国科军工	410	21,750.50	0.00
37	301322	绿通科技	391	20,816.84	0.00
38	688458	美芯晟	221	20,057.96	0.00
39	688581	安杰思	163	19,238.89	0.00
40	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.00
41	301262	海看股份	692	17,646.00	0.00
42	688478	晶升股份	402	17,032.74	0.00
43	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
44	301439	泓淋电力	949	16,038.10	0.00
45	688623	双元科技	178	15,448.62	0.00
46	301332	德尔玛	1,122	15,405.06	0.00
47	301408	华人健康	879	14,899.05	0.00
48	301397	C溯联	362	14,552.40	0.00
49	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00
50	688334	西高院	888	14,394.48	0.00

51	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
52	301210	N金杨	281	13,816.77	0.00
53	688512	慧智微	721	13,814.36	0.00
54	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
55	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00
56	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
57	688629	C华丰	708	13,161.72	0.00
58	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
59	301345	涛涛车业	266	12,406.24	0.00
60	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
61	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
62	603135	中重科技	628	11,234.92	0.00
63	301429	森泰股份	499	10,488.98	0.00
64	601065	江盐集团	875	10,360.00	0.00
65	688631	C莱斯	336	10,036.32	0.00
66	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
67	301232	飞沃科技	165	9,639.30	0.00
68	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
69	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
70	301357	北方长龙	190	9,194.10	0.00
71	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
72	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
73	688429	C时创	346	8,833.38	0.00
74	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
75	301170	C锡南	250	8,732.50	0.00
76	301281	科源制药	337	8,458.70	0.00
77	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
78	601133	柏诚股份	664	8,140.64	0.00
79	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
80	301295	C美硕	215	7,755.05	0.00
81	300804	C广康	226	7,451.22	0.00

82	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
83	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
84	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
85	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
86	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
87	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
88	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
89	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
90	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
91	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
92	603172	万丰股份	122	1,967.86	0.00
93	301290	东星医疗	30	961.50	0.00
94	688432	有研硅	44	690.36	0.00
95	301102	兆讯传媒	1	26.87	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	603027	千禾味业	43,108,511.23	4.12
2	300638	广和通	42,171,797.22	4.03
3	002518	科士达	38,075,774.19	3.64
4	300777	中简科技	32,797,796.09	3.14
5	600391	航发科技	32,469,607.99	3.10
6	002558	巨人网络	31,969,490.60	3.06
7	300803	指南针	29,094,462.70	2.78
8	688733	壹石通	29,080,185.46	2.78
9	002782	可立克	28,554,462.00	2.73
10	601126	四方股份	26,926,597.16	2.57

11	300457	赢合科技	26,455,119.00	2.53
12	600929	雪天盐业	25,395,909.71	2.43
13	002959	小熊电器	25,040,805.73	2.39
14	603960	克来机电	24,585,587.21	2.35
15	300170	汉得信息	24,407,237.11	2.33
16	301031	中熔电气	23,750,001.00	2.27
17	603103	横店影视	23,709,874.54	2.27
18	688575	亚辉龙	23,591,622.00	2.26
19	688083	中望软件	23,361,013.12	2.23
20	300401	花园生物	23,288,011.50	2.23
21	002737	葵花药业	23,151,443.52	2.21
22	300224	正海磁材	22,766,906.58	2.18
23	300487	蓝晓科技	22,726,529.33	2.17
24	300765	新诺威	22,553,040.10	2.16
25	605507	国邦医药	22,504,225.00	2.15
26	600502	安徽建工	22,380,956.00	2.14
27	002258	利尔化学	22,091,519.42	2.11
28	603328	XD依顿电	21,516,551.67	2.06
29	603118	共进股份	21,489,222.00	2.05
30	601567	三星医疗	21,380,635.29	2.04
31	300109	新开源	21,084,174.98	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。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002518	科士达	37,358,260.35	3.57
2	600391	航发科技	35,800,814.00	3.42

3	002517	恺英网络	33,534,745.00	3.21
4	600129	太极集团	31,709,004.54	3.03
5	600481	双良节能	30,618,003.52	2.93
6	603027	千禾味业	29,671,612.54	2.84
7	603960	克来机电	29,665,040.12	2.84
8	300638	广和通	29,510,435.94	2.82
9	300170	汉得信息	29,305,678.00	2.80
10	300765	新诺威	28,640,818.15	2.74
11	002959	小熊电器	28,361,863.60	2.71
12	300487	蓝晓科技	27,573,525.72	2.64
13	601126	四方股份	27,541,497.00	2.63
14	002463	沪电股份	26,376,807.60	2.52
15	002036	联创电子	25,083,477.33	2.40
16	002567	唐人神	24,763,270.68	2.37
17	603118	共进股份	24,617,310.74	2.35
18	600557	康缘药业	24,462,140.68	2.34
19	002055	得润电子	24,357,793.98	2.33
20	002558	巨人网络	24,006,912.00	2.30
21	600685	中船防务	23,774,420.00	2.27
22	300856	科思股份	21,846,176.00	2.09
23	300401	花园生物	21,139,350.01	2.02
24	688575	亚辉龙	21,121,257.62	2.02
25	688518	联赢激光	21,035,769.60	2.01
26	600098	广州发展	21,025,589.00	2.01
27	300791	仙乐健康	21,001,750.47	2.01

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	3,242,724,461.70
--------------	------------------

卖出股票收入（成交）总额	3,342,106,669.28
--------------	------------------

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	5,157,082.27	0.50
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	5,157,082.27	0.50

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	51,000	5,157,082.27	0.50

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	469,708.99
2	应收清算款	111,468.12
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	6,713,166.11
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,294,343.22

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	688515	裕太微	680,783.25	0.07	科创板打新限售
2	301486	致尚科技	277,921.20	0.03	新股未上市
3	301395	仁信新材	138,629.28	0.01	新股未上市
4	688620	安凯微	12,537.44	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
天弘中证1000指数增强A	13,212	31,109.42	4,450,432.34	1.08%	406,567,275.46	98.92%
天弘中证1000指数增强C	95,656	6,535.02	260,335,019.04	41.65%	364,779,048.76	58.35%
合计	108,416	9,557.00	264,785,451.38	25.56%	771,346,324.22	74.44%

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	天弘中证1000指数增强A	498,169.95	0.12%
	天弘中证1000指数增强C	89,169.74	0.01%
	合计	587,339.69	0.06%

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	天弘中证1000指数增强A	10~50
	天弘中证1000指数增强C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	天弘中证1000指数增强A	10~50
	天弘中证1000指数增强C	0
	合计	10~50

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	天弘中证1000指数增强 A	天弘中证1000指数增强 C
基金合同生效日(2022年01月04)	691,065,976.04	110,492,457.97

日)基金份额总额		
本报告期期初基金份额总额	412,377,610.84	708,193,682.58
本报告期基金总申购份额	202,697,398.00	1,720,652,018.20
减：本报告期基金总赎回份额	204,057,301.04	1,803,731,632.98
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	411,017,707.80	625,114,067.80

§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	
长江证券	1	-	-	-	-	-
第一创业证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	6,568,770,490.26	100.00%	1,519,363.77	100.00%	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中信建投证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-

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情况稳定；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交易席位租用协议。

3、本基金报告期内新租用交易单元：华西证券深圳交易单元。

4、本基金报告期内停止租用交易单元：无。

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
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
第一创业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	8,849,386.59	89.28%	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	1,063,100.00	10.72%	-	-	-	-	-	-

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	天弘中证1000指数增强型证券投资基金2022年第4季度报告	中国证监会规定媒介	2023-01-28
2	天弘基金管理有限公司关于防范不法分子冒用公司名义	中国证监会规定媒介	2023-03-24

	进行诈骗活动的风险提示		
3	天弘中证1000指数增强型证券投资基金2022年年度报告	中国证监会规定媒介	2023-03-31
4	天弘基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定媒介	2023-04-01
5	天弘中证1000指数增强型证券投资基金2023年第1季度报告	中国证监会规定媒介	2023-04-23

§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中证1000指数增强型证券投资基金募集的文件
- 2、天弘中证1000指数增强型证券投资基金基金合同
- 3、天弘中证1000指数增强型证券投资基金托管协议
- 4、天弘中证1000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