

---

# 天弘沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

## 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:招商证券股份有限公司

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。

基金托管人招商证券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	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	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 净资产（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	20
§7 投资组合报告	59
7.1 期末基金资产组合情况	60
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	60
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	62
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	75
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	77
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	77
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	77
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	77
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	77
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	77
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	78
7.12 投资组合报告附注	78
§8 基金份额持有人信息	79
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	79
8.2 期末上市基金前十名持有人	80

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	80
8.4 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.....	81
§9 开放式基金份额变动.....	81
§10 重大事件揭示.....	81
10.1 基金份额持有人大会决议.....	81
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.....	81
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	81
10.4 基金投资策略的改变.....	82
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	82
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.....	82
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	82
10.8 其他重大事件.....	84
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	85
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.....	85
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	86
§12 备查文件目录.....	86
12.1 备查文件目录.....	86
12.2 存放地点.....	86
12.3 查阅方式.....	86

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	天弘沪深300ETF
场内简称	300ETF天弘
基金主代码	515330
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019年12月05日
基金管理人	天弘基金管理有限公司
基金托管人	招商证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	6,671,709,496.00份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2019年12月26日

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金力争将日均跟踪偏离度控制在0.2%以内，年化跟踪误差控制在2%以内。
投资策略	本基金主要采取完全复制策略，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况（如流动性不足、成份股长期停牌、法律法规限制等）导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。为使得基金的投资组合更紧密地跟踪标的指数，基金可投资于经中国证监会允许的各种金融衍生产品，如股指期货以及其他与标的指数或标的指数成份

	股相关的衍生工具。本基金产品投资策略主要包括：债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、融资及转融通投资策略、存托凭证投资策略等。
业绩比较基准	沪深300指数收益率
风险收益特征	本基金属股票型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

### 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	招商证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	童建林	韩鑫普
	联系电话	022-83310208	0755-82943666
	电子邮箱	service@thfund.com.cn	tgb@cmschina.com.cn
客户服务电话		95046	95565
传真		022-83865564	0755-82960794
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	深圳市福田区福田街道福华一路111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	深圳市福田区福田街道福华一路111号
邮政编码		300203	518000
法定代表人		韩歆毅	霍达

### 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	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)	
本期已实现收益	1,923,511.92	
本期利润	33,554,234.21	
加权平均基金份额本期利润	0.0051	
本期加权平均净值利润率	0.48%	
本期基金份额净值增长率	0.30%	
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	261,909,668.65
	期末可供分配基金份额利润	0.0393
	期末基金资产净值	6,933,619,164.65
期末基金份额净值	1.0393	
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	3.93%	

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
过去一个月	2.09%	0.87%	1.16%	0.87%	0.93%	0.00%
过去三个月	-4.11%	0.83%	-5.15%	0.83%	1.04%	0.00%
过去六个月	0.30%	0.84%	-0.75%	0.84%	1.05%	0.00%
过去一年	-12.49%	0.99%	-14.33%	0.99%	1.84%	0.00%
过去三年	-1.43%	1.19%	-7.72%	1.20%	6.29%	-0.01%
自基金合同生效日起至今	3.93%	1.23%	-0.19%	1.24%	4.12%	-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2019年12月05日生效。



2、本报告期内，本基金的各项投资比例达到基金合同约定的各项比例要求。

## §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		
陈瑶	本基金基金经理	2019年12月	-	12年	女，金融学硕士。2011年7月加盟本公司，历任交易员、交易主管，从事交易管理、程序化交易策略、基差交易

					策略、融资融券交易策略等研究工作。
--	--	--	--	--	-------------------

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 公平交易制度的执行情况

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

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

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

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

##### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易次数为3次，投资组合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易，未导致不公平交易和利益输送。

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内本基金秉承合规第一、风控第一的原则，在运作过程中严格遵守基金合同，对指数基金采取被动复制的方式跟踪指数，完全复制标的指数，保证基金净值增长率与基准指数间的高度正相关和跟踪误差最小化。

出于基金充分投资、减少交易成本、降低跟踪误差的需要，基于谨慎原则，报告期内本基金运用股指期货工具对基金投资组合进行管理。根据风险管理的原则，本基金在报告期内运用股指期货工具旨在提高投资效率，控制基金投资组合风险水平，力求更好地实现本基金的投资目标。

报告期内，本基金跟踪误差的来源主要是申购赎回、打新、成分股调整导致的权重偏离因素。当由于申赎等情况可能对指数跟踪效果带来影响时，本基金坚持既定的指数化投资策略，对指数基金采取被动复制与组合优化相结合的方式跟踪指数，同时紧密跟踪成分股的权息事件，及时有效处理，避免权重偏离造成跟踪误差的扩大。

报告期内，本基金整体运行平稳。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2023年06月30日，本基金份额净值为1.0393元，本报告期份额净值增长率0.30%，同期业绩比较基准增长率-0.75%。

## 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今年上半年股票市场在两重预期差中展开弱势震荡行情。一重预期差是经济修复的预期差，1季度股票市场在强政策刺激下对经济强修复的预期走高，但随着经济数据的验证，经济修复预期收敛，股票市场开始回调。另一重预期差是，在经济数据不及预期，需求未见明显修复的情形下，市场对稳增长政策加码的预期增强，但由于政策的定力超预期，市场陷入悲观情形，2季度股票市场继续走弱。上半年，股票市场以中特估、AI的主题投资机会为主，缺乏可扩散的投资主线，也侧面反映出市场的悲观情绪，风险偏好收敛到相对确定的主题投资板块。期间由于预期的摆动，股票市场中成长、顺周期板块来回震荡，快速切换，总体操作难度加大。汇率方面也有所反应。今年上半年人民币汇率面临贬值压力，我们认为人民币汇率的贬值压力主要反映的是对国内经济修复的悲观情绪。

进入下半年，我们认为下半年股票市场下跌空间较为有限，同时存在行情演绎的可能契机。一方面股票市场由于悲观情绪已经有了明显的回调，部分板块甚至回落到去年10月底的市场低点附近。从宏观环境上比较，去年10月底处于市场极度悲观，地产政策和疫情防控政策未放松优化的状态；而今年经济尽管修复的节奏较慢，但总体仍在修复，地产风险有所化解，同比GDP经济增速增长；另一方面汇率也已经逼近7.3的关口，不排

除后续可能出台维持人民币汇率稳定的举措，当前人民币汇率已经兑现了对经济和政策力度悲观的预期，我们认为人民币汇率不具备继续大幅贬值的基础。除此之外，7月再次迎来政策窗口期，不排除若有较为积极的超预期政策出台，那么市场可能迎来一波风险偏好修复的反弹行情。并且下半年的经济内在修复动能如果持续显现，那么也将有利于缓解及逆转当前的悲观情绪。

从中长期看，我们仍然看好中长期股票市场的表现。当前股票市场的底部区域特征还是较为明确的，一来政策底的信号已经明确。另一方面，近几年来，股票市场多轮下探已经对底部进行了多次试探。虽然经济底还尚未确认，宏观经济层面仍然存在一些不确定因素，包括宏观经济增长压力、外需可能回落、地缘政治风险等等，但无疑当前的指数点位也处于较低位置。因此中长期我们可以对中国经济的修复以及股票市场的表现更加乐观一些。

#### 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

本报告期，招商证券股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

#### 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，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

#### 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

本托管人复核审查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。

### §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：天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金

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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	19,921,448.73	16,081,587.78
结算备付金		564,889.35	9,134,809.54
存出保证金		278,454.92	2,012,939.76
交易性金融资产	6.4.7.2	6,928,299,818.91	6,856,842,489.45
其中：股票投资		6,928,299,818.91	6,856,842,489.45

基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
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		-	91,963.13
应收股利		43,706.30	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	114,768.83	63,583.26
资产总计		6,949,223,087.04	6,884,227,372.92
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年06月30日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
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		11,095,080.73	295,819.33
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		2,840,548.97	2,916,275.84

应付托管费		568,109.79	583,255.18
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		13,341.60	2,204.29
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	1,086,841.30	1,237,388.52
负债合计		15,603,922.39	5,034,943.16
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	6,671,709,496.00	6,638,709,496.00
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	261,909,668.65	240,482,933.76
净资产合计		6,933,619,164.65	6,879,192,429.76
负债和净资产总计		6,949,223,087.04	6,884,227,372.92

注：报告截止日2023年06月30日，基金份额净值1.0393元，基金份额总额6,671,709,496.00份。

## 6.2 利润表

会计主体：天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金

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 2023年01月01日至 2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至202 2年06月30日
一、营业总收入		55,838,406.25	-500,003,028.15
1.利息收入		1,762,848.99	1,795,287.64
其中：存款利息收入	6.4.7.9	111,557.12	321,441.09
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		1,651,291.87	1,473,846.55
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		21,945,371.34	-93,376,254.56
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-62,297,021.95	-156,699,476.72
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	377,067.96	3,197,333.59
资产支持证券投资 收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	107,241.77	-6,122,788.53
股利收益	6.4.7.15	83,758,083.56	66,248,677.10
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	31,630,722.29	-407,792,558.54
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	499,463.63	-629,502.69
<b>减：二、营业总支出</b>		22,284,172.04	20,596,301.07
1. 管理人报酬		17,486,327.96	16,149,209.99
2. 托管费		3,497,265.60	3,229,842.04
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	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		8,411.74	5,309.38



8. 其他费用	6.4.7.19	1,292,166.74	1,211,939.66
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		33,554,234.21	-520,599,329.22
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		33,554,234.21	-520,599,329.22
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		33,554,234.21	-520,599,329.22

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金

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）	6,638,709,496.00	-	240,482,933.76	6,879,192,429.76
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）	6,638,709,496.00	-	240,482,933.76	6,879,192,429.76
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	33,000,000.00	-	21,426,734.89	54,426,734.89
（一）、综合收益总额	-	-	33,554,234.21	33,554,234.21

(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)	33,000,000.00	-	-12,127,499.32	20,872,500.68
其中: 1.基金申购款	264,000,000.00	-	10,807,538.58	274,807,538.58
2.基金赎回款	-231,000,000.00	-	-22,935,037.90	-253,935,037.90
(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)	6,671,709,496.00	-	261,909,668.65	6,933,619,164.65
项目	上年度可比期间 2022年01月01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)	5,318,709,496.00	-	1,579,674,947.75	6,898,384,443.75
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）	5,318,709,496.00	-	1,579,674,947.75	6,898,384,443.75
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	444,000,000.00	-	-498,241,990.79	-54,241,990.79
（一）、综合收益总额	-	-	-520,599,329.22	-520,599,329.22
（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）	444,000,000.00	-	22,357,338.43	466,357,338.43
其中：1.基金申购款	1,158,000,000.00	-	111,904,981.48	1,269,904,981.48
2.基金赎回款	-714,000,000.00	-	-89,547,643.05	-803,547,643.05
（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）	5,762,709,496.00	-	1,081,432,956.96	6,844,142,452.96

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

天弘沪深300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[2019]1044号《关于准予天弘沪深300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《天弘沪深300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236,708,830.00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(2019)第0653号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于2019年12月5日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为236,709,496.00份基金份额,其中认购资金利息折合666.00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,基金托管人为招商证券股份有限公司。

根据《天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定,经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2019]293号文审核同意,本基金236,709,496.00份基金份额于2019年12月26日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。此外,为更好地实现基金的投资目标,本基金还可以投资于国内依法发行上市的非成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、存托凭证、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、货币市场工具、同业存单、债券回购、资产支持证券、银行存款、股指期货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的相关规定)。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。基金的投资组合比例为:本基金投资于标的指数的成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%,且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,应当保持不低于交易保证金一倍的现金,股指期货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。本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率。

本基金的基金管理人天弘基金管理有限公司以本基金为目标ETF,将原天弘沪深300指数型发起式证券投资基金转型为天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基

金(以下简称“天弘沪深300ETF联接基金”)。天弘沪深300ETF联接基金为契约型开放式基金,投资目标与本基金类似,将绝大多数基金资产投资于本基金。

#### 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》、《天弘沪深300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	19,921,448.73
等于：本金	19,912,071.41
加：应计利息	9,377.32
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	19,921,448.73

#### 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	7,758,685,773.28	-	6,928,299,818.91	-830,385,954.37
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	7,758,685,773.28	-	6,928,299,818.91	-830,385,954.37

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。

#### 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**

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日
应收利息	-
其他应收款	39,152.59
待摊费用	75,616.24
合计	114,768.83

**6.4.7.6 其他负债**

单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	297,871.60
其中：交易所市场	297,871.60
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	268,603.31
其他应付款	520,366.39
合计	1,086,841.30

**6.4.7.7 实收基金**

金额单位：人民币元



项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	6,638,709,496.00	6,638,709,496.00
本期申购	264,000,000.00	264,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-231,000,000.00	-231,000,000.00
本期末	6,671,709,496.00	6,671,709,496.00

#### 6.4.7.8 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
本期期初	1,567,779,673.24	-1,327,296,739.48	240,482,933.76
本期利润	1,923,511.92	31,630,722.29	33,554,234.21
本期基金份额交易产生的变动数	7,821,282.18	-19,948,781.50	-12,127,499.32
其中：基金申购款	61,950,144.06	-51,142,605.48	10,807,538.58
基金赎回款	-54,128,861.88	31,193,823.98	-22,935,037.90
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,577,524,467.34	-1,315,614,798.69	261,909,668.65

#### 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
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	19,501.82
其他	3,480.49
合计	111,557.12

#### 6.4.7.10 股票投资收益

**6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-57,130,750.73
股票投资收益——赎回差价收入	-5,166,271.22
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	-62,297,021.95

**6.4.7.10.2 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01月01日至2023年06月30日
卖出股票成交总额	379,489,685.00
减：卖出股票成本总额	435,813,336.78
减：交易费用	807,098.95
买卖股票差价收入	-57,130,750.73

**6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入**

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
赎回基金份额对价总额	253,935,037.90
减：现金支付赎回款总额	102,720,027.90
减：赎回股票成本总额	156,381,281.22
减：交易费用	-
赎回差价收入	-5,166,271.22

**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	398.30
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	376,669.66
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	377,067.96

#### 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	2,373,475.08
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,996,300.00
减：应计利息总额	410.48
减：交易费用	94.94
买卖债券差价收入	376,669.66

#### 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**

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2023年01月01日至2023年06月30日
期货投资	107,241.77

**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	83,758,083.56
其中：证券出借权益补偿收入	577,268.48
基金投资产生的股利收益	-
合计	83,758,083.56

**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	31,419,522.29
——股票投资	31,419,522.29
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	211,200.00
——权证投资	-
——期货投资	211,200.00
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	31,630,722.29
----	---------------

#### 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	-
基金转换费收入	-
ETF基金替代损益	499,463.63
延期合约递延费收入	-
合计	499,463.63

#### 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	59,507.37
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
指数使用费	1,049,179.67
IOPV计算发布费	49,588.57
ETF登记结算费	74,383.76
合计	1,292,166.74

#### 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
招商证券股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
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
天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金	本基金的联接基金

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

金额单位：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01日至2022年06月30日	
	成交金额	占当期 股票成 交总额 的比例	成交金额	占当期 股票成 交总额 的比例
招商证券股份有限公司	96,120.00	0.01%	21,749,397.88	1.20%

#### 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

金额单位：人民币元

关联方名	本期

称	2023年01月01日至2023年06月30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
招商证券股份有限公司	22.25	0.01%	8.03	-
关联方名称	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30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
招商证券股份有限公司	5,030.55	0.65%	624.87	0.10%

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。

#### 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01日至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	17,486,327.96	16,149,209.99
其中:支付销售机构的客户维护费	50,317.55	-

注:1、支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值0.50%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。

#### 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01日至2022 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	3,497,265.60	3,229,842.04

注:支付基金托管人招商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。

#### 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

份额单位：份



关联方名称	本期末 2023年06月30日		上年度末 2022年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金	6,567,087,000.00	98.43%	6,535,354,500.00	98.44%
招商证券股份有限公司	197.00	0.00%	197.00	0.00%

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

#### 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01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
招商证券股份有限公司	19,921,448.73	88,574.81	39,056,998.46	266,057.26

注：本基金由基金托管人招商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。

#### 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2023年01月01日至2023年06月30日				
关联方名	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入

称				数量（单位：张 /股）	总金额
招商证券 股份有限 公司	301428	世纪恒通	网下申购	2,289	60,315.15
招商证券 股份有限 公司	301305	朗坤环境	网下申购	7,523	189,955.75
上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日					
关联方名 称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张 /股）	总金额
招商证券 股份有限 公司	301123	奕东电子	网下申购	6,551	243,893.73
招商证券 股份有限 公司	301222	浙江恒威	网下申购	3,315	112,643.70
招商证券 股份有限 公司	688072	拓荆科技	网下申购	5,300	380,964.00
招商证券 股份有限 公司	001323	慕思股份	网下申购	573	22,306.89

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本报告期末，本基金（因追踪指数成份股而被动）持有招商证券的股票1,359,831股（上年度末：1,365,331股），估值总额为人民币18,452,906.67元（上年度末：18,158,902.30元），占基金净资产的比例为0.27%（上年度末：0.26%）；持有君正集团的股票1,236,200股（上年度末：1,240,500股），估值总额为人民币5,068,420.00元（上年度末：4,949,595.00元），占基金净资产的比例为0.07%（上年度末：0.07%）。

#### 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
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	-
688472	阿特斯	2023-06-02	6个月	科创板打新限售	11.10	17.04	6,261	69,497.10	106,687.44	-
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	-
688443	智翔金泰	2023-06-13	6个月	科创板打新限售	37.88	29.49	3,033	114,890.04	89,443.17	-
301358	湖南裕能	2023-02-01	6个月	创业板打新限售	23.77	42.89	2,023	48,086.71	86,766.47	-

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	-
688469	中芯集成	2023-04-28	6个月	科创板打新限售	5.69	5.41	13,800	78,522.00	74,658.00	-
301260	格力博	2023-01-20	6个月	创业板打新限售	30.85	23.63	3,121	96,282.85	73,749.23	-
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	-
688361	中科飞测	2023-05-12	6个月	科创板打新限售	23.60	64.67	831	19,611.60	53,740.77	-
688531	日联科技	2023-03-24	6个月	科创板打新限售	152.38	135.97	346	52,723.48	47,045.62	-
301325	曼恩斯特	2023-05-04	6个月	创业板打新限售	76.80	107.95	364	27,955.20	39,293.80	-
688146	中船特气	2023-04-13	6个月	科创板打新限售	36.15	38.13	1,011	36,547.65	38,549.43	-

001286	陕西能源	2023-03-31	6个月	新股锁定	9.60	9.41	3,767	36,163.20	35,447.47	-
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	-
601061	中信金属	2023-03-30	6个月	新股锁定	6.58	7.58	4,016	26,425.28	30,441.28	-
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	-
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	2023-02-1	6个月	创业	26.80	22.32	1,058	28,354.40	23,614.56	-

	仪表	3		板打 新限售							
6885 52	航天 南湖	2023 -05-0 8	6个月	科创 板打 新限售	21.17	23.50	956	20,23 8.52	22,46 6.00	-	
6885 70	天玛 智控	2023 -05-2 9	6个月	科创 板打 新限售	30.26	25.33	884	26,74 9.84	22,39 1.72	-	
3013 07	美利 信	2023 -04-1 4	6个月	创业 板打 新限售	32.34	31.86	687	22,21 7.58	21,88 7.82	-	
6885 43	国科 军工	2023 -06-1 4	6个月	科创 板打 新限售	43.67	53.05	410	17,90 4.70	21,75 0.50	-	
3013 22	绿通 科技	2023 -02-2 7	6个月	创业 板打 新限售	131.1 1	53.24	392	34,21 9.71	20,87 0.08	-	
6884 58	美芯 晟	2023 -05-1 5	6个月	科创 板打 新限售	75.00	90.76	221	16,57 5.00	20,05 7.96	-	
6885 81	安杰 思	2023 -05-1 2	6个月	科创 板打 新限售	125.8 0	118.0 3	163	20,50 5.40	19,23 8.89	-	
3013 17	鑫磊 股份	2023 -01-1 2	6个月	创业 板打 新限售	20.67	26.17	694	14,34 4.98	18,16 1.98	-	

				售							
301262	海看股份	2023-06-13	6个月	创业板打新限售	30.22	25.50	692	20,912.24	17,646.00	-	
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	二元科技	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	-	
3013	朗坤	2023	6个月	创业	25.25	19.69	753	19,01	14,82	-	

05	环境	-05-15		板打新限售				3.25	6.57	
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	-



				售							
688433	华曙高科	2023-04-07	6个月	科创板打新限售	26.66	31.50	418	11,143.88	13,167.00	-	
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	2023-06-0	6个月	创业板打	35.66	33.26	333	11,874.78	11,075.58	-	

		8		新限售						
301429	森泰股份	2023-04-10	6个月	创业板打新限售	28.75	21.02	499	14,346.25	10,488.98	-
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	-
3013	未来	2023	6个月	创业	29.99	23.79	378	11,33	8,99	-

86	电器	-03-21		板打新限售				6.22	2.62	
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	-
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	2023-05-1	6个月	新股	18.88	19.60	114	2,152.32	2,234.40	-

	科技	2		锁定						
001367	海森药业	2023-03-30	6个月	新股锁定	44.48	39.48	55	2,446.40	2,171.40	-
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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值 单价	数量（单 位：股）	期末估值 总额
1	000063	中兴通讯	2023年07月05日- 2023年07月14日	45.54	134,300	6,116,022. 00
2	000100	TCL科技	2023年07月03日- 2023年07月13日	3.94	574,200	2,262,348. 00
3	000301	东方盛虹	2023年07月03日- 2023年07月03日	11.82	56,400	666,648.00
4	000408	藏格矿业	2023年07月03日- 2023年07月03日	22.57	26,400	595,848.00
5	000617	中油资本	2023年07月12日- 2023年07月14日	7.23	180,500	1,305,015. 00

6	000625	长安汽车	2023年07月03日- 2023年07月14日	12.93	354,900	4,588,857. 00
7	000723	美锦能源	2023年07月07日- 2023年07月10日	7.54	185,400	1,397,916. 00
8	000792	盐湖股份	2023年07月13日- 2023年07月13日	19.17	79,100	1,516,347. 00
9	000877	天山股份	2023年07月13日- 2023年07月14日	8.14	35,700	290,598.00
10	000938	紫光股份	2023年07月14日- 2023年07月14日	31.85	1,200	38,220.00
11	000977	浪潮信息	2023年07月12日- 2023年07月12日	48.50	73,100	3,545,350. 00
12	000983	山西焦煤	2023年07月03日- 2023年07月14日	9.10	99,200	902,720.00
13	001289	龙源电力	2023年07月12日- 2023年07月13日	22.50	10,800	243,000.00
14	001979	招商蛇口	2023年07月04日- 2023年07月14日	13.03	221,100	2,880,933. 00
15	002050	三花智控	2023年07月03日- 2023年07月13日	30.26	153,100	4,632,806. 00
16	002064	华峰化学	2023年07月05日- 2023年07月14日	6.86	63,200	433,552.00
17	002120	韵达股份	2023年07月05日- 2023年07月14日	9.56	32,800	313,568.00
18	002179	中航光电	2023年07月14日- 2023年07月14日	45.35	18,000	816,300.00
19	002202	金风科技	2023年07月14日- 2023年07月14日	10.62	1,000	10,620.00
20	002230	科大讯飞	2023年07月12日- 2023年07月13日	67.96	132,100	8,977,516. 00
21	002236	大华股份	2023年07月14日- 2023年07月14日	19.75	14,800	292,300.00
22	002414	高德红外	2023年07月05日-	7.77	27,900	216,783.00

			2023年07月14日			
23	002459	晶澳科技	2023年07月12日- 2023年07月14日	41.70	98,400	4,103,280.00
24	002466	天齐锂业	2023年07月04日- 2023年07月14日	69.91	17,000	1,188,470.00
25	002475	立讯精密	2023年07月12日- 2023年07月14日	32.45	35,400	1,148,730.00
26	002493	荣盛石化	2023年07月14日- 2023年07月14日	11.64	11,400	132,696.00
27	002555	三七互娱	2023年07月12日- 2023年07月13日	34.88	110,300	3,847,264.00
28	002601	龙佰集团	2023年07月03日- 2023年07月03日	16.50	101,900	1,681,350.00
29	002648	卫星化学	2023年07月13日- 2023年07月13日	14.96	8,700	130,152.00
30	002812	恩捷股份	2023年07月12日- 2023年07月12日	96.35	38,000	3,661,300.00
31	002938	鹏鼎控股	2023年07月03日- 2023年07月03日	24.29	1,000	24,290.00
32	300122	智飞生物	2023年07月04日- 2023年07月04日	44.20	1,200	53,040.00
33	300207	欣旺达	2023年07月14日- 2023年07月14日	16.32	1,400	22,848.00
34	300413	芒果超媒	2023年07月03日- 2023年07月12日	34.21	19,800	677,358.00
35	300450	先导智能	2023年07月03日- 2023年07月14日	36.17	6,200	224,254.00
36	300759	康龙化成	2023年07月14日- 2023年07月14日	38.28	6,000	229,680.00
37	300957	贝泰妮	2023年07月12日- 2023年07月12日	88.88	9,000	799,920.00
38	300979	华利集团	2023年07月04日- 2023年07月13日	48.74	4,100	199,834.00



39	600010	包钢股份	2023年07月05日- 2023年07月05日	1.79	470,400	842,016.00
40	600015	华夏银行	2023年07月12日- 2023年07月12日	5.41	8,700	47,067.00
41	600025	华能水电	2023年07月14日- 2023年07月14日	7.13	1,000	7,130.00
42	600061	国投资本	2023年07月03日- 2023年07月04日	7.12	14,000	99,680.00
43	600104	上汽集团	2023年07月13日- 2023年07月13日	14.17	1,300	18,421.00
44	600115	中国东航	2023年07月05日- 2023年07月14日	4.76	488,900	2,327,164. 00
45	600150	中国船舶	2023年07月05日- 2023年07月12日	32.91	159,500	5,249,145. 00
46	600188	兖矿能源	2023年07月14日- 2023年07月14日	29.92	52,600	1,573,792. 00
47	600219	南山铝业	2023年07月11日- 2023年07月11日	3.02	6,000	18,120.00
48	600332	白云山	2023年07月12日- 2023年07月14日	31.88	4,800	153,024.00
49	600346	恒力石化	2023年07月12日- 2023年07月12日	14.33	39,800	570,334.00
50	600426	华鲁恒升	2023年07月03日- 2023年07月14日	30.63	7,400	226,662.00
51	600438	通威股份	2023年07月12日- 2023年07月12日	34.31	2,800	96,068.00
52	600460	士兰微	2023年07月14日- 2023年07月14日	30.27	54,200	1,640,634. 00
53	600584	长电科技	2023年07月12日- 2023年07月12日	31.17	57,000	1,776,690. 00
54	600606	绿地控股	2023年07月03日- 2023年07月14日	2.75	140,000	385,000.00
55	600660	福耀玻璃	2023年07月12日-	35.85	3,100	111,135.00

			2023年07月14日			
56	600674	川投能源	2023年07月03日- 2023年07月11日	15.05	61,600	927,080.00
57	600732	爱旭股份	2023年07月12日- 2023年07月13日	30.75	55,700	1,712,775. 00
58	600745	闻泰科技	2023年07月12日- 2023年07月14日	48.90	17,600	860,640.00
59	600760	中航沈飞	2023年07月11日- 2023年07月11日	45.00	1,000	45,000.00
60	600803	新奥股份	2023年07月03日- 2023年07月11日	18.98	55,600	1,055,288. 00
61	600918	中泰证券	2023年07月03日- 2023年07月03日	6.91	1,800	12,438.00
62	601006	大秦铁路	2023年07月03日- 2023年07月03日	7.43	231,600	1,720,788. 00
63	601012	隆基绿能	2023年07月13日- 2023年07月13日	28.67	1,900	54,473.00
64	601111	中国国航	2023年07月12日- 2023年07月12日	8.24	249,000	2,051,760. 00
65	601138	工业富联	2023年07月12日- 2023年07月14日	25.20	283,800	7,151,760. 00
66	601155	新城控股	2023年07月12日- 2023年07月12日	14.41	64,500	929,445.00
67	601216	君正集团	2023年07月03日- 2023年07月13日	4.10	230,600	945,460.00
68	601236	红塔证券	2023年07月14日- 2023年07月14日	7.45	60,800	452,960.00
69	601238	广汽集团	2023年07月14日- 2023年07月14日	10.42	2,600	27,092.00
70	601319	中国人保	2023年07月12日- 2023年07月12日	5.84	2,300	13,432.00
71	601360	三六零	2023年07月05日- 2023年07月12日	12.54	254,800	3,195,192. 00

72	601615	明阳智能	2023年07月14日- 2023年07月14日	16.88	49,000	827,120.00
73	601633	长城汽车	2023年07月04日- 2023年07月13日	25.17	27,100	682,107.00
74	601669	中国电建	2023年07月12日- 2023年07月14日	5.74	492,200	2,825,228. 00
75	601689	拓普集团	2023年07月12日- 2023年07月14日	80.70	19,200	1,549,440. 00
76	601698	中国卫通	2023年07月06日- 2023年07月06日	19.88	13,100	260,428.00
77	601788	光大证券	2023年07月03日- 2023年07月04日	15.89	10,000	158,900.00
78	601808	中海油服	2023年07月14日- 2023年07月14日	13.88	7,800	108,264.00
79	601816	京沪高铁	2023年07月12日- 2023年07月12日	5.26	13,400	70,484.00
80	601838	成都银行	2023年07月12日- 2023年07月12日	12.21	7,100	86,691.00
81	601857	中国石油	2023年07月04日- 2023年07月04日	7.47	2,000	14,940.00
82	601865	福莱特	2023年07月12日- 2023年07月14日	38.51	29,600	1,139,896. 00
83	601881	中国银河	2023年07月03日- 2023年07月14日	11.61	17,200	199,692.00
84	601988	中国银行	2023年07月03日- 2023年07月03日	3.91	9,200	35,972.00
85	601995	中金公司	2023年07月12日- 2023年07月12日	35.52	1,200	42,624.00
86	601998	中信银行	2023年07月12日- 2023年07月12日	5.98	1,500	8,970.00
87	603019	中科曙光	2023年07月03日- 2023年07月13日	50.90	83,400	4,245,060. 00
88	603195	公牛集团	2023年07月12日-	96.06	8,200	787,692.00

			2023年07月12日			
89	603290	斯达半导	2023年07月13日- 2023年07月13日	215.20	6,000	1,291,200.00
90	603799	华友钴业	2023年07月12日- 2023年07月13日	45.91	90,900	4,173,219.00
91	605117	德业股份	2023年07月14日- 2023年07月14日	149.55	6,400	957,120.00
92	605499	东鹏饮料	2023年07月13日- 2023年07月13日	172.90	3,100	535,990.00
93	688005	容百科技	2023年07月12日- 2023年07月13日	54.02	22,400	1,210,048.00
94	688008	澜起科技	2023年07月12日- 2023年07月12日	57.42	56,400	3,238,488.00
95	688036	传音控股	2023年07月12日- 2023年07月12日	147.00	22,900	3,366,300.00
96	688065	XD凯赛生	2023年07月10日- 2023年07月10日	62.26	2,200	136,972.00
97	688111	金山办公	2023年07月12日- 2023年07月12日	472.22	12,900	6,091,638.00
98	688363	华熙生物	2023年07月04日- 2023年07月04日	89.16	1,200	106,992.00
99	688599	天合光能	2023年07月12日- 2023年07月13日	42.61	3,400	144,874.00
合计					7,050,700	130,761,747.00

### 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有效性,经营效率和效果等方面开展独立评价活动,向总经理和督察长汇报。本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发,判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发,根据本基金的投资目标,结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型,日常的量化报告,确定风险损失的限度和相应置信程度,及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估,并通过相应决策,将风险控制在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款和定期存款存放在本基金的托管人招商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。

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**

本基金本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级的债券。

#### **6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级的资产支持证券。

#### **6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

本基金本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级的同业存单。

#### **6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

本基金本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级的债券。

#### **6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级的资产支持证券。

#### **6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

本基金本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级的同业存单。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险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。

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	19,921,448.73	-	-	-	19,921,448.73
结算备付金	564,889.35	-	-	-	564,889.35
存出保证金	278,454.92	-	-	-	278,454.92
交易性金融资产	-	-	-	6,928,299,818.91	6,928,299,818.91
应收股利	-	-	-	43,706.30	43,706.30
其他资产	-	-	-	114,768.83	114,768.83
资产总计	20,764,793.00	-	-	6,928,458,294.04	6,949,223,087.04
负债					
应付清算款	-	-	-	11,095,080.73	11,095,080.73
应付管理人报酬	-	-	-	2,840,548.97	2,840,548.97
应付托管费	-	-	-	568,109.79	568,109.79
应交税费	-	-	-	13,341.60	13,341.60
其他负债	-	-	-	1,086,841.30	1,086,841.30
负债总计	-	-	-	15,603,922.39	15,603,922.39
利率敏感度缺口	20,764,793.00	-	-	6,912,854,371.65	6,933,619,164.65
上年度末 2022 年 12 月 31 日					
资产					
银行存款	16,081,587.78	-	-	-	16,081,587.78
结算备付金	9,134,809.54	-	-	-	9,134,809.54
存出保证金	607,427.76	-	-	1,405,512.00	2,012,939.76



交易性金融资产	-	-	-	6,856,842,489.45	6,856,842,489.45
应收清算款	-	-	-	91,963.13	91,963.13
其他资产	-	-	-	63,583.26	63,583.26
资产总计	25,823,825.08	-	-	6,858,403,547.84	6,884,227,372.92
负债					
应付清算款	-	-	-	295,819.33	295,819.33
应付管理人报酬	-	-	-	2,916,275.84	2,916,275.84
应付托管费	-	-	-	583,255.18	583,255.18
应交税费	-	-	-	2,204.29	2,204.29
其他负债	-	-	-	1,237,388.52	1,237,388.52
负债总计	-	-	-	5,034,943.16	5,034,943.16
利率敏感度缺口	25,823,825.08	-	-	6,853,368,604.68	6,879,192,429.76

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，本基金未持有交易性债券投资(2022年12月31日：同)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响(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。

本基金原则上采用完全复制法，跟踪沪深300指数，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金投资组合，并根据标的指数组成及其权重的变动而进行相应调整。但因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。

##### 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	6,928,299,818.91	99.92	6,856,842,489.45	99.68
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	6,928,299,818.91	99.92	6,856,842,489.45	99.68

注：其他包含在期货交易所交易的期货投资(附注6.4.7.3)。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。

#### 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%	342,867,467.69	343,478,078.02
	业绩比较基准下降5%	-342,867,467.69	-343,478,078.02

#### 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	6,925,796,738.28	6,851,553,540.12
第二层次	865,434.18	-
第三层次	1,637,646.45	5,288,949.33
合计	6,928,299,818.91	6,856,842,489.45

##### 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	6,928,299,818.91	99.70
	其中：股票	6,928,299,818.91	99.70
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	20,486,338.08	0.29
8	其他各项资产	436,930.05	0.01
9	合计	6,949,223,087.04	100.00

注：本报告期末，本基金参与转融通证券出借业务出借证券的公允价值为 130,761,747.00 元，占基金资产净值的比例为 1.89%。

## 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	77,505,732.05	1.12
B	采矿业	269,854,118.55	3.89
C	制造业	3,913,223,540.18	56.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	206,617,426.00	2.98
E	建筑业	164,241,404.70	2.37
F	批发和零售业	23,075,530.00	0.33
G	交通运输、仓储和邮政业	215,818,679.81	3.11

H	住宿和餐饮业	7,087,716.00	0.10
I	信息传输、软件和信息技术服务业	344,172,969.15	4.96
J	金融业	1,418,344,535.86	20.46
K	房地产业	103,794,381.39	1.50
L	租赁和商务服务业	64,778,684.00	0.93
M	科学研究和技术服务业	67,601,695.77	0.97
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	39,671,336.20	0.57
R	文化、体育和娱乐业	9,377,713.62	0.14
S	综合	-	-
	合计	6,925,165,463.28	99.88

### 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	2,831,676.29	0.04
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	83,928.25	0.00
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	0.00
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	14,394.48	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	14,826.57	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	23,782.86	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,134,355.63	0.05

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600519	XD贵州茅	230,149	389,181,959.00	5.61
2	300750	宁德时代	966,740	221,180,444.60	3.19
3	601318	中国平安	3,969,886	184,202,710.40	2.66
4	600036	招商银行	4,536,006	148,599,556.56	2.14
5	000858	五粮液	711,228	116,335,563.96	1.68
6	000333	美的集团	1,801,371	106,136,779.32	1.53
7	002594	比亚迪	332,200	85,797,294.00	1.24
8	601166	兴业银行	5,329,318	83,403,826.70	1.20
9	600900	长江电力	3,586,800	79,124,808.00	1.14
10	600276	恒瑞医药	1,636,499	78,388,302.10	1.13
11	600030	中信证券	3,577,125	70,755,532.50	1.02
12	601899	紫金矿业	6,036,600	68,636,142.00	0.99
13	600887	伊利股份	2,333,200	66,076,224.00	0.95
14	300059	东方财富	4,648,817	66,013,201.40	0.95

15	601012	隆基绿能	2,222,704	63,724,923.68	0.92
16	601398	工商银行	12,845,600	61,915,792.00	0.89
17	600309	万华化学	690,394	60,644,208.96	0.87
18	000651	格力电器	1,651,022	60,278,813.22	0.87
19	002475	立讯精密	1,829,577	59,369,773.65	0.86
20	601328	交通银行	10,068,800	58,399,040.00	0.84
21	002415	海康威视	1,715,900	56,813,449.00	0.82
22	000568	泸州老窖	269,700	56,521,029.00	0.82
23	000725	京东方 A	13,740,600	56,199,054.00	0.81
24	300760	迈瑞医疗	177,700	53,274,460.00	0.77
25	000063	中兴通讯	1,168,100	53,195,274.00	0.77
26	601816	京沪高铁	8,998,900	47,334,214.00	0.68
27	603259	药明康德	752,019	46,858,303.89	0.68
28	002230	科大讯飞	678,900	46,138,044.00	0.67
29	300274	阳光电源	381,000	44,436,030.00	0.64
30	600028	中国石化	6,971,840	44,340,902.40	0.64
31	601668	XD中国建	7,684,600	44,109,604.00	0.64
32	300124	汇川技术	682,662	43,833,727.02	0.63
33	002714	牧原股份	1,002,205	42,242,940.75	0.61
34	601288	农业银行	11,700,200	41,301,706.00	0.60
35	002352	顺丰控股	897,100	40,450,239.00	0.58
36	000001	平安银行	3,555,840	39,932,083.20	0.58
37	601888	中国中免	357,800	39,547,634.00	0.57
38	002129	TCL中环	1,184,400	39,322,080.00	0.57
39	000792	盐湖股份	1,991,000	38,167,470.00	0.55
40	601088	中国神华	1,208,800	37,170,600.00	0.54
41	002142	宁波银行	1,452,032	36,736,409.60	0.53
42	601138	工业富联	1,455,900	36,688,680.00	0.53
43	688981	中芯国际	717,221	36,234,004.92	0.52
44	600031	三一重工	2,177,300	36,208,499.00	0.52
45	300498	温氏股份	1,921,678	35,262,791.30	0.51

46	000002	万科A	2,494,821	34,977,390.42	0.50
47	600048	保利发展	2,632,200	34,297,566.00	0.49
48	600016	民生银行	9,097,200	34,114,500.00	0.49
49	600406	国电南瑞	1,472,092	34,005,325.20	0.49
50	600438	通威股份	989,900	33,963,469.00	0.49
51	600050	中国联通	6,992,900	33,565,920.00	0.48
52	600809	山西汾酒	178,841	33,098,103.87	0.48
53	600837	海通证券	3,538,200	32,622,204.00	0.47
54	601601	中国太保	1,254,200	32,584,116.00	0.47
55	600690	海尔智家	1,387,200	32,571,456.00	0.47
56	601728	中国电信	5,690,000	32,034,700.00	0.46
57	688111	金山办公	67,562	31,904,127.64	0.46
58	600919	江苏银行	4,330,010	31,825,573.50	0.46
59	600089	特变电工	1,424,900	31,761,021.00	0.46
60	300015	爱尔眼科	1,709,404	31,709,444.20	0.46
61	600436	片仔癀	110,574	31,663,970.64	0.46
62	600000	浦发银行	4,302,695	31,151,511.80	0.45
63	601857	中国石油	4,154,085	31,031,014.95	0.45
64	600941	中国移动	330,900	30,872,970.00	0.45
65	002371	北方华创	96,900	30,780,285.00	0.44
66	601988	中国银行	7,723,700	30,199,667.00	0.44
67	603501	韦尔股份	303,760	29,780,630.40	0.43
68	002304	洋河股份	220,845	29,007,990.75	0.42
69	601766	中国中车	4,458,200	28,978,300.00	0.42
70	603288	海天味业	611,378	28,643,059.30	0.41
71	601390	中国中铁	3,764,700	28,536,426.00	0.41
72	600905	三峡能源	5,245,700	28,169,409.00	0.41
73	300014	亿纬锂能	449,852	27,216,046.00	0.39
74	600150	中国船舶	819,500	26,969,745.00	0.39
75	000938	紫光股份	838,540	26,707,499.00	0.39
76	002466	天齐锂业	378,900	26,488,899.00	0.38



77	601688	华泰证券	1,887,400	25,989,498.00	0.37
78	603986	兆易创新	244,424	25,970,050.00	0.37
79	601225	陕西煤业	1,421,100	25,849,809.00	0.37
80	002027	分众传媒	3,705,000	25,231,050.00	0.36
81	002460	赣锋锂业	413,589	25,212,385.44	0.36
82	002459	晶澳科技	604,492	25,207,316.40	0.36
83	601169	北京银行	5,423,900	25,112,657.00	0.36
84	688012	中微公司	158,553	24,805,616.85	0.36
85	000338	潍柴动力	1,988,600	24,777,956.00	0.36
86	600570	恒生电子	556,999	24,669,485.71	0.36
87	601985	中国核电	3,457,900	24,378,195.00	0.35
88	600104	上汽集团	1,712,700	24,268,959.00	0.35
89	002050	三花智控	789,600	23,893,296.00	0.34
90	000625	长安汽车	1,820,902	23,544,262.86	0.34
91	002049	紫光国微	249,120	23,230,440.00	0.34
92	601211	国泰君安	1,651,899	23,110,067.01	0.33
93	600111	XD北方稀	927,400	22,239,052.00	0.32
94	601919	中远海控	2,334,730	21,946,462.00	0.32
95	603019	中科曙光	429,274	21,850,046.60	0.32
96	000100	TCL科技	5,505,040	21,689,857.60	0.31
97	603799	华友钴业	469,000	21,531,790.00	0.31
98	601628	中国人寿	610,504	21,343,219.84	0.31
99	002179	中航光电	466,260	21,144,891.00	0.30
100	600660	福耀玻璃	587,300	21,054,705.00	0.30
101	601229	上海银行	3,644,200	20,954,150.00	0.30
102	601818	光大银行	6,802,800	20,884,596.00	0.30
103	600585	海螺水泥	879,600	20,881,704.00	0.30
104	002812	恩捷股份	215,000	20,715,250.00	0.30
105	600009	上海机场	456,000	20,711,520.00	0.30
106	600893	航发动力	488,500	20,644,010.00	0.30
107	601989	中国重工	4,178,700	20,141,334.00	0.29

108	002271	东方雨虹	738,450	20,130,147.00	0.29
109	601658	邮储银行	4,069,600	19,900,344.00	0.29
110	002555	三七互娱	568,939	19,844,592.32	0.29
111	300122	智飞生物	439,847	19,441,237.40	0.28
112	600958	东方证券	1,916,440	18,589,468.00	0.27
113	600999	招商证券	1,359,831	18,452,906.67	0.27
114	600019	宝钢股份	3,263,232	18,339,363.84	0.26
115	000977	浪潮信息	377,647	18,315,879.50	0.26
116	600760	中航沈飞	403,896	18,175,320.00	0.26
117	300896	爱美客	39,700	17,664,515.00	0.25
118	002709	天赐材料	423,340	17,437,374.60	0.25
119	688036	传音控股	117,925	17,334,975.00	0.25
120	300316	晶盛机电	239,795	17,001,465.50	0.25
121	688599	天合光能	398,108	16,963,381.88	0.24
122	688008	澜起科技	291,398	16,732,073.16	0.24
123	600426	华鲁恒升	544,800	16,687,224.00	0.24
124	601186	中国铁建	1,686,200	16,609,070.00	0.24
125	601360	三六零	1,309,300	16,418,622.00	0.24
126	600584	长电科技	521,700	16,261,389.00	0.23
127	601006	大秦铁路	2,179,600	16,194,428.00	0.23
128	000661	长春高新	118,583	16,162,862.90	0.23
129	601600	中国铝业	2,906,600	15,957,234.00	0.23
130	000776	广发证券	1,084,600	15,954,466.00	0.23
131	002410	广联达	488,160	15,860,318.40	0.23
132	002920	德赛西威	101,700	15,845,877.00	0.23
133	600745	闻泰科技	318,800	15,589,320.00	0.22
134	300142	沃森生物	589,000	15,579,050.00	0.22
135	002241	歌尔股份	877,600	15,577,400.00	0.22
136	600547	山东黄金	662,240	15,549,395.20	0.22
137	601377	兴业证券	2,531,470	15,492,596.40	0.22
138	600588	用友网络	754,820	15,473,810.00	0.22

139	601939	建设银行	2,460,900	15,405,234.00	0.22
140	000166	申万宏源	3,303,100	15,260,322.00	0.22
141	601009	南京银行	1,895,600	15,164,800.00	0.22
142	600011	华能国际	1,612,300	14,929,898.00	0.22
143	600010	包钢股份	8,320,500	14,893,695.00	0.21
144	000596	古井贡酒	59,878	14,812,619.64	0.21
145	001979	招商蛇口	1,134,311	14,780,072.33	0.21
146	300450	先导智能	401,700	14,529,489.00	0.21
147	601669	中国电建	2,525,100	14,494,074.00	0.21
148	600085	同仁堂	251,338	14,467,015.28	0.21
149	300408	三环集团	491,600	14,428,460.00	0.21
150	600196	复星医药	466,300	14,408,670.00	0.21
151	002311	海大集团	304,443	14,260,110.12	0.21
152	601800	中国交建	1,302,200	14,207,002.00	0.20
153	603659	璞泰来	369,575	14,125,156.50	0.20
154	000963	华东医药	321,500	13,943,455.00	0.20
155	000538	云南白药	263,499	13,828,427.52	0.20
156	600886	国投电力	1,092,600	13,821,390.00	0.20
157	300033	同花顺	78,782	13,808,908.96	0.20
158	603993	洛阳钼业	2,589,700	13,803,101.00	0.20
159	000768	中航西飞	509,800	13,637,150.00	0.20
160	600600	青岛啤酒	129,900	13,461,537.00	0.19
161	600845	宝信软件	263,767	13,402,001.27	0.19
162	300782	卓胜微	136,980	13,236,377.40	0.19
163	601689	拓普集团	161,500	13,033,050.00	0.19
164	002252	上海莱士	1,729,000	12,984,790.00	0.19
165	002493	荣盛石化	1,112,950	12,954,738.00	0.19
166	000733	振华科技	133,500	12,795,975.00	0.18
167	600926	杭州银行	1,086,540	12,766,845.00	0.18
168	601100	恒立液压	196,636	12,649,593.88	0.18
169	600015	华夏银行	2,332,500	12,618,825.00	0.18

170	600795	国电电力	3,268,000	12,516,440.00	0.18
171	600176	中国巨石	880,429	12,466,874.64	0.18
172	002180	纳思达	363,300	12,443,025.00	0.18
173	300347	泰格医药	192,222	12,406,007.88	0.18
174	600732	爱旭股份	401,660	12,351,045.00	0.18
175	600674	川投能源	817,400	12,301,870.00	0.18
176	000157	中联重科	1,820,100	12,285,675.00	0.18
177	603369	今世缘	229,897	12,138,561.60	0.18
178	002236	大华股份	609,500	12,037,625.00	0.17
179	600115	中国东航	2,508,200	11,939,032.00	0.17
180	600029	南方航空	1,975,800	11,914,074.00	0.17
181	000425	徐工机械	1,732,100	11,726,317.00	0.17
182	601066	中信建投	476,133	11,522,418.60	0.17
183	000301	东方盛虹	969,200	11,455,944.00	0.17
184	601995	中金公司	321,400	11,416,128.00	0.16
185	601633	长城汽车	452,629	11,392,671.93	0.16
186	601788	光大证券	716,000	11,377,240.00	0.16
187	300496	中科创达	117,400	11,311,490.00	0.16
188	601336	新华保险	305,716	11,241,177.32	0.16
189	601117	中国化学	1,343,400	11,123,352.00	0.16
190	601868	中国能建	4,753,000	11,122,020.00	0.16
191	600346	恒力石化	773,800	11,088,554.00	0.16
192	601877	正泰电器	393,900	10,891,335.00	0.16
193	002074	国轩高科	391,000	10,799,420.00	0.16
194	002202	金风科技	1,011,800	10,745,316.00	0.15
195	600741	华域汽车	577,600	10,662,496.00	0.15
196	601111	中国国航	1,279,700	10,544,728.00	0.15
197	002001	新和成	679,788	10,468,735.20	0.15
198	688126	沪硅产业	500,680	10,464,212.00	0.15
199	601618	中国中冶	2,617,800	10,392,666.00	0.15
200	300454	深信服	91,700	10,385,025.00	0.15

201	002821	凯莱英	87,801	10,348,225.86	0.15
202	002841	视源股份	154,249	10,310,003.16	0.15
203	688223	晶科能源	733,100	10,307,386.00	0.15
204	600989	宝丰能源	806,200	10,166,182.00	0.15
205	603806	福斯特	273,292	10,163,729.48	0.15
206	688396	华润微	193,400	10,136,094.00	0.15
207	600188	兖矿能源	336,700	10,074,064.00	0.15
208	601838	成都银行	821,700	10,032,957.00	0.14
209	601901	方正证券	1,508,900	9,868,206.00	0.14
210	300661	圣邦股份	119,810	9,839,995.30	0.14
211	601615	明阳智能	582,900	9,839,352.00	0.14
212	000876	新希望	831,500	9,711,920.00	0.14
213	688303	大全能源	235,000	9,505,750.00	0.14
214	605117	德业股份	63,040	9,427,632.00	0.14
215	600460	士兰微	311,300	9,423,051.00	0.14
216	600039	四川路桥	958,320	9,401,119.20	0.14
217	300413	芒果超媒	274,122	9,377,713.62	0.14
218	000895	双汇发展	381,000	9,330,690.00	0.13
219	603392	万泰生物	139,485	9,313,413.45	0.13
220	002648	卫星化学	617,202	9,233,341.92	0.13
221	002736	国信证券	1,057,100	9,228,483.00	0.13
222	600233	圆通速递	630,700	9,182,992.00	0.13
223	601607	上海医药	407,500	9,132,075.00	0.13
224	000786	北新建材	371,500	9,105,465.00	0.13
225	603260	合盛硅业	130,000	9,102,600.00	0.13
226	300769	德方纳米	81,780	9,014,609.40	0.13
227	002007	华兰生物	401,140	8,989,547.40	0.13
228	003816	中国广核	2,883,000	8,966,130.00	0.13
229	300207	欣旺达	546,100	8,912,352.00	0.13
230	300999	金龙鱼	218,600	8,741,814.00	0.13
231	002601	龙佰集团	525,500	8,670,750.00	0.13

232	300751	迈为股份	51,060	8,648,542.80	0.12
233	300433	蓝思科技	729,000	8,573,040.00	0.12
234	601238	广汽集团	811,600	8,456,872.00	0.12
235	600383	金地集团	1,158,000	8,349,180.00	0.12
236	300759	康龙化成	217,800	8,337,384.00	0.12
237	601021	春秋航空	143,515	8,247,807.05	0.12
238	600332	白云山	257,500	8,209,100.00	0.12
239	600132	重庆啤酒	88,700	8,174,592.00	0.12
240	600763	通策医疗	82,200	7,961,892.00	0.11
241	300223	北京君正	88,200	7,788,942.00	0.11
242	600219	南山铝业	2,575,000	7,776,500.00	0.11
243	600875	东方电气	407,400	7,598,010.00	0.11
244	000983	山西焦煤	831,900	7,570,290.00	0.11
245	300763	锦浪科技	72,700	7,568,070.00	0.11
246	002756	永兴材料	118,550	7,422,415.50	0.11
247	600362	江西铜业	380,100	7,214,298.00	0.10
248	601865	福莱特	186,500	7,182,115.00	0.10
249	000723	美锦能源	951,100	7,171,294.00	0.10
250	601699	潞安环能	438,400	7,154,688.00	0.10
251	600754	锦江酒店	167,400	7,087,716.00	0.10
252	600918	中泰证券	1,021,600	7,059,256.00	0.10
253	601878	浙商证券	710,318	7,017,941.84	0.10
254	601872	招商轮船	1,191,000	6,895,890.00	0.10
255	601319	中国人保	1,170,400	6,835,136.00	0.10
256	603290	斯达半导	31,300	6,735,760.00	0.10
257	601998	中信银行	1,123,600	6,719,128.00	0.10
258	600061	国投资本	942,088	6,707,666.56	0.10
259	000617	中油资本	926,200	6,696,426.00	0.10
260	000069	华侨城 A	1,503,000	6,613,200.00	0.10
261	000408	藏格矿业	289,500	6,534,015.00	0.09
262	603486	科沃斯	83,900	6,524,903.00	0.09

263	300628	亿联网络	185,075	6,490,580.25	0.09
264	601799	星宇股份	52,400	6,476,640.00	0.09
265	600803	新奥股份	340,500	6,462,690.00	0.09
266	603833	欧派家居	67,000	6,418,600.00	0.09
267	688363	华熙生物	70,624	6,296,835.84	0.09
268	600884	杉杉股份	414,700	6,278,558.00	0.09
269	688005	容百科技	115,770	6,253,895.40	0.09
270	300601	康泰生物	245,480	6,232,737.20	0.09
271	002938	鹏鼎控股	255,200	6,198,808.00	0.09
272	600183	生益科技	428,800	6,088,960.00	0.09
273	603899	晨光股份	135,900	6,066,576.00	0.09
274	300919	中伟股份	98,400	5,928,600.00	0.09
275	000708	中信特钢	370,000	5,860,800.00	0.08
276	601898	中煤能源	671,200	5,664,928.00	0.08
277	002916	深南电路	75,148	5,663,904.76	0.08
278	603185	弘元绿能	75,300	5,613,615.00	0.08
279	601881	中国银河	472,300	5,483,403.00	0.08
280	600018	上港集团	1,023,900	5,375,475.00	0.08
281	688561	奇安信	100,581	5,211,101.61	0.08
282	000877	天山股份	634,800	5,167,272.00	0.07
283	002120	韵达股份	531,571	5,081,818.76	0.07
284	601216	君正集团	1,236,200	5,068,420.00	0.07
285	002064	华峰化学	727,300	4,989,278.00	0.07
286	002414	高德红外	625,773	4,862,256.21	0.07
287	601155	新城控股	331,504	4,776,972.64	0.07
288	600025	华能水电	659,200	4,700,096.00	0.07
289	600606	绿地控股	1,544,026	4,246,071.50	0.06
290	300957	贝泰妮	46,600	4,141,808.00	0.06
291	603195	公牛集团	42,332	4,066,411.92	0.06
292	688187	时代电气	95,400	3,993,444.00	0.06
293	688065	凯赛生物	64,095	3,990,554.70	0.06

294	601698	中国卫通	154,700	3,075,436.00	0.04
295	601808	中海油服	216,800	3,009,184.00	0.04
296	000800	一汽解放	340,700	2,851,659.00	0.04
297	605499	东鹏饮料	16,100	2,783,690.00	0.04
298	300979	华利集团	55,500	2,705,070.00	0.04
299	601236	红塔证券	345,320	2,572,634.00	0.04
300	001289	龙源电力	55,400	1,246,500.00	0.02

### 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	688498	源杰科技	2,215	631,275.00	0.01
2	301486	致尚科技	4,820	277,921.20	0.00
3	301395	仁信新材	5,196	138,629.28	0.00
4	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.00
5	688472	阿特斯	6,261	106,687.44	0.00
6	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.00
7	688443	智翔金泰	3,033	89,443.17	0.00
8	301358	湖南裕能	2,023	86,766.47	0.00
9	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.00
10	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.00
11	688469	中芯集成	13,800	74,658.00	0.00
12	301260	格力博	3,121	73,749.23	0.00
13	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.00
14	688361	中科飞测	831	53,740.77	0.00
15	688531	日联科技	346	47,045.62	0.00
16	301325	曼恩斯特	364	39,293.80	0.00
17	688146	中船特气	1,011	38,549.43	0.00
18	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00



19	301301	川宁生物	3,574	32,023.04	0.00
20	601061	中信金属	4,016	30,441.28	0.00
21	001287	中电港	1,386	29,133.72	0.00
22	688576	西山科技	240	28,898.40	0.00
23	688352	颀中科技	2,361	28,497.27	0.00
24	688507	索辰科技	222	27,108.42	0.00
25	688582	N芯动	648	26,360.64	0.00
26	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
27	301303	真兰仪表	1,058	23,614.56	0.00
28	688552	航天南湖	956	22,466.00	0.00
29	688570	天玛智控	884	22,391.72	0.00
30	301307	美利信	687	21,887.82	0.00
31	688543	国科军工	410	21,750.50	0.00
32	301322	绿通科技	392	20,870.08	0.00
33	688458	美芯晟	221	20,057.96	0.00
34	688581	安杰思	163	19,238.89	0.00
35	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.00
36	301262	海看股份	692	17,646.00	0.00
37	688478	晶升股份	402	17,032.74	0.00
38	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00
39	301439	泓淋电力	949	16,038.10	0.00
40	688623	双元科技	178	15,448.62	0.00
41	301332	德尔玛	1,122	15,405.06	0.00
42	301399	英特科技	293	15,110.01	0.00
43	301408	华人健康	879	14,899.05	0.00
44	301305	朗坤环境	753	14,826.57	0.00
45	301397	C溯联	362	14,552.40	0.00
46	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00
47	688334	西高院	888	14,394.48	0.00
48	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
49	301210	N金杨	281	13,816.77	0.00

50	688512	慧智微	721	13,814.36	0.00
51	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
52	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00
53	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
54	688629	C华丰	708	13,161.72	0.00
55	688620	C安凯微	1,016	12,537.44	0.00
56	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
57	301345	涛涛车业	266	12,406.24	0.00
58	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
59	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
60	603135	中重科技	628	11,234.92	0.00
61	301225	恒勃股份	333	11,075.58	0.00
62	301429	森泰股份	499	10,488.98	0.00
63	601065	江盐集团	875	10,360.00	0.00
64	688631	C莱斯	336	10,036.32	0.00
65	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
66	301232	飞沃科技	165	9,639.30	0.00
67	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
68	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
69	301357	北方长龙	190	9,194.10	0.00
70	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
71	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
72	688429	C时创	346	8,833.38	0.00
73	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
74	301170	C锡南	250	8,732.50	0.00
75	301281	科源制药	337	8,458.70	0.00
76	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
77	601133	柏诚股份	664	8,140.64	0.00
78	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
79	301295	C美硕	215	7,755.05	0.00
80	300804	C广康	226	7,451.22	0.00

81	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
82	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
83	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
84	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
85	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
86	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
87	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
88	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
89	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
90	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
91	603172	万丰股份	122	1,967.86	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	600028	中国石化	13,666,624.80	0.20
2	600941	中国移动	12,901,165.00	0.19
3	600233	圆通速递	11,887,961.02	0.17
4	300750	宁德时代	11,126,831.68	0.16
5	600905	三峡能源	11,014,125.00	0.16
6	600732	爱旭股份	10,864,351.00	0.16
7	601899	紫金矿业	9,445,729.00	0.14
8	601607	上海医药	9,221,380.00	0.13
9	688223	晶科能源	8,949,844.63	0.13
10	000983	山西焦煤	8,455,791.80	0.12
11	600754	锦江酒店	7,955,956.00	0.12
12	601818	光大银行	7,697,149.00	0.11
13	601699	潞安环能	7,406,651.00	0.11

14	600875	东方电气	7,204,278.00	0.10
15	601872	招商轮船	7,163,539.00	0.10
16	000617	中油资本	6,829,353.00	0.10
17	000858	五 粮 液	6,402,130.89	0.09
18	600519	贵州茅台	5,865,600.00	0.09
19	002594	比亚迪	5,863,710.00	0.09
20	688303	大全能源	5,606,642.38	0.08

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	600900	长江电力	14,336,740.50	0.21
2	002602	世纪华通	13,827,937.28	0.20
3	300750	宁德时代	12,156,277.62	0.18
4	600519	贵州茅台	9,249,064.00	0.13
5	002008	大族激光	7,815,536.60	0.11
6	603882	金域医学	7,636,896.28	0.11
7	000858	五 粮 液	7,230,252.84	0.11
8	688169	石头科技	7,054,183.80	0.10
9	002600	领益智造	6,771,537.00	0.10
10	002594	比亚迪	6,601,649.00	0.10
11	601818	光大银行	6,047,428.00	0.09
12	000333	美的集团	5,376,986.00	0.08
13	300595	欧普康视	5,157,733.18	0.07
14	300529	健帆生物	4,898,178.00	0.07
15	601966	玲珑轮胎	4,700,080.00	0.07
16	300760	迈瑞医疗	4,624,681.68	0.07

17	601318	中国平安	4,430,815.00	0.06
18	300059	东方财富	4,389,211.00	0.06
19	002415	海康威视	4,143,528.00	0.06
20	002371	北方华创	4,039,021.00	0.06

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

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	466,274,424.17
卖出股票收入（成交）总额	379,489,685.00

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

在实际进行投资运作时，由于ETF基金一般需要满仓操作，同时基金需要备出一定的现金头寸应对申赎及费用等支付，因此仓位无法达到100%，这时基金仓位就存在裸露风险，通过套期保值方式买入期货合约，可以使基金仓位达到100%，避免仓位暴露的风险。股指期货在买入时总持仓量采用双限制策略，一是限制基金组合中总的股指期货持仓量不能超过向中金所申请并获批的套保总量；二是限制基金组合持有的股指期货合约

价值加上基金组合中其他有价证券市值占基金净资产的比例不能超过法规规定的上限，并在股指期货的交易过程中严格遵守基金合同的约束和中金所的规定。根据本基金的基金合同、投资范围、投资目标、投资策略以及对市场走势研判的基础上，结合基金日常的申购赎回情况，制定套期保值交易的合理期限。套期保值的期限一般不超过股指期货当前的最远到期日合约，即次季合约。按照交易月份相近的原则，综合考虑并动态跟踪不同到期日的期货合约的流动性、价差状况和展期风险等因素，选择合适月份的期货合约进行开仓和展期交易来实现远期套保的目的。另外对于交割月的股指期货，通常情况下，最晚在合约交割日进行平仓，尽量避免进行交割。在未来的股指期货交易过程中，本基金将严格遵守《证券投资基金参与股指期货交易指引》，以及中国金融期货交易所颁布的《中国金融期货交易所交易规则》、《中国金融期货交易所套期保值与套利交易管理办法》等相关规定，以套期保值为主要目的参与股指期货，严格控制交易中的各种风险。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.12 投资组合报告附注

**7.12.1 本基金投资的前十名证券发行主体中，【兴业银行股份有限公司】**分别于**2022年09月09日、2022年09月28日**收到中国银行保险监督管理委员会出具公开处罚的通报，于**2023年06月14日**收到中国银行保险监督管理委员会上海监管局出具责令改正、公开处罚的通报；**【招商银行股份有限公司】**于**2022年08月31日**收到中国人民银行出具公开批评、公开处罚的通报，于**2022年09月09日**收到中国银行保险监督管理委员会出具公开处罚的通报；**【中国平安保险(集团)股份有限公司】**于**2022年08月22日**收到国家外汇管理局深圳市分局出具罚款处罚、警告、责令改正的通报。本基金对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

**7.12.2 基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。**

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	278,454.92
2	应收清算款	-
3	应收股利	43,706.30

4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	39,152.59
7	待摊费用	75,616.24
8	其他	-
9	合计	436,930.05

#### 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	301486	致尚科技	277,921.20	0.00	新股未上市
2	301395	仁信新材	138,629.28	0.00	新股未上市
3	301292	海科新源	116,421.76	0.00	新股未上市
4	688472	阿特斯	106,687.44	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

持有人户数	户均持有的基金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		联接基金	
		持有份额	占总	持有份额	占总	持有份额	占

(户)			份 额 比 例		份 额 比 例		总 份 额 比 例
5,020	1,329,025.80	22,515,416.00	0.34%	82,107,080.00	1.23%	6,567,087,000.00	98.43%

### 8.2 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	招商证券股份有限公司一天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金	6,567,087,000.00	98.43%
2	中国平安人寿保险股份有限公司—投连—团体退休金平衡	4,446,900.00	0.07%
3	中国平安财产保险股份有限公司—传统—普通保险产品	3,696,000.00	0.06%
4	广发证券股份有限公司	2,851,800.00	0.04%
5	中信证券股份有限公司	2,668,823.00	0.04%
6	方正证券股份有限公司	2,333,596.00	0.03%
7	刘敬镔	1,853,500.00	0.03%
8	平安资管—中国银行—平安资产安享2号资产管理产品	1,761,400.00	0.03%
9	项丹妮	1,108,200.00	0.02%
10	范志华	1,000,000.00	0.01%

注：持有人为场内持有人。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况



期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

#### 8.4 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、基金投资和研发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

### §9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2019年12月05日)基金份额总额	236,709,496.00
本报告期期初基金份额总额	6,638,709,496.00
本报告期基金总申购份额	264,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	231,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	6,671,709,496.00

### §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。

本报告期无涉及公募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

本报告期内，基金托管人及其托管业务高级管理人员未受稽查或处罚。

#### 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	
安信证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
第一创业证券	2	-	-	-	-	-
东方财富证券	2	451,461,203.57	54.51%	194,717.59	54.51%	-
方正证券	3	-	-	-	-	-

光大证券	3	19,024,507.49	2.30%	8,205.18	2.30%	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	2	-	-	-	-	-
恒泰证券	1	-	-	-	-	-
华安证券	2	-	-	-	-	-
华林证券	2	166,153,533.43	20.06%	71,661.85	20.06%	-
华泰证券	3	-	-	-	-	-
开源证券	4	-	-	-	-	-
天风证券	2	35,804,137.70	4.32%	15,442.68	4.32%	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	5	96,120.00	0.01%	22.25	0.01%	-
中金财富	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	155,725,773.39	18.80%	67,162.12	18.80%	-

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：恒泰证券上海交易单元、华泰证券上海交易单元、华泰证券深圳交易单元。

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
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
第一创业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	3,380,351.92	77.36%	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华林证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	553,123.16	12.66%	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	436,300.00	9.98%	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-

## 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	2023-01-11
2	天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金2022年第4季度报告	中国证监会规定媒介	2023-01-28
3	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	2023-03-15
4	天弘基金管理有限公司关于	中国证监会规定媒介	2023-03-24

	防范不法分子冒用公司名义进行诈骗活动的风险提示		
5	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	2023-03-29
6	天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金2022年年度报告	中国证监会规定媒介	2023-03-31
7	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
8	天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金2023年第一季度报告	中国证监会规定媒介	2023-04-23
9	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会规定媒介	2023-05-12
10	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会规定媒介	2023-05-17
11	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	2023-06-08

## §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

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% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
联接基金	1	20230101-20230630	6,535,354,500.00	488,143,600.00	456,411,100.00	6,567,087,000.00	98.43%

#### 产品特有风险

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：

（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；

（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；

（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；

（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；

（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。

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。

## 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沪深300交易型开放式指数证券投资基金募集的文件
- 2、天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金合同
- 3、天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金托管协议
- 4、天弘沪深300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

### 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](http://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