

天弘中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人:天弘基金管理有限公司

基金托管人:光大证券股份有限公司

送出日期:2024 年 03 月 29 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人光大证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年03月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自2023年03月15日起至2023年12月31日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况.....	9
§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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§6 审计报告	15
6.1 审计报告基本信息.....	15
6.2 审计报告的基本内容	15
§7 年度财务报表.....	18
7.1 资产负债表.....	18
7.2 利润表	20
7.3 净资产变动表	21
7.4 报表附注	22
§8 投资组合报告	49
8.1 期末基金资产组合情况.....	49
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	50
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	51
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	58
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	67
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	67
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	67
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	67
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	67
8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	68

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	68
8.12 投资组合报告附注	68
§9 基金份额持有人信息	69
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	69
9.2 期末上市基金前十名持有人	69
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	70
9.4 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	70
§10 开放式基金份额变动	70
§11 重大事件揭示	70
11.1 基金份额持有人大会决议	70
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	70
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	71
11.4 基金投资策略的改变	71
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	71
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	71
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	71
11.8 其他重大事件	72
§12 影响投资者决策的其他重要信息	76
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	76
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	78
§13 备查文件目录	78
13.1 备查文件目录	78
13.2 存放地点	79
13.3 查阅方式	79

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	天弘中证1000增强策略ETF
场内简称	1000增强ETF天弘
基金主代码	159685
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2023年03月15日
基金管理人	天弘基金管理有限公司
基金托管人	光大证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	53,440,067.00份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2023年04月03日

2.2 基金产品说明

投资目标	在对标的指数进行有效跟踪被动投资基础上，通过量化策略进行组合投资，并结合增强型的主动投资力争获取超越业绩比较基准的超额收益，实现基金资产的长期增值。
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，力争控制本基金份额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0.35%，年跟踪误差不超过6.5%，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、存托凭证投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、股票期权投资策略、国债期货投资策略、参与融资及转融通证券出借业务的投资策略。
业绩比较基准	中证1000指数收益率
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

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	光大证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	童建林
	联系电话	022-83310208
	电子邮箱	service@thfund.com.cn
客户服务电话	95046	021-22167436
传真	022-83865564	021-22167424
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	上海市新闻路1508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	上海市新闻路1508号
邮政编码	300203	200040
法定代表人	韩歆毅	刘秋明

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网	www.thfund.com.cn

址	
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	中国上海市浦东新区东育路588号前滩中心42楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	本期2023年03月15日（基金合同生效日） - 2023年12月31日
本期已实现收益	-1,755,515.78
本期利润	-2,402,349.69
加权平均基金份额本期利润	-0.0326
本期加权平均净值利润率	-3.39%
本期基金份额净值增长率	-10.87%
3.1.2 期末数据和指标	2023年末
期末可供分配利润	-5,809,036.74
期末可供分配基金份额利润	-0.1087
期末基金资产净值	47,631,030.26
期末基金份额净值	0.8913
3.1.3 累计期末指标	2023年末
基金份额累计净值增长率	-10.87%

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

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-2.57%	1.03%	-3.15%	1.04%	0.58%	-0.01%
过去六个月	-11.89%	1.01%	-10.83%	1.00%	-1.06%	0.01%
自基金合同生效日起至今	-10.87%	0.95%	-13.04%	0.96%	2.17%	-0.01%

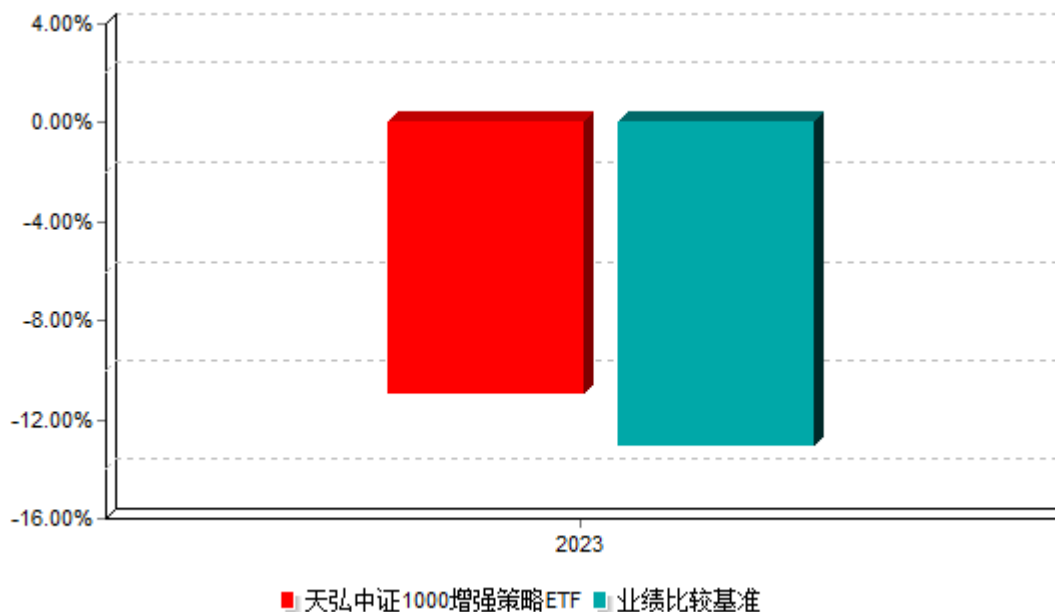
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、本基金合同于2023年03月15日生效。

2、按照本基金合同的约定，基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。本基金的建仓期为2023年03月15日至2023年09月14日，建仓期结束时及至报告期末，各项资产配置比例均符合基金合同的约定。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金合同于2023年03月15日生效。基金合同生效当年2023年的净值增长率按照基金合同生效后当年的实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金于2023年03月15日成立，自基金合同生效以来未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

截至2023年12月31日，公司共管理运作189只公募基金，公司业务范围涵盖二级市场股票投资、债券投资、现金管理、衍生品投资等。公司始终秉承“稳健理财，值得信赖”的理念，坚持为投资者带来优质的基金产品和理财服务。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张戈	本基金基金经理	2023年03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。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其配套规则和其他相关法律法规、基金合同的有关规定，勤勉尽责地管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。

本报告期内，本基金运作合法合规，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

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

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

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内,本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中,同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易次数为5次,投资组合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易,未导致不公平交易和利益输送。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023年中证1000指数先涨后跌。年初受AI概念和泛科技股行情影响指数一度涨幅明显,但此后走势逐渐变弱,尤其四季度跌幅较为明显。整体来看去年指数走势反应出市场流动性逐渐萎缩,缺乏主线的状态。2023年下半年以来相当长一段时间,指数点位变化不大,结构特征亦不明晰。作为中小市值风格代表指数,中证1000指数表现好于大盘蓝筹风格指数,在此基础上基金管理人以量化投资模型为工具进行增强取得一定效果。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2023年12月31日,本基金份额净值为0.8913元,本报告期份额净值增长率-10.87%,同期业绩比较基准增长率-13.04%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

以AI为代表的人工智能技术迭代周期方兴未艾,2024年是相关硬件和内容爆发的年份。以此为核心,华为鸿蒙、苹果产业链、机器人、智能驾驶等科技成长领域仍将有投资机会。这些机会在中证1000及其他小市值成长指数上都有映射,随着流动性改善以及市场自发寻底、见底过程逐步完成,2024年中证1000指数及相关增强产品走势仍值得期待。管理人将加速量化因子迭代,在偏离可控的基础上力争更高超额收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内,本基金管理人的监察稽核工作一切从合规运作、防范和控制风险、保障基金份额持有人利益出发,由独立的内控合规部门按照规定的权限和程序,认真履行职责,对公司、基金运作及员工行为的合法性、合规性进行定期和不定期监督和检查。发现问题及时提出建议并督促相关部门改进完善,及时与有关人员沟通,并定期制作监察

稽核报告报公司董事会。公司经理层面成立了风险管理委员会，根据公司总体风险控制目标，分配各业务和各环节风险控制目标和要求；落实公司重大风险管理的决定或决议；听取并讨论会议成员的报告；对会议成员提出的或发现的已经存在的风险点，在充分讨论、协调基础上形成具体的风险控制措施；对潜在风险点分析讨论，拟定应对措施；对发生的风险事件和重大差错，分析原因、总结经验教训、风险定级、划分责任，向总经理办公会报告。

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

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

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

2、在投资交易环节，对投资运作过程中的风险点进行识别和监控，预防和控制由内部或外部流程、人员和系统失控而造成的损失；根据法律法规要求、基金合同约定、投资决策委员会的决定，适时提出增加或优化交易系统风控指标的建议，通过投资交易系统控制投资风险；跟踪每日的交易行为和交易结果，发现预警信息通过电话、邮件及合规提示及时提醒，保障投资环节的合规运作；监督检查各投资组合新股申购、一级债申购、银行间交易等场外交易的合规执行情况，保证各投资组合场外交易的事中合规控制；

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

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

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构，负责制定公司所管理基金的基本估值政策，对公司旗下基金已采用的估值政策、方法、流程的执行情况进行审核监督，对因经营环境或市场变化等导致需调整已实施的估值政策、方法和流程的，负责审查批准基金估值政策、方法和流程的变更和执行。确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益。估值委员会成员由公司分管投资的高级管理人员、督察长、首席风控官、分管估值业务高级管理人员以及研究管理人员组成。

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

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

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

报告期内，本基金管理人未与任何第三方签订与估值相关的定价服务协议。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

2023年11月7日至2023年12月29日，本基金连续20个工作日基金资产净值低于5000万，未连续50个工作日基金资产净值低于5000万。

§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

本报告期内，光大证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对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、基金收益分配等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2024)第24954号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	(一)我们审计的内容 我们审计了天弘中证1000增

	<p>强策略交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“天弘中证1000增强策略ETF”)的财务报表,包括2023年12月31日的资产负债表,2023年3月15日(基金合同生效日)至2023年12月31日止期间的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见 我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了天弘中证1000增强策略ETF2023年12月31日的财务状况以及2023年3月15日(基金合同生效日)至2023年12月31日止期间的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于天弘中证1000增强策略ETF,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	无
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>天弘中证1000增强策略ETF的基金管理人天弘基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估天弘中证1000增强策略ETF的持续经营能力,披露与持</p>

	<p>续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算天弘中证1000增强策略ETF、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督天弘中证1000增强策略ETF的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：(一)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。(二)了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。(三)评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。(四)对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对天弘中证1000增强策略ETF持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留</p>

	意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致天弘中证1000增强策略ETF不能持续经营。(五)评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	张振波	林佳璐
会计师事务所的地址	中国上海市浦东新区东育路588号前滩中心42楼	
审计报告日期	2024-03-27	

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2023年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年12月31日
资产：		
货币资金	7.4.7.1	2,050,219.39
结算备付金		407,902.84
存出保证金		490,679.63
交易性金融资产	7.4.7.2	44,983,105.04
其中：股票投资		44,983,105.04
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-

其他投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收清算款		174,872.02
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.5	-
资产总计		48,106,778.92
负债和净资产	附注号	本期末 2023年12月31日
负债：		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		330,854.23
应付赎回款		-
应付管理人报酬		19,270.05
应付托管费		3,854.02
应付销售服务费		-
应付投资顾问费		-
应交税费		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.6	121,770.36
负债合计		475,748.66
净资产：		
实收基金	7.4.7.7	53,440,067.00
未分配利润	7.4.7.8	-5,809,036.74
净资产合计		47,631,030.26

负债和净资产总计		48,106,778.92
----------	--	---------------

注：1.报告截止日2023年12月31日，基金份额净值0.8913元，基金份额总额53,440,067.00份。

2.本财务报表的实际编制期间为2023年03月15日(基金合同生效日)至2023年12月31日，无上一年度可比期间(下同)。

7.2 利润表

会计主体：天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023年03月15日（基金合同生效日）至2023年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年03月15日（基金合同 生效日）至2023年12月31 日
一、营业总收入		-1,878,275.57
1.利息收入		219,396.77
其中：存款利息收入	7.4.7.9	219,396.77
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-2,214,579.81
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-2,632,602.99
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.11	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	-
贵金属投资收益	7.4.7.13	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-219,043.86
股利收益	7.4.7.15	637,067.04
其他投资收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-646,833.91

4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	763,741.38
减：二、营业总支出		524,074.12
1.管理人报酬		278,096.01
2.托管费		55,619.21
3.销售服务费		-
4.投资顾问费		-
5.利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6.信用减值损失	7.4.7.18	-
7.税金及附加		-
8.其他费用	7.4.7.19	190,358.90
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-2,402,349.69
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-2,402,349.69
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-2,402,349.69

7.3 净资产变动表

会计主体：天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023年03月15日（基金合同生效日）至2023年12月31日

单位：人民币元

项目	本期		
	2023年03月15日（基金合同生效日）至2023年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-
二、本期期初净资产	281,440,067.00	-	281,440,067.00
三、本期增减变动	-228,000,000.00	-5,809,036.74	-233,809,036.74

额（减少以“-”号填列）			
（一）、综合收益总额	-	-2,402,349.69	-2,402,349.69
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-228,000,000.00	-3,406,687.05	-231,406,687.05
其中：1.基金申购款	114,000,000.00	-3,639,256.25	110,360,743.75
2.基金赎回款	-342,000,000.00	232,569.20	-341,767,430.80
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	53,440,067.00	-5,809,036.74	47,631,030.26

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

高阳

薄贺龙

薄贺龙

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金(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]3020号《关于准予天弘中证1000增强策略交易型开放式指数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增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式基金，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281,424,879.00元(含募集股票市值)，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

0153号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于2023年3月15日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为281,440,067.00份基金份额,其中认购资金利息折合15,188.00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,基金托管人为光大证券股份有限公司。

根据《天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定,经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2023]223号文审核同意,本基金281,440,067.00份基金份额于2023年4月3日在深交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》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(含主板、创业板及其他中国证监会注册或核准上市的股票、存托凭证)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、衍生品(包括股指期货、股票期权、国债期货)、资产支持证券、货币市场工具、同业存单、债券回购、银行存款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。本基金可根据法律法规的规定参与融资、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。本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的80%,投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产不低于非现金基金资产的80%,因法律法规规定而受限的情形除外。股指期货、国债期货、股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。如法律法规或中国证监会变更上述投资品种的比例限制,以变更后的比例为准,基金管理人在依法履行适当程序后,可对本基金的投资比例做相应调整。本基金的业绩比较基准为:中证1000指数收益率。

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

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2023年03月15日(基金合同生效日)至2023年12月31日止期间财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2023年12月31日的财务状况以及2023年03月15日(基金合同生效日)至2023年12月31日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2023年03月15日(基金合同生效日)至2023年12月31日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为:以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的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。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

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

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

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

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

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

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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

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

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

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。当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到1%以上时,可进行收益分配。本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

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

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

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

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

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

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

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

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

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日
活期存款	2,050,219.39
等于：本金	2,049,287.02
加：应计利息	932.37
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	2,050,219.39

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	45,630,898.95	-	44,983,105.04	-647,793.91
贵金属投资-金交	-	-	-	-

所黄金合约					
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		45,630,898.95	-	44,983,105.04	-647,793.91

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款估值增值。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	2,337,680.00	-	-	-
--股指期货	2,337,680.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	2,337,680.00	-	-	-

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IM2403	IM2403	2.00	2,338,640.00	960.00
合计				960.00
减：可抵销 期货暂收 款				960.00

净额				-
----	--	--	--	---

注：1、买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

2、衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为0。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	56,811.46
其中：交易所市场	56,811.46
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	64,958.90
合计	121,770.36

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2023年03月15日（基金合同生效日）至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	281,440,067.00	281,440,067.00
本期申购	114,000,000.00	114,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-342,000,000.00	-342,000,000.00
本期末	53,440,067.00	53,440,067.00

注：本基金合同于2023年03月15日生效,基金合同生效日的基金份额总额为281,440,067.00份基金份额，其中认购资金利息折合15,188.00份基金份额。

7.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期期初（基金合同生效日）	-	-	-
本期利润	-1,755,515.78	-646,833.91	-2,402,349.69
本期基金份额交易产生的变动数	-935,949.06	-2,470,737.99	-3,406,687.05
其中：基金申购款	2,499,868.92	-6,139,125.17	-3,639,256.25
基金赎回款	-3,435,817.98	3,668,387.18	232,569.20
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,691,464.84	-3,117,571.90	-5,809,036.74

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年03月15日（基金合同生效日）至2023年12月31日
活期存款利息收入	204,898.73
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	9,104.24
其他	5,393.80
合计	219,396.77

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年03月15日（基金合同生效日）至2023年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-4,361,994.74
股票投资收益——赎回差价收入	1,729,391.75
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-2,632,602.99

7.4.7.10.2 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15日（基金合同生效日）至2023年12月31日
卖出股票成交总额	418,720,386.85
减：卖出股票成本总额	422,244,904.71
减：交易费用	837,476.88
买卖股票差价收入	-4,361,994.74

7.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年03月15日（基金合同生效日）至2023年12月31日
赎回基金份额对价总额	341,767,430.80

减：现金支付赎回款总额	159,484,474.80
减：赎回股票成本总额	180,553,564.25
减：交易费用	-
赎回差价收入	1,729,391.75

7.4.7.11 债券投资收益

本基金本报告期未取得债券投资收益。

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期未取得资产支持证券投资收益。

7.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期未取得贵金属投资收益。

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期未取得买卖权证差价收入。

7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年03月15日（基金合同生效日）至2023年12月31日
期货投资	-219,043.86

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年03月15日（基金合同生效日）至2023年12月31日
股票投资产生的股利收益	637,067.04
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-

合计	637,067.04
----	------------

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023年03月15日（基金合同生效日）至2023年12月31日
1.交易性金融资产	-647,793.91
——股票投资	-647,793.91
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	960.00
——权证投资	-
——期货投资	960.00
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	-646,833.91

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年03月15日（基金合同生效日）至2023年12月31日
基金赎回费收入	-
基金转换费收入	-
ETF基金替代损益	763,741.38
合计	763,741.38

7.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内未发生信用减值损失。

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年03月15日（基金合同生效日）至2023年12月31日
审计费用	50,000.00
信息披露费	-
证券出借违约金	-
IOPV计算发布费	14,958.90
ETF登记结算费	125,000.00
开户费	400.00
合计	190,358.90

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
天弘基金管理有限公司	基金管理人
光大证券股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
蚂蚁科技集团股份有限公司	基金管理人的股东
天津信托有限责任公司	基金管理人的股东
内蒙古君正能源化工集团股份有限公司	基金管理人的股东
芜湖高新投资有限公司	基金管理人的股东
新疆天瑞博丰股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
新疆天惠新盟股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东

新疆天阜恒基股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
新疆天聚宸兴股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
天弘创新资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年03月15日（基金合同生效日）至2023年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
光大证券股份有限公司	792,814,593.43	79.34%

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年03月15日（基金合同生效日）至2023年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
光大证券股份有限公司	344,409.74	87.74%	51,559.65	90.76%

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年03月15日（基金合同生效日）至2023年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	278,096.01
其中：应支付销售机构的客户维护费	32,266.54
应支付基金管理人的净管理费	245,829.47

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0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×该日适用费率/当年天数。

2、客户维护费是指基金管理人与基金销售机构在基金销售协议中约定的依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年03月15日（基金合同生效日）至2023年12月 31日
当期发生的基金应支付的托管费	55,619.21

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

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行过银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

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

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

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年03月15日（基金合同生效日）至2023年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
光大证券股份有限公司	2,050,219.39	204,898.73

注：本基金由基金托管人光大证券股份有限公司保管的银行存款，存放在具有基金托管资格的银行，按银行同业利率或约定利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期未在承销期内参与关联方承销证券交易。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况--固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期无利润分配事项。

7.4.12 期末（2023年12月31日）本基金持有的流通受限证券**7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券**

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688337	普源精电	2023-12-25	重大事项	43.87	2024-01-09	41.72	9,900	470,727.73	434,313.00	-

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

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券**7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购**

截至本报告期末2023年12月31日，本基金未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2023年12月31日，本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理**7.4.13.1 风险管理政策和组织架构**

本基金是被动式投资的股票型指数基金，紧密跟踪标的指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似，本基金预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。本基金采用完全复制法，跟踪标的指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但因特殊情况(比如流动性不足等)导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可使用其他合理方法进行适当的替代，力求与标的指数的跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。本基金的基金管理人奉行全面风险管理理念，建立了以风险委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、内控合规部、风险管理部、内审部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。在全面风险管理体系的框架下，董事会负责监督检查公司的合法合规运营、内部控制、风险管理，从而控制公司的整体运营风险。在董事会下设立风险委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理委员会，主要负责拟定公司风险管理战略，经董事会批准后组织实施；组织实施经董事会批准的年度风险预算、风险可容忍度限额及其他量化风险管理工具；根据公司总体风险控制目标，制定各业务和各环节风险控制目标和要求；落实公司就重大风险管理作出的决定或决议；听取并讨论会议议题，就重大风险事项形成决议；拟定或批准公司风险管理制度、流程。在业务操作层面风险管理职责主要由内控合规部和风险管理部负责，内控合规部负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理提供合规控制标准，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标；内控合规部对公司总经理负责，并由督察长分管。风险管理部通过投资交易系统的风控参数设置，保证各投资组合的投资比例合规；参与各投资组合新股申购、一级债申购、银行间交易等场外交易的风险识别与评估，保证各投资组合场外交易的事中合规控制；负责各投资组合投资绩效、大类风险的识别、计量和控制。风险管理部向公司首席风控官进行汇报。内审部对公司内部控制和风险管理的有效性，经营效率和效果等方面开展独立评价活动，向总经理和督察长汇报。本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款和定期存款存放在本基金的托管人光大证券股份有限公司开立于具有基金托管资格的银行的托管账户及其他具有基金托管资格的国有银行和大型股份制银行，并实施不同区间的额度管理，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，本基金以非约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司出借证券，本基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近1年的分类结果为A类，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

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

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末未持有短期信用评级的债券。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末未持有短期信用评级的资产支持证券。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末未持有短期信用评级的同业存单。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末未持有长期信用评级的债券。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末未持有长期信用评级的资产支持证券。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末未持有长期信用评级的同业存单。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险来自调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

于2023年12月31日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短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。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。本期末，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合法律法规的相关要求。

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

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的管理人定期对组合中债券投资和资产支持证券投资部分面临的利率风险进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	2,050,219.39	-	-	-	2,050,219.39
结算备付金	407,902.84	-	-	-	407,902.84
存出保证金	139,883.63	-	-	350,796.00	490,679.63
交易性金融资产	-	-	-	44,983,105.04	44,983,105.04
应收清算款	-	-	-	174,872.02	174,872.02
资产总计	2,598,005.86	-	-	45,508,773.06	48,106,778.92
负债					
应付清算款	-	-	-	330,854.23	330,854.23
应付管理人报酬	-	-	-	19,270.05	19,270.05
应付托管费	-	-	-	3,854.02	3,854.02
其他负债	-	-	-	121,770.36	121,770.36
负债总计	-	-	-	475,748.66	475,748.66
利率敏感度缺口	2,598,005.86	-	-	45,033,024.40	47,631,030.26

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金采用指数增强型投资策略，以中证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。本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的80%，投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产不低于非现金基金资产的80%，因法律法规规定而受限的情形除外。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	44,983,105.04	94.44
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	44,983,105.04	94.44

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资(附注7.4.7.3)。在当日无负债结算制度下，期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为0。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末 2023年12月31日
	业绩比较基准上升5%	2,350,721.67
	业绩比较基准下降5%	-2,350,721.67

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年12月31日
第一层次	44,548,792.04
第二层次	434,313.00
第三层次	-
合计	44,983,105.04

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估

值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2023年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	44,983,105.04	93.51
	其中：股票	44,983,105.04	93.51
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	2,458,122.23	5.11
8	其他各项资产	665,551.65	1.38
9	合计	48,106,778.92	100.00

注：上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而下一节按行业分类股票投资组合的合计项不含可退替代款估值增值。

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	228,567.00	0.48
B	采矿业	1,197,493.00	2.51
C	制造业	29,488,726.04	61.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	648,759.00	1.36
E	建筑业	1,140,624.00	2.39
F	批发和零售业	1,206,114.00	2.53
G	交通运输、仓储和邮政业	1,435,537.00	3.01
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,498,908.00	11.54
J	金融业	820,400.00	1.72
K	房地产业	473,359.00	0.99
L	租赁和商务服务业	294,682.00	0.62
M	科学研究和技术服务业	346,899.00	0.73
N	水利、环境和公共设施管理业	766,449.00	1.61
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	458,139.00	0.96
R	文化、体育和娱乐业	811,298.00	1.70
S	综合	-	-
	合计	44,815,954.04	94.09

8.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	162,756.00	0.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	162,756.00	0.34

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细**8.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细**

金额单位：人民币元

序	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	301363	美好医疗	15,500	570,400.00	1.20
2	002163	海南发展	57,300	520,284.00	1.09
3	002635	安洁科技	31,200	509,496.00	1.07
4	601137	博威合金	32,700	507,831.00	1.07
5	688707	振华新材	24,700	506,350.00	1.06
6	603530	神马电力	24,300	503,982.00	1.06
7	688209	英集芯	28,000	500,080.00	1.05
8	603010	万盛股份	45,700	493,103.00	1.04
9	002130	沃尔核材	64,800	489,240.00	1.03
10	001696	宗申动力	73,000	483,990.00	1.02
11	300409	道氏技术	43,200	481,248.00	1.01
12	002274	华昌化工	63,400	478,670.00	1.00
13	000990	诚志股份	57,900	475,359.00	1.00
14	688128	中国电研	23,100	474,012.00	1.00
15	603328	依顿电子	57,900	471,885.00	0.99
16	300002	神州泰岳	53,200	470,820.00	0.99
17	600662	外服控股	96,100	461,280.00	0.97
18	600125	铁龙物流	75,900	459,195.00	0.96
19	688526	科前生物	22,200	452,436.00	0.95
20	600210	紫江企业	95,600	449,320.00	0.94
21	002516	旷达科技	88,300	435,319.00	0.91
22	688337	普源精电	9,900	434,313.00	0.91
23	688083	中望软件	4,300	428,022.00	0.90
24	300232	洲明科技	48,400	425,920.00	0.89
25	688018	乐鑫科技	4,100	422,095.00	0.89
26	300451	创业慧康	63,900	418,545.00	0.88
27	300639	凯普生物	44,800	418,432.00	0.88
28	002651	利君股份	60,000	415,200.00	0.87
29	688356	键凯科技	3,900	414,960.00	0.87

30	688660	电气风电	80,700	414,798.00	0.87
31	688578	艾力斯	9,900	412,434.00	0.87
32	688161	威高骨科	9,900	410,355.00	0.86
33	000035	中国天楹	82,900	409,526.00	0.86
34	688568	中科星图	8,300	407,198.00	0.85
35	605222	起帆电缆	20,700	399,096.00	0.84
36	300768	迪普科技	27,000	399,060.00	0.84
37	002283	天润工业	68,100	398,385.00	0.84
38	002950	奥美医疗	42,000	398,160.00	0.84
39	688617	惠泰医疗	1,000	388,500.00	0.82
40	300323	华灿光电	52,800	386,496.00	0.81
41	603132	金徽股份	28,200	385,776.00	0.81
42	601969	海南矿业	58,500	385,515.00	0.81
43	002085	万丰奥威	77,800	384,332.00	0.81
44	002978	安宁股份	11,800	373,588.00	0.78
45	688017	绿的谐波	2,400	368,400.00	0.77
46	002378	章源钨业	64,800	366,768.00	0.77
47	688339	亿华通	8,000	365,920.00	0.77
48	600810	神马股份	48,300	359,352.00	0.75
49	601311	骆驼股份	44,800	358,848.00	0.75
50	000848	承德露露	45,700	358,745.00	0.75
51	688776	国光电气	3,600	350,604.00	0.74
52	601811	新华文轩	24,800	338,768.00	0.71
53	000062	深圳华强	29,700	334,719.00	0.70
54	688739	成大生物	10,200	331,602.00	0.70
55	300123	亚光科技	44,900	329,117.00	0.69
56	600073	上海梅林	48,200	328,242.00	0.69
57	002206	海利得	65,000	326,300.00	0.69
58	002990	盛视科技	9,400	324,582.00	0.68
59	002724	海洋王	38,700	318,114.00	0.67
60	301301	川宁生物	37,700	316,680.00	0.66

61	002063	远光软件	50,400	311,472.00	0.65
62	688173	希荻微	17,700	311,343.00	0.65
63	002171	楚江新材	40,800	305,184.00	0.64
64	688270	臻镭科技	4,400	300,872.00	0.63
65	600986	浙文互联	55,000	300,300.00	0.63
66	688789	宏华数科	3,000	299,730.00	0.63
67	002677	浙江美大	29,200	295,212.00	0.62
68	000829	天音控股	30,900	294,786.00	0.62
69	002991	甘源食品	4,100	292,986.00	0.62
70	603236	移远通信	5,400	290,250.00	0.61
71	002100	天康生物	33,000	289,410.00	0.61
72	688106	金宏气体	12,000	289,080.00	0.61
73	601099	太平洋	78,100	288,970.00	0.61
74	002402	和而泰	20,000	285,800.00	0.60
75	300143	盈康生命	25,300	268,939.00	0.56
76	000090	天健集团	57,600	264,960.00	0.56
77	000059	华锦股份	47,200	259,128.00	0.54
78	600037	歌华有线	32,900	254,317.00	0.53
79	000969	安泰科技	27,200	244,528.00	0.51
80	300303	聚飞光电	41,100	243,723.00	0.51
81	688439	振华风光	2,700	240,597.00	0.51
82	000791	甘肃能源	42,700	237,839.00	0.50
83	600248	陕建股份	58,000	233,160.00	0.49
84	000685	中山公用	31,700	231,727.00	0.49
85	600510	黑牡丹	40,500	228,825.00	0.48
86	603477	巨星农牧	6,100	228,567.00	0.48
87	301090	华润材料	20,900	226,974.00	0.48
88	000737	北方铜业	38,700	224,460.00	0.47
89	002573	清新环境	44,500	220,275.00	0.46
90	600217	中再资环	50,000	219,000.00	0.46
91	000019	深粮控股	28,900	217,906.00	0.46

92	600012	皖通高速	19,700	217,094.00	0.46
93	300741	华宝股份	10,100	216,241.00	0.45
94	600797	浙大网新	32,900	215,824.00	0.45
95	688016	心脉医疗	1,100	214,093.00	0.45
96	600552	凯盛科技	15,400	205,282.00	0.43
97	300527	中船应急	26,800	204,216.00	0.43
98	603212	赛伍技术	11,700	203,229.00	0.43
99	601369	陕鼓动力	25,200	201,096.00	0.42
100	600643	爱建集团	37,700	192,270.00	0.40
101	600216	浙江医药	17,800	190,994.00	0.40
102	002003	伟星股份	17,600	190,960.00	0.40
103	600657	信达地产	53,000	190,270.00	0.40
104	002139	拓邦股份	19,400	189,344.00	0.40
105	002023	海特高新	20,800	189,280.00	0.40
106	301239	普瑞眼科	2,200	189,200.00	0.40
107	600812	华北制药	32,800	186,960.00	0.39
108	000901	航天科技	20,000	186,400.00	0.39
109	688559	海目星	5,200	185,640.00	0.39
110	002583	海能达	31,100	185,045.00	0.39
111	300685	艾德生物	8,400	184,632.00	0.39
112	300170	汉得信息	22,100	183,651.00	0.39
113	301080	百普赛斯	3,100	182,714.00	0.38
114	603466	风语筑	12,300	176,874.00	0.37
115	002467	二六三	37,700	174,928.00	0.37
116	603093	南华期货	14,300	171,600.00	0.36
117	000686	东北证券	23,600	167,560.00	0.35
118	600478	科力远	33,500	164,820.00	0.35
119	300206	理邦仪器	15,800	161,318.00	0.34
120	002649	博彦科技	13,000	159,510.00	0.33
121	300623	捷捷微电	10,000	158,700.00	0.33
122	300662	科锐国际	5,600	154,672.00	0.32

123	002987	京北方	8,200	152,356.00	0.32
124	002258	利尔化学	12,400	148,428.00	0.31
125	601019	山东出版	15,800	148,204.00	0.31
126	688066	航天宏图	3,500	147,840.00	0.31
127	601921	浙版传媒	19,300	147,452.00	0.31
128	603920	世运电路	7,600	138,928.00	0.29
129	600562	国睿科技	9,900	137,016.00	0.29
130	601200	上海环境	15,200	136,648.00	0.29
131	002212	天融信	13,900	135,942.00	0.29
132	000951	中国重汽	10,100	134,936.00	0.28
133	600206	有研新材	10,700	132,573.00	0.28
134	002215	诺普信	15,900	131,334.00	0.28
135	688127	蓝特光学	5,600	130,424.00	0.27
136	600787	中储股份	25,200	128,520.00	0.27
137	603871	嘉友国际	8,000	126,880.00	0.27
138	002768	国恩股份	5,800	124,236.00	0.26
139	600284	浦东建设	19,400	122,220.00	0.26
140	300263	隆华科技	16,700	117,568.00	0.25
141	600458	时代新材	12,700	116,967.00	0.25
142	300271	华宇软件	14,200	116,298.00	0.24
143	601126	四方股份	8,200	116,112.00	0.24
144	002390	信邦制药	25,100	111,444.00	0.23
145	002214	大立科技	9,500	108,965.00	0.23
146	600821	金开新能	17,400	106,488.00	0.22
147	688033	天宜上佳	6,300	106,470.00	0.22
148	300702	天宇股份	4,900	106,379.00	0.22
149	688046	药康生物	5,200	104,780.00	0.22
150	002851	麦格米特	4,200	103,320.00	0.22
151	603108	润达医疗	5,000	101,750.00	0.21
152	600710	苏美达	14,300	101,387.00	0.21
153	300068	南都电源	7,800	100,932.00	0.21

154	688639	华恒生物	800	100,720.00	0.21
155	300183	东软载波	6,300	95,067.00	0.20
156	603300	华铁应急	14,800	94,720.00	0.20
157	603877	太平鸟	5,400	92,232.00	0.19
158	300638	广和通	4,800	91,344.00	0.19
159	600997	开滦股份	11,700	89,271.00	0.19
160	603766	隆鑫通用	17,000	87,720.00	0.18
161	603113	金能科技	10,300	83,121.00	0.17
162	600420	国药现代	8,300	81,257.00	0.17
163	301015	百洋医药	2,200	78,892.00	0.17
164	301177	迪阿股份	2,600	76,674.00	0.16
165	002446	盛路通信	9,200	76,360.00	0.16
166	002646	天佑德酒	5,500	74,855.00	0.16
167	002243	力合科创	9,400	74,730.00	0.16
168	600874	创业环保	13,100	72,705.00	0.15
169	002567	唐人神	9,400	70,500.00	0.15
170	600556	天下秀	11,800	69,738.00	0.15
171	300284	苏交科	10,900	59,405.00	0.12
172	300627	华测导航	1,900	58,938.00	0.12
173	301217	铜冠铜箔	4,900	58,114.00	0.12
174	600007	中国国贸	2,800	54,264.00	0.11
175	300109	新开源	2,976	53,687.04	0.11
176	300382	斯莱克	5,300	52,629.00	0.11
177	000968	蓝焰控股	7,400	52,614.00	0.11
178	002815	崇达技术	5,000	47,900.00	0.10
179	000061	农产品	7,000	45,290.00	0.10
180	603713	密尔克卫	800	42,568.00	0.09
181	688322	奥比中光	1,100	41,338.00	0.09

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300502	新易盛	3,300	162,756.00	0.34

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	688018	乐鑫科技	4,640,861.34	9.74
2	002405	四维图新	4,581,892.43	9.62
3	601126	四方股份	4,559,186.00	9.57
4	600583	海油工程	4,394,626.00	9.23
5	603118	共进股份	4,302,759.95	9.03
6	603328	依顿电子	4,288,450.00	9.00
7	601567	三星医疗	4,256,446.00	8.94
8	603129	春风动力	4,240,630.00	8.90
9	688066	航天宏图	4,167,497.82	8.75
10	600098	广州发展	4,136,887.00	8.69
11	300803	指南针	4,091,672.00	8.59
12	300777	中简科技	4,072,356.00	8.55
13	601975	招商南油	4,061,934.00	8.53
14	300770	新媒股份	4,059,621.00	8.52
15	002517	恺英网络	4,045,396.53	8.49
16	300130	新国都	4,027,153.00	8.45
17	688499	利元亨	4,016,631.05	8.43
18	600502	安徽建工	4,011,042.00	8.42
19	688733	壹石通	4,004,802.86	8.41
20	600929	雪天盐业	3,896,427.02	8.18

21	605111	新洁能	3,838,429.00	8.06
22	603299	苏盐井神	3,830,783.56	8.04
23	603027	千禾味业	3,793,156.40	7.96
24	300377	赢时胜	3,774,764.16	7.93
25	600710	苏美达	3,770,495.89	7.92
26	603609	禾丰股份	3,720,019.50	7.81
27	002085	万丰奥威	3,673,589.00	7.71
28	002130	沃尔核材	3,646,849.00	7.66
29	300298	三诺生物	3,622,366.00	7.61
30	300567	精测电子	3,569,148.00	7.49
31	603103	横店影视	3,518,946.00	7.39
32	002258	利尔化学	3,495,648.00	7.34
33	002782	可立克	3,475,655.00	7.30
34	600750	江中药业	3,451,554.00	7.25
35	603960	克来机电	3,427,126.79	7.20
36	002216	三全食品	3,420,056.90	7.18
37	688333	铂力特	3,409,236.06	7.16
38	600158	中体产业	3,395,444.00	7.13
39	002017	东信和平	3,389,582.00	7.12
40	601890	亚星锚链	3,371,601.00	7.08
41	600284	浦东建设	3,368,769.00	7.07
42	000758	中色股份	3,365,495.00	7.07
43	000915	华特达因	3,360,188.17	7.05
44	002597	金禾实业	3,341,472.00	7.02
45	300737	科顺股份	3,315,543.00	6.96
46	300224	正海磁材	3,314,753.00	6.96
47	002262	恩华药业	3,311,104.00	6.95
48	000555	神州信息	3,307,142.00	6.94
49	603208	江山欧派	3,276,561.86	6.88
50	301031	中熔电气	3,275,221.00	6.88
51	688083	中望软件	3,268,226.04	6.86

52	600557	康缘药业	3,238,353.00	6.80
53	300607	拓斯达	3,221,147.00	6.76
54	000672	上峰水泥	3,210,183.40	6.74
55	300696	爱乐达	3,182,932.00	6.68
56	603068	博通集成	3,166,434.00	6.65
57	600748	上实发展	3,130,331.00	6.57
58	300765	新诺威	3,121,761.92	6.55
59	300219	鸿利智汇	3,120,812.32	6.55
60	301069	凯盛新材	3,110,998.00	6.53
61	601908	京运通	3,063,704.00	6.43
62	600971	恒源煤电	3,057,673.00	6.42
63	002204	大连重工	3,047,998.00	6.40
64	300856	科思股份	3,007,674.00	6.31
65	000048	京基智农	2,932,653.00	6.16
66	603279	景津装备	2,891,384.00	6.07
67	605507	国邦医药	2,868,880.00	6.02
68	002635	安洁科技	2,829,711.00	5.94
69	300143	盈康生命	2,809,017.00	5.90
70	300638	广和通	2,804,100.00	5.89
71	688148	芳源股份	2,744,733.66	5.76
72	600933	爱柯迪	2,736,353.64	5.74
73	002421	达实智能	2,631,490.00	5.52
74	600963	岳阳林纸	2,622,532.00	5.51
75	002807	江阴银行	2,606,577.00	5.47
76	688575	亚辉龙	2,603,279.40	5.47
77	600266	城建发展	2,578,405.00	5.41
78	603920	世运电路	2,569,203.00	5.39
79	002959	小熊电器	2,560,138.00	5.37
80	002906	华阳集团	2,514,116.00	5.28
81	300761	立华股份	2,502,246.91	5.25
82	600675	中华企业	2,490,355.00	5.23

83	300457	赢合科技	2,477,097.00	5.20
84	600995	南网储能	2,407,965.00	5.06
85	600428	中远海特	2,329,555.00	4.89
86	688559	海目星	2,313,983.69	4.86
87	002237	恒邦股份	2,294,228.00	4.82
88	300401	花园生物	2,169,647.00	4.56
89	601929	吉视传媒	2,168,617.00	4.55
90	300775	三角防务	2,146,529.00	4.51
91	600320	振华重工	2,105,040.00	4.42
92	688198	佰仁医疗	2,102,984.79	4.42
93	300525	博思软件	2,093,957.00	4.40
94	300455	航天智装	2,089,646.00	4.39
95	000860	顺鑫农业	2,086,732.00	4.38
96	000928	中钢国际	2,073,877.00	4.35
97	688388	嘉元科技	2,060,397.77	4.33
98	000795	英洛华	2,047,772.98	4.30
99	603728	鸣志电器	1,989,074.72	4.18
100	688408	中信博	1,966,394.29	4.13
101	300118	东方日升	1,952,583.00	4.10
102	002768	国恩股份	1,909,122.00	4.01
103	002318	久立特材	1,849,251.98	3.88
104	600685	中船防务	1,744,960.00	3.66
105	002003	伟星股份	1,718,523.30	3.61
106	603236	移远通信	1,694,727.00	3.56
107	605589	圣泉集团	1,672,357.00	3.51
108	600662	外服控股	1,595,164.00	3.35
109	688017	绿的谐波	1,585,054.33	3.33
110	002126	银轮股份	1,566,141.00	3.29
111	002930	宏川智慧	1,561,669.00	3.28
112	688798	艾为电子	1,542,116.46	3.24
113	301236	软通动力	1,524,671.00	3.20

114	688167	炬光科技	1,518,984.59	3.19
115	000423	东阿阿胶	1,433,606.00	3.01
116	603108	润达医疗	1,418,413.00	2.98
117	603601	再升科技	1,389,531.00	2.92
118	600129	太极集团	1,378,990.00	2.90
119	000682	东方电子	1,372,788.00	2.88
120	600206	有研新材	1,363,957.00	2.86
121	600789	鲁抗医药	1,353,109.00	2.84
122	002558	巨人网络	1,352,132.00	2.84
123	600151	航天机电	1,352,048.76	2.84
124	002484	江海股份	1,348,746.00	2.83
125	300393	中来股份	1,341,639.00	2.82
126	000550	江铃汽车	1,305,144.00	2.74
127	600305	恒顺醋业	1,302,903.00	2.74
128	300315	掌趣科技	1,283,076.00	2.69
129	688617	惠泰医疗	1,251,381.75	2.63
130	600285	羚锐制药	1,249,550.00	2.62
131	688106	金宏气体	1,248,726.41	2.62
132	601137	博威合金	1,247,338.00	2.62
133	603690	至纯科技	1,247,160.00	2.62
134	600483	福能股份	1,246,958.00	2.62
135	603008	喜临门	1,243,216.00	2.61
136	601882	海天精工	1,234,900.00	2.59
137	300170	汉得信息	1,213,708.00	2.55
138	688800	瑞可达	1,203,607.83	2.53
139	600210	紫江企业	1,160,226.00	2.44
140	300036	超图软件	1,143,835.00	2.40
141	300439	美康生物	1,138,332.00	2.39
142	300451	创业慧康	1,137,260.00	2.39
143	603959	百利科技	1,119,664.36	2.35
144	600211	西藏药业	1,111,860.00	2.33

145	688268	华特气体	1,110,086.08	2.33
146	688128	中国电研	1,100,695.69	2.31
147	300206	理邦仪器	1,055,037.00	2.22
148	300627	华测导航	1,050,717.60	2.21
149	688389	普门科技	1,042,830.11	2.19
150	002320	海峡股份	1,024,608.00	2.15
151	002726	龙大美食	1,017,752.00	2.14
152	300573	兴齐眼药	1,012,012.00	2.12
153	002463	沪电股份	1,006,654.30	2.11
154	600548	深高速	997,114.00	2.09
155	603071	物产环能	993,487.00	2.09
156	688578	艾力斯	988,761.28	2.08
157	601369	陕鼓动力	988,008.00	2.07
158	002832	比音勒芬	985,329.00	2.07
159	300109	新开源	973,252.92	2.04
160	601921	浙版传媒	970,172.00	2.04
161	300768	迪普科技	959,714.00	2.01
162	002518	科士达	958,290.00	2.01
163	603132	金徽股份	956,482.00	2.01

注：本项的“买入金额”均按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例(%)
1	600583	海油工程	4,686,037.00	9.84
2	601126	四方股份	4,550,942.00	9.55
3	603129	春风动力	4,379,531.14	9.19
4	601567	三星医疗	4,295,958.00	9.02

5	603118	共进股份	4,282,008.00	8.99
6	688018	乐鑫科技	4,245,203.77	8.91
7	600098	广州发展	4,186,150.00	8.79
8	600502	安徽建工	4,183,417.00	8.78
9	603328	依顿电子	3,903,602.00	8.20
10	688066	航天宏图	3,901,022.32	8.19
11	600929	雪天盐业	3,870,161.00	8.13
12	603299	苏盐井神	3,869,392.00	8.12
13	601975	招商南油	3,821,266.08	8.02
14	688733	壹石通	3,819,545.98	8.02
15	600750	江中药业	3,818,267.50	8.02
16	688499	利元亨	3,781,205.51	7.94
17	605111	新洁能	3,769,795.20	7.91
18	600710	苏美达	3,763,064.00	7.90
19	603027	千禾味业	3,731,387.68	7.83
20	603609	禾丰股份	3,683,349.35	7.73
21	603103	横店影视	3,673,703.00	7.71
22	600557	康缘药业	3,602,275.26	7.56
23	600158	中体产业	3,471,181.00	7.29
24	688333	铂力特	3,464,535.37	7.27
25	601890	亚星锚链	3,376,890.66	7.09
26	600748	上实发展	3,272,000.00	6.87
27	603208	江山欧派	3,250,913.90	6.83
28	603960	克来机电	3,246,894.00	6.82
29	603068	博通集成	3,214,929.00	6.75
30	600284	浦东建设	3,143,082.00	6.60
31	600971	恒源煤电	3,031,355.00	6.36
32	601908	京运通	2,996,563.00	6.29
33	300607	拓斯达	2,995,342.00	6.29
34	000048	京基智农	2,988,705.00	6.27
35	600933	爱柯迪	2,839,206.70	5.96

36	605507	国邦医药	2,836,353.00	5.95
37	600266	城建发展	2,836,164.00	5.95
38	603279	景津装备	2,834,399.00	5.95
39	688083	中望软件	2,780,621.44	5.84
40	300638	广和通	2,694,024.20	5.66
41	300761	立华股份	2,671,887.00	5.61
42	688575	亚辉龙	2,618,457.77	5.50
43	600963	岳阳林纸	2,593,086.70	5.44
44	688148	芳源股份	2,592,324.09	5.44
45	603920	世运电路	2,473,316.00	5.19
46	600675	中华企业	2,373,613.00	4.98
47	600995	南网储能	2,343,557.00	4.92
48	600428	中远海特	2,225,870.00	4.67
49	600320	振华重工	2,130,705.00	4.47
50	688559	海目星	2,122,594.02	4.46
51	601929	吉视传媒	2,106,790.00	4.42
52	300401	花园生物	2,095,583.00	4.40
53	300455	航天智装	2,033,158.00	4.27
54	688198	佰仁医疗	2,011,951.47	4.22
55	688388	嘉元科技	1,965,716.25	4.13
56	300130	新国都	1,908,085.00	4.01
57	603728	鸣志电器	1,891,210.00	3.97
58	300457	赢合科技	1,888,843.50	3.97
59	688408	中信博	1,842,892.91	3.87
60	300770	新媒股份	1,718,797.00	3.61
61	300525	博思软件	1,718,250.00	3.61
62	605589	圣泉集团	1,704,961.00	3.58
63	600685	中船防务	1,696,078.00	3.56
64	300567	精测电子	1,643,058.00	3.45
65	000423	东阿阿胶	1,560,399.00	3.28
66	600789	鲁抗医药	1,539,592.00	3.23

67	600129	太极集团	1,530,868.00	3.21
68	688167	炬光科技	1,515,469.32	3.18
69	603108	润达医疗	1,505,109.00	3.16
70	688798	艾为电子	1,434,713.31	3.01
71	301236	软通动力	1,421,767.50	2.98
72	002558	巨人网络	1,400,913.00	2.94
73	603601	再升科技	1,394,260.00	2.93
74	300856	科思股份	1,339,813.50	2.81
75	600151	航天机电	1,319,136.00	2.77
76	002807	江阴银行	1,318,367.00	2.77
77	002517	恺英网络	1,304,149.00	2.74
78	688800	瑞可达	1,272,546.74	2.67
79	600305	恒顺醋业	1,272,132.00	2.67
80	600285	羚锐制药	1,260,718.00	2.65
81	300118	东方日升	1,257,915.00	2.64
82	603690	至纯科技	1,247,603.20	2.62
83	601882	海天精工	1,227,064.00	2.58
84	600206	有研新材	1,224,829.00	2.57
85	603236	移远通信	1,219,258.80	2.56
86	600483	福能股份	1,209,820.70	2.54
87	688017	绿的谐波	1,174,271.57	2.47
88	603008	喜临门	1,167,998.00	2.45
89	600211	西藏药业	1,126,918.00	2.37
90	300036	超图软件	1,093,533.00	2.30
91	603959	百利科技	1,086,110.00	2.28
92	600662	外服控股	1,050,516.00	2.21
93	688268	华特气体	1,047,849.27	2.20
94	002518	科士达	1,027,579.00	2.16
95	300439	美康生物	1,014,410.00	2.13
96	300803	指南针	1,009,284.00	2.12
97	002484	江海股份	1,004,108.00	2.11

98	002463	沪电股份	999,388.00	2.10
99	300377	赢时胜	997,262.44	2.09
100	601137	博威合金	989,984.00	2.08
101	603179	新泉股份	976,857.00	2.05
102	002832	比音勒芬	973,030.00	2.04
103	300315	掌趣科技	969,680.00	2.04
104	600548	深高速	968,888.00	2.03
105	688389	普门科技	962,881.54	2.02
106	688617	惠泰医疗	960,835.31	2.02
107	300777	中简科技	960,119.00	2.02

注：本项的“卖出金额”均按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	580,582,527.81
卖出股票收入（成交）总额	418,720,386.85

注：本项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金使用股指期货进行仓位管理。即当有较大资金申购时，会利用股指期货进行买入套期保值，快速提高产品权益仓位，提高资金利用效率，避免由于仓位骤降导致产品净值大幅偏离基准涨跌。反之亦然。

此外，本基金仅使用中证1000股指期货，并在计算股指期货年化升/贴水的基础上，优选对产品净值最有利的股指期货合约进行投资。本基金不进行投机，对冲等操作。

在申赎相对较少时，本基金可能不使用股指期货。

管理人将持续关注股指期货升贴水、流动性以及合约期限等因素，根据产品实际情况进行投资决策。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

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

8.12.2 基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	490,679.63
2	应收清算款	174,872.02
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	665,551.65

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

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。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票不存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
411	130,024.49	34,161,307.00	63.92%	19,278,760.00	36.08%

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	中信建投证券股份有限公司	11,700,979.00	21.90%
2	招商证券股份有限公司	7,629,184.00	14.28%
3	海通证券股份有限公司	4,658,000.00	8.72%
4	中信证券股份有限公司	4,204,845.00	7.87%
5	方正证券股份有限公司	3,020,800.00	5.65%
6	华泰证券股份有限公司	2,427,716.00	4.54%
7	姚梅华	1,000,068.00	1.87%
7	胡恒	1,000,068.00	1.87%

7	李秀仪	1,000,068.00	1.87%
7	汤敏聪	1,000,068.00	1.87%
8	蔡亦天	658,900.00	1.23%
9	郭卫军	606,400.00	1.13%
10	广发证券股份有限公司	519,715.00	0.97%

注：持有人为场内持有人。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	10,000.00	0.02%

9.4 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	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和部门部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2023年03月15日)基金份额总额	281,440,067.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	114,000,000.00
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	342,000,000.00
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	53,440,067.00

注：本基金合同于2023年03月15日生效。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，童建林先生任职公司风控负责人，刘荣逵先生任职公司首席信息官，马文辉先生任职公司财务负责人，朱海扬先生不再担任公司副总经理，具体信息请参见基金管理人在规定媒介披露的《天弘基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。

本报告期内，韩歆毅先生代任公司总经理，郭树强先生不再担任公司总经理，具体信息请参见基金管理人在规定媒介披露的《天弘基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。

本报告期内，高阳先生担任公司总经理，韩歆毅先生不再代任公司总经理，具体信息请参见基金管理人在规定媒介披露的《天弘基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。

本报告期内，本基金的基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期内，未发生涉及基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略没有改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金应向普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）支付服务费50,000.00元。截至本报告期末，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）已为本基金提供审计服务10个月。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

11.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员未发生受稽查或处罚的情况。

11.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员未发生受稽查或处罚的情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单	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	佣金	占当期佣金总量的	

	元数量		额的比例		比例	
德邦证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	792,814,593.43	79.34%	344,409.74	87.74%	-
华泰证券	2	206,484,654.99	20.66%	48,138.97	12.26%	-

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等。

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：德邦证券北交所交易单元。

4、本基金报告期内停止租用交易单元：无。

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金产品资料概要	中国证监会规定媒介	2023-03-02
2	天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金份额发售公告	中国证监会规定媒介	2023-03-02
3	天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同	中国证监会规定媒介	2023-03-02
4	天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金托管协议	中国证监会规定媒介	2023-03-02

5	天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金招募说明书	中国证监会规定媒介	2023-03-02
6	天弘基金管理有限公司关于天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金提前结束募集的公告	中国证监会规定媒介	2023-03-08
7	天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会规定媒介	2023-03-16
8	天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金产品资料概要（更新）	中国证监会规定媒介	2023-03-17
9	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
10	天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金上市交易公告书	中国证监会规定媒介	2023-03-29
11	天弘基金管理有限公司关于天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购、赎回业务并调整最小申购赎回单位的公告	中国证监会规定媒介	2023-03-29
12	天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会规定媒介	2023-03-30
13	天弘基金管理有限公司关于增聘天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理的公告	中国证监会规定媒介	2023-03-31
14	天弘基金管理有限公司关于	中国证监会规定媒介	2023-04-01

	高级管理人员变更的公告		
15	天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要（更新）	中国证监会规定媒介	2023-04-03
16	天弘基金管理有限公司关于天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金上市交易提示性公告	中国证监会规定媒介	2023-04-03
17	天弘基金管理有限公司关于天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告	中国证监会规定媒介	2023-04-03
18	天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会规定媒介	2023-04-05
19	天弘基金管理有限公司关于天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金新增申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会规定媒介	2023-04-06
20	天弘基金管理有限公司关于天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金新增申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会规定媒介	2023-04-10
21	天弘基金管理有限公司关于天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告	中国证监会规定媒介	2023-07-03
22	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金新增申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会规定媒介	2023-07-03
23	天弘中证1000增强策略交易	中国证监会规定媒介	2023-07-05

	型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要（更新）		
24	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金新增申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会规定媒介	2023-07-12
25	天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金2023年第2季度报告	中国证监会规定媒介	2023-07-21
26	天弘基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定媒介	2023-07-24
27	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金新增申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会规定媒介	2023-07-31
28	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金新增申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会规定媒介	2023-08-11
29	天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金2023年中期报告	中国证监会规定媒介	2023-08-31
30	天弘基金管理有限公司关于终止凤凰金信（海口）基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会规定媒介	2023-09-01
31	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金新增申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会规定媒介	2023-09-04
32	天弘基金管理有限公司关于天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金新增申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会规定媒介	2023-10-16
33	天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金	中国证监会规定媒介	2023-10-21

	招募说明书（更新）		
34	天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金2023年第3季度报告	中国证监会规定媒介	2023-10-25
35	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金新增申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会规定媒介	2023-10-26
36	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金新增申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会规定媒介	2023-11-20
37	天弘基金管理有限公司关于增加海通证券股份有限公司为旗下部分基金流动性服务商的公告	中国证监会规定媒介	2023-11-23
38	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金新增申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会规定媒介	2023-12-06
39	关于天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金资产净值连续低于5000万元的提示性公告	中国证监会规定媒介	2023-12-20
40	天弘基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定媒介	2023-12-30

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况				报告期末持有基金情况		
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

		间					
机构	1	20230411- 20230411, 20230417- 20230417, 20230425- 20230504, 20230519- 20230522, 20230524- 20230530, 20230612- 20230612, 20230615- 20230618, 20230721- 20230725, 20230804- 20230810, 20230814- 20230815, 20230817- 20230827, 20230829- 20230829, 20230911- 20230911, 20230918- 20230919, 20230922- 20230924, 20230926- 20230927, 20231011- 20231011, 20231206- 20231206, 20231226- 20231226,	-	196,502,216. 00	184,801,237. 00	11,700,97 9.00	21.90%

		20231229- 20231231					
2		20230703- 20231119	-	46,542,572.0 0	38,913,388.0 0	7,629,184. 00	14.28%
产品特有风险							
<p>基金管理人秉承谨慎勤勉、独立决策、规范运作、充分披露原则，公平对待投资者，保障投资者合法权益。当单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%时，由此可能导致的特有风险主要包括：</p> <p>（1）超出基金管理人允许的单一投资者持有基金份额比例的申购申请不被确认的风险；</p> <p>（2）极端市场环境下投资者集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对赎回申请的风险；</p> <p>（3）持有基金份额占比较高的投资者大额赎回可能引发基金净值大幅波动的风险；</p> <p>（4）持有基金份额占比较高的投资者在召开基金份额持有人大会并对重大事项进行投票表决时，可能拥有较大话语权；</p> <p>（5）极端情况下，持有基金份额占比较高的投资者大量赎回后，可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平，面临转换基金运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等风险。</p>							

注：1、申购份额包括申购或者买入基金份额，赎回份额包括赎回或者卖出基金份额。

2、份额占比精度处理方式四舍五入。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

1、中国证监会批准天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金募集的文件

2、天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同

3、天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金托管协议

4、天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金招募说明书

5、报告期内在指定报刊上披露的各项公告

6、中国证监会规定的其他文件

13.2 存放地点

天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层

13.3 查阅方式

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

公司网站：www.thfund.com.cn

天弘基金管理有限公司
二〇二四年三月二十九日