

天弘沪深 300 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:招商证券股份有限公司

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。

基金托管人招商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01月01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	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	13
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.....	15
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	15
§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	16
6.1 审计报告基本信息.....	16
6.2 审计报告的基本内容	16
§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	22
7.4 报表附注	24
§8 投资组合报告	84
8.1 期末基金资产组合情况.....	84
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	85
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	86
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	100
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	102
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	102
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	102
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	102
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	102
8.10 本基金投资股指期货的投资政策.....	102

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	103
8.12 投资组合报告附注	103
§9 基金份额持有人信息	104
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	104
9.2 期末上市基金前十名持有人	105
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	105
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	106
§10 开放式基金份额变动	106
§11 重大事件揭示	106
11.1 基金份额持有人大会决议	106
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	106
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	107
11.4 基金投资策略的改变	107
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	107
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	107
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	107
11.8 其他重大事件	110
§12 影响投资者决策的其他重要信息	112
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	112
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	113
§13 备查文件目录	113
13.1 备查文件目录	113
13.2 存放地点	113
13.3 查阅方式	114

§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	8,387,709,496.00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
	联系电话	022-83310208
	电子邮箱	service@thfund.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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.thfund.com.cn

基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公地址
------------	------------------

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	中国上海市浦东新区东育路588号前滩中心42楼
注册登记机构	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	2023年	2022年	2021年
本期已实现收益	-97,417,452.78	-124,523,485.07	541,713,239.85
本期利润	-759,673,857.76	-1,376,061,575.78	-177,737,101.86
加权平均基金份额 本期利润	-0.1072	-0.2317	-0.0356
本期加权平均净值 利润率	-10.38%	-21.16%	-2.70%
本期基金份额净值 增长率	-9.41%	-20.11%	-3.45%
3.1.2 期末数据和指标	2023年末	2022年末	2021年末
期末可供分配利润	-513,925,380.33	240,482,933.76	1,360,920,016.72
期末可供分配基金 份额利润	-0.0613	0.0362	0.2559
期末基金资产净值	7,873,784,115.67	6,879,192,429.76	6,898,384,443.75
期末基金份额净值	0.9387	1.0362	1.2970
3.1.3 累计期末指标	2023年末	2022年末	2021年末

基金份额累计净值增长率	-6.13%	3.62%	29.70%
-------------	--------	-------	--------

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	-6.87%	0.79%	-7.00%	0.79%	0.13%	0.00%
过去六个月	-9.68%	0.85%	-10.71%	0.85%	1.03%	0.00%
过去一年	-9.41%	0.85%	-11.38%	0.85%	1.97%	0.00%
过去三年	-30.13%	1.11%	-34.16%	1.11%	4.03%	0.00%
自基金合同生效日起至 今	-6.13%	1.19%	-10.88%	1.20%	4.75%	-0.01%

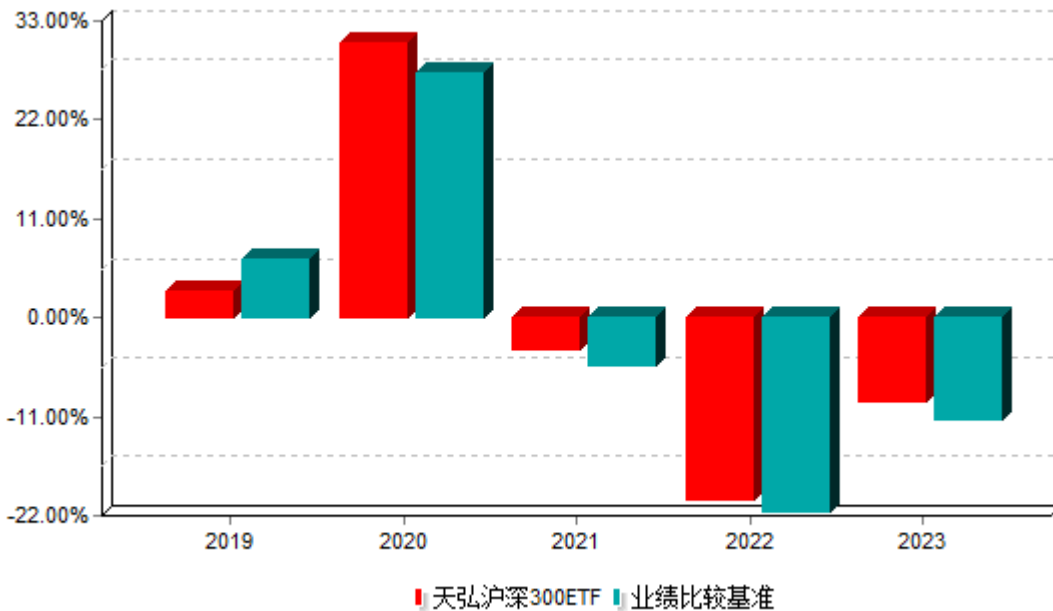
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2019年12月05日-2023年12月31日)



- 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。

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2019年12月05日生效。基金合同生效当年2019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

本基金过去三年未进行利润分配，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		
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遵规守信情况的说明

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

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，争取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股息事件，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12月31日，本基金份额净值为0.9387元，本报告期份额净值增长率-9.41%，同期业绩比较基准增长率-11.38%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前股票市场已回调到较低位。从中长期看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，此次7月政治局会议以来的政策频出可以说是政

策底的再确认。当前各种政策仍在不断接续。政策实施效果上，随着量变逐渐积累到质变，我们认为后续大概率能够看到政策实施的效果。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。

展望2024年的宏观经济和股票市场，我们认为有以下几个方面值得期待：

1、经济修复的势头有待观察，可能较今年更强：在持续的地产政策下，2024年地产的拖累有望缓解。2024年政策将继续合力配合，货币政策精准有效，降准降息仍可期；财政政策适度加力，提质增效，具体观察政策稳增长加力的情况。

2、美联储开始讨论降息，市场已经开始预期降息交易。若2024年美联储进入降息趋势，那么国内货币政策空间进一步打开，外资流入，助力中国国内资产表现。

3、悲观预期已经使股票市场回落到比较低的区间，如果磨底时间继续拉长，那么底部会更加坚实。一旦宏观层面有一定催化剂，那么市场反弹力度是值得期待的。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

员会成员由公司分管投资的高级管理人员、督察长、首席风控官、分管估值业务高级管理人员以及研究管理人员组成。

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

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

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

报告期内，本基金管理人未与任何第三方签订与估值相关的定价服务协议。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内本基金管理人无应说明预警信息。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人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 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24919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	天弘沪深300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 我们审计了天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“天弘沪深300ETF”)的财务报表，包括2023年12月31日的资产负债表，2023年度的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。(二)我们的意见 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了天弘沪深300ETF2023年12月31日的财务状况以及2023年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于天弘沪深300ETF，并履行了职业道德方面的其他

	责任。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	无
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>天弘沪深300ETF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沪深300ETF的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算天弘沪深300ETF、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沪深300ETF的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:(一)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风</p>

	<p>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，就可能导致对天弘沪深300ETF持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致天弘沪深300ETF不能持续经营。(五)评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	张振波	林佳璐
会计师事务所的地址	中国上海市浦东新区东育路588号前滩中心42楼	
审计报告日期	2024-03-27	

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：天弘沪深300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	上年度末 2022年12月31日
资产：			

货币资金	7.4.7.1	11,909,031.86	16,081,587.78
结算备付金		476,132.10	9,134,809.54
存出保证金		714,040.90	2,012,939.76
交易性金融资产	7.4.7.2	7,870,025,029.84	6,856,842,489.45
其中：股票投资		7,870,025,029.84	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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收清算款		51,175,997.68	91,963.13
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	82,577.45	63,583.26
资产总计		7,934,382,809.83	6,884,227,372.92
负债和净资产	附注号	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		55,312,022.98	295,819.33
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		3,236,536.55	2,916,275.84
应付托管费		647,307.34	583,255.18
应付销售服务费		-	-

应付投资顾问费		-	-
应交税费		5,023.96	2,204.29
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	1,397,803.33	1,237,388.52
负债合计		60,598,694.16	5,034,943.16
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	8,387,709,496.00	6,638,709,496.00
未分配利润	7.4.7.8	-513,925,380.33	240,482,933.76
净资产合计		7,873,784,115.67	6,879,192,429.76
负债和净资产总计		7,934,382,809.83	6,884,227,372.92

注：报告截止日2023年12月31日，基金份额净值0.9387元，基金份额总额8,387,709,496.00份。

7.2 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12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年01月01日至 2023年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至 2022年12月31日
一、营业总收入		-713,084,535.80	-1,334,579,926.49
1.利息收入		210,343.74	544,729.11
其中：存款利息收入	7.4.7.9	210,343.74	544,729.11
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）		-53,062,358.11	-83,173,926.50

其中：股票投资收益	7.4.7.10	-234,340,490.41	-232,528,140.87
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	601,751.60	3,867,998.62
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	107,241.77	-6,127,289.63
股利收益	7.4.7.15	176,726,934.82	148,418,455.24
其他投资收益		3,842,204.11	3,195,050.14
3.公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	7.4.7.16	-662,256,404.98	-1,251,538,090.71
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	2,023,883.55	-412,638.39
减：二、营业总支出		46,589,321.96	41,481,649.29
1.管理人报酬		36,571,442.08	32,523,922.40
2.托管费		7,314,288.40	6,504,784.54
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		19,304.96	11,507.12
8.其他费用	7.4.7.19	2,684,286.52	2,441,435.23
三、利润总额（亏损总额以 “-”号填列）		-759,673,857.76	-1,376,061,575.78
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		-759,673,857.76	-1,376,061,575.78

五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-759,673,857.76	-1,376,061,575.78

7.3 净资产变动表

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12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01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	6,638,709,496.00	240,482,933.76	6,879,192,429.76
二、本期期初净资产	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）	1,749,000,000.00	-754,408,314.09	994,591,685.91
（一）、综合收益总额	-	-759,673,857.76	-759,673,857.76
（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）	1,749,000,000.00	5,265,543.67	1,754,265,543.67
其中：1.基金申购款	2,142,000,000.00	19,811,616.26	2,161,811,616.26
2.基金赎回款	-393,000,000.00	-14,546,072.59	-407,546,072.59
（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	8,387,709,496.00	-513,925,380.33	7,873,784,115.67
项目	上年度可比期间 2022年01月01日至2022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	5,318,709,496.00	1,579,674,947.75	6,898,384,443.75
二、本期期初净资产	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）	1,320,000,000.00	-1,339,192,013.99	-19,192,013.99
（一）、综合收益总额	-	-1,376,061,575.78	-1,376,061,575.78
（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）	1,320,000,000.00	36,869,561.79	1,356,869,561.79
其中：1.基金申购款	2,139,000,000.00	131,503,810.80	2,270,503,810.80
2.基金赎回款	-819,000,000.00	-94,634,249.01	-913,634,249.01
（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	6,638,709,496.00	240,482,933.76	6,879,192,429.76

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)。本基金可根据相关法律法规和基金合同的约定,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。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。

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年度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年度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。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产

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

特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

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

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的业务模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产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。

根据中国证监会于2024年颁布的修订后的《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>》,本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露,这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

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	上年度末 2022年12月31日
活期存款	11,909,031.86	16,081,587.78
等于：本金	11,902,557.23	16,072,571.91
加：应计利息	6,474.63	9,015.87
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	11,909,031.86	16,081,587.78

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	9,394,298,111.48	-	7,870,025,029.84	-1,524,273,081.64
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	9,394,298,111.48	-	7,870,025,029.84	-1,524,273,081.64
项目	上年度末 2022年12月31日			

	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	7,718,647,966.1 1	-	6,856,842,489.4 5	-861,805,476.66
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	7,718,647,966.1 1	-	6,856,842,489.4 5	-861,805,476.66

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

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	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-
项目	上年度末 2022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	11,923,800.00	-	-	-
--股指期货	11,923,800.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	11,923,800.00	-	-	-

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

本基金本报告期末及上年度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

本基金本报告期末及上年度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

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
应收利息	-	-
其他应收款	82,577.45	63,583.26
待摊费用	-	-
合计	82,577.45	63,583.26

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	上年度末 2022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	474,647.91	401,763.25
其中：交易所市场	474,647.91	401,763.25
银行间市场	-	-
应付利息	-	-

预提费用	340,000.00	340,000.00
其他应付款	583,155.42	495,625.27
合计	1,397,803.33	1,237,388.52

7.4.7.7 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12月31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	2,142,000,000.00	2,142,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-393,000,000.00	-393,000,000.00
本期末	8,387,709,496.00	8,387,709,496.00

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	1,567,779,673.24	-1,327,296,739.48	240,482,933.76
本期期初	1,567,779,673.24	-1,327,296,739.48	240,482,933.76
本期利润	-97,417,452.78	-662,256,404.98	-759,673,857.76
本期基金份额交易产生的变动数	423,925,264.11	-418,659,720.44	5,265,543.67
其中：基金申购款	515,981,249.32	-496,169,633.06	19,811,616.26
基金赎回款	-92,055,985.21	77,509,912.62	-14,546,072.59
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,894,287,484.57	-2,408,212,864.90	-513,925,380.33

7.4.7.9 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 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日

活期存款利息收入	170,224.64	431,450.05
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	32,010.82	98,033.91
其他	8,108.28	15,245.15
合计	210,343.74	544,729.11

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01月01日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-215,371,526.38	-206,942,379.70
股票投资收益——赎回差价收入	-18,968,964.03	-25,585,761.17
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	-234,340,490.41	-232,528,140.87

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01月01日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日
卖出股票成交总额	876,590,123.14	1,213,878,701.29
减：卖出股票成本总额	1,090,015,153.27	1,417,912,688.76
减：交易费用	1,946,496.25	2,908,392.23
买卖股票差价收入	-215,371,526.38	-206,942,379.70

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	上年度可比期间
----	----	---------

	2023年01月01日至2023年 12月31日	2022年01月01日至2022年 12月31日
赎回基金份额对价总额	407,546,072.59	913,634,249.01
减：现金支付赎回款总额	161,359,456.59	364,678,813.01
减：赎回股票成本总额	265,155,580.03	574,541,197.17
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	-18,968,964.03	-25,585,761.17

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日
债券投资收益——利息收入	543.19	2,446.97
债券投资收益——买卖债券 （债转股及债券到期兑付） 差价收入	601,208.41	3,865,551.65
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	601,751.60	3,867,998.62

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月 31日
卖出债券（债转股 及债券到期兑付） 成交总额	3,959,126.42	26,090,603.65

减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	3,357,200.00	22,222,200.00
减：应计利息总额	559.62	2,725.41
减：交易费用	158.39	126.59
买卖债券差价收入	601,208.41	3,865,551.65

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间未取得资产支持证券投资收益。

7.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间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

本基金本报告期及上年度可比期间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01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日
期货投资	107,241.77	-6,127,289.63

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023 年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022 年12月31日
股票投资产生的股利收益	176,726,934.82	148,418,455.24
其中：证券出借权益补偿收入	1,412,075.31	1,487,869.16
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	176,726,934.82	148,418,455.24

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01月01日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12 月31日
1.交易性金融资产	-662,467,604.98	-1,252,044,970.71
——股票投资	-662,467,604.98	-1,252,044,970.71
——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	506,880.00
——权证投资	-	-
——期货投资	211,200.00	506,880.00
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	-662,256,404.98	-1,251,538,090.71

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022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	2,023,883.55	-412,638.39
延期合约递延费收入	-	-
合计	2,023,883.55	-412,638.39

7.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内及上年度可比期间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01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日
审计费用	120,000.00	120,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
指数使用费	2,194,286.52	1,951,435.23
IOPV计算发布费	100,000.00	100,000.00
ETF登记结算费	150,000.00	150,000.00
合计	2,684,286.52	2,441,435.23

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
招商证券股份有限公司	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
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。

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01月01日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31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	81,846,478.64	3.20%	22,299,987.88	0.73%

7.4.10.1.2 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。

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01月01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
招商证券	20,117.24	1.83%	19,975.40	4.21%

股份有限公司				
关联方名称	上年度可比期间 2022年01月01日至2022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
招商证券股份有限公司	5,158.05	0.39%	125.09	0.03%

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01月01日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	36,571,442.08	32,523,922.40
其中:应支付销售机构的客户维护费	76,041.04	-
应支付基金管理人的净管理费	36,495,401.04	32,523,922.40

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01月01日至2023 年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022 年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	7,314,288.40	6,504,784.54

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。

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。

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。

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

单位：人民币元

本期 2023年01月01日至2023年12月31日						
关联方名称	交易金额	费率区间(%)	加权平均费率(%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
招商证券股份有限公司	11,464,033.00	3.00~5.59	3.25	14,074.13	-	-
上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日						
关联方名称	交易金额	费率区间(%)	加权平均费率(%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
-	-	-	-	-	-	-

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。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2023年12月31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	7,960,830,100.00	94.91%	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。

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01月01日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31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	11,909,031.86	170,224.64	16,081,587.78	431,450.05

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。

7.4.10.7 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12月31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	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
招商证券股份有限公司	688653	康希通信	网下申购	6,478	68,019.00
上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31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
招商证券股份有限公司	688375	国博电子	网下申购	6,110	433,076.80

公司					
----	--	--	--	--	--

7.4.10.8 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1,680,831股（上年度末：1,365,331股），估值总额为人民币22,926,534.84元（上年度末：18,158,902.30元），占基金净资产的比例为0.29%（上年度末：0.26%）；持有君正集团的股票0股（上年度末：1,240,500股），估值总额为人民币0.00元（上年度末：4,949,595.00元），占基金净资产的比例为0.00%（上年度末：0.07%）；持有恒生电子的股票688,199股（上年度末：560,399股），估值总额为人民币19,792,603.24元（上年度末：22,673,743.54元），占基金净资产的比例为0.25%（上年度末：0.33%）。

7.4.11 利润分配情况--固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期无利润分配事项。

7.4.12 期末（2023年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688563	航材股份	2023-07-12	6个月	科创板打新限售	78.99	60.49	1,501	118,563.99	90,795.49	-
688548	广钢气体	2023-08-08	6个月	科创板打新限售	9.87	12.75	4,048	39,953.76	51,612.00	-
603296	华勤技术	2023-08-01	6个月	新股锁定	80.80	77.75	593	47,914.40	46,105.75	-
301526	C国际复	2023-12-19	6个月	创业板打新限	2.66	4.45	9,723	25,863.18	43,267.35	-

				售							
301487	盟固利	2023-08-01	6个月	创业板打新限售	5.32	40.96	867	4,612.44	35,512.32	-	
688549	中巨芯	2023-08-30	6个月	科创板打新限售	5.18	8.09	4,294	22,242.92	34,738.46	-	
301348	蓝箭电子	2023-08-01	6个月	创业板打新限售	18.08	44.57	613	11,083.04	27,321.41	-	
688702	盛科通信	2023-09-06	6个月	科创板打新限售	42.66	48.18	549	23,420.34	26,450.82	-	
688582	芯动联科	2023-06-21	6个月	科创板打新限售	26.74	38.67	648	17,327.52	25,058.16	-	
301559	中集环科	2023-09-26	6个月	创业板打新限售	24.22	18.24	1,315	31,849.30	23,985.60	-	
301486	致尚科技	2023-06-30	6个月	创业板打新限售	57.66	47.25	482	27,792.12	22,774.50	-	
688652	京仪装备	2023-11-22	6个月	科创板打新限售	31.95	52.25	416	13,291.20	21,736.00	-	

301525	儒竞科技	2023-08-23	6个月	创业板打新限售	99.57	81.46	266	26,485.62	21,668.36	-
301498	乖宝宠物	2023-08-09	6个月	创业板打新限售	39.99	38.81	554	22,154.46	21,500.74	-
301371	敷尔佳	2023-07-24	6个月	创业板打新限售	55.68	37.58	564	31,403.52	21,195.12	-
301370	国科恒泰	2023-07-03	6个月	创业板打新限售	13.39	16.01	1,240	16,603.60	19,852.40	-
301421	波长光电	2023-08-16	6个月	创业板打新限售	29.38	59.37	332	9,754.16	19,710.84	-
301558	三态股份	2023-09-21	6个月	创业板打新限售	7.33	13.40	1,458	10,687.14	19,537.20	-
688627	精智达	2023-07-11	6个月	科创板打新限售	46.77	87.72	222	10,382.94	19,473.84	-
688591	泰凌微	2023-08-18	6个月	科创板打新限售	24.98	28.02	681	17,011.38	19,081.62	-
300904	威力	2023-08-02	6个	创业	35.41	61.53	304	10,764.64	18,705.12	-

	传动		月	板打 新限售							
3014 88	豪恩 汽电	2023- 06-26	6个 月	创业 板打 新限售	39.78	69.09	262	10,42 2.36	18,10 1.58	-	
3013 81	赛维 时代	2023- 07-05	6个 月	创业 板打 新限售	20.45	29.69	571	11,67 6.95	16,95 2.99	-	
3011 72	君逸 数码	2023- 07-19	6个 月	创业 板打 新限售	31.33	38.16	438	13,72 2.54	16,71 4.08	-	
3015 09	金凯 生科	2023- 07-26	6个 月	创业 板打 新限售	56.56	62.23	266	15,04 4.96	16,55 3.18	-	
6886 12	威迈 斯	2023- 07-19	6个 月	科创 板打 新限售	47.29	37.97	422	19,95 6.38	16,02 3.34	-	
6010 96	宏盛 华源	2023- 12-15	6个 月	新股 锁定	1.70	4.06	3,918	6,66 0.60	15,90 7.08	-	
3013 93	昊帆 生物	2023- 07-05	6个 月	创业 板打 新限售	67.68	59.37	260	17,59 6.80	15,43 6.20	-	
6010 83	锦江 航运	2023- 11-28	6个 月	新股 锁定	11.25	11.07	1,263	14,20 8.75	13,98 1.41	-	
3015 10	固高 科技	2023- 08-04	6个 月	创业 板打	12.00	35.01	396	4,75 2.00	13,86 3.96	-	

				新限售						
301507	民生健康	2023-08-24	6个月	创业板打新限售	10.00	15.85	851	8,510.00	13,488.35	-
301210	金杨股份	2023-06-21	6个月	创业板打新限售	57.88	45.48	281	16,264.28	12,779.88	-
301566	N达利	2023-12-22	6个月	创业板打新限售	8.90	22.14	576	5,126.40	12,752.64	-
301456	盘古智能	2023-07-06	6个月	创业板打新限售	37.96	30.39	407	15,449.72	12,368.73	-
688602	康鹏科技	2023-07-13	6个月	科创板打新限售	8.66	11.06	1,066	9,231.56	11,789.96	-
688719	爱科赛博	2023-09-20	6个月	科创板打新限售	69.98	60.10	194	13,576.12	11,659.40	-
301550	斯菱股份	2023-09-06	6个月	创业板打新限售	37.56	43.57	260	9,765.60	11,328.20	-
301292	海科新源	2023-06-29	6个月	创业板打新限售	19.99	19.35	583	11,654.17	11,281.05	-

301508	中机认检	2023-11-23	6个月	创业板打新限售	16.82	26.68	419	7,047.58	11,178.92	-
301251	威尔高	2023-08-30	6个月	创业板打新限售	28.88	34.59	321	9,270.48	11,103.39	-
688592	司南导航	2023-08-07	6个月	科创板打新限售	50.50	50.53	216	10,908.00	10,914.48	-
301499	维科精密	2023-07-13	6个月	创业板打新限售	19.50	28.93	371	7,234.50	10,733.03	-
688603	天承科技	2023-06-30	6个月	科创板打新限售	55.00	74.14	140	7,700.00	10,379.60	-
688653	康希通信	2023-11-10	6个月	科创板打新限售	10.50	15.99	648	6,804.00	10,361.52	-
301528	多浦乐	2023-08-17	6个月	创业板打新限售	71.80	68.91	148	10,626.40	10,198.68	-
301329	信音电子	2023-07-05	6个月	创业板打新限售	21.00	22.23	458	9,618.00	10,181.34	-
301261	恒工	2023-06-29	6个	创业	36.90	50.85	198	7,306.20	10,068.30	-

	精密		月	板打 新限售							
3012 02	朗威 股份	2023- 06-28	6个 月	创业 板打 新限售	25.82	31.80	306	7,90 0.92	9,73 0.80	-	
3013 95	仁信 新材	2023- 06-21	6个 月	创业 板打 新限售	26.68	18.69	520	13,87 3.60	9,71 8.80	-	
6887 16	中研 股份	2023- 09-13	6个 月	科创 板打 新限售	29.66	36.39	267	7,91 9.22	9,71 6.13	-	
3014 13	安培 龙	2023- 12-11	6个 月	创业 板打 新限售	33.25	58.19	164	5,45 3.00	9,54 3.16	-	
3015 00	飞南 资源	2023- 09-13	6个 月	创业 板打 新限售	23.97	20.89	455	10,90 6.35	9,50 4.95	-	
3014 18	协昌 科技	2023- 08-10	6个 月	创业 板打 新限售	51.88	50.20	189	9,80 5.32	9,48 7.80	-	
3015 16	中远 通	2023- 12-01	6个 月	创业 板打 新限售	6.87	15.51	604	4,14 9.48	9,36 8.04	-	
3012 72	英华 特	2023- 07-06	6个 月	创业 板打 新限售	51.39	53.38	173	8,89 0.47	9,23 4.74	-	

				售							
301469	恒达新材	2023-08-10	6个月	创业板打新限售	36.58	33.09	275	10,059.50	9,099.75	-	
301519	舜禹股份	2023-07-19	6个月	创业板打新限售	20.93	20.21	442	9,251.06	8,932.82	-	
301518	长华化学	2023-07-26	6个月	创业板打新限售	25.75	23.01	385	9,913.75	8,858.85	-	
301568	思泰克	2023-11-21	6个月	创业板打新限售	23.23	35.58	246	5,714.58	8,752.68	-	
301520	万邦医药	2023-09-18	6个月	创业板打新限售	67.88	52.74	160	10,860.80	8,438.40	-	
301459	丰茂股份	2023-12-06	6个月	创业板打新限售	31.90	39.84	208	6,635.20	8,286.72	-	
688720	艾森股份	2023-11-29	6个月	科创板打新限售	28.03	49.84	165	4,624.95	8,223.60	-	
688573	信宇人	2023-08-09	6个月	科创板打新限售	23.68	28.80	285	6,748.80	8,208.00	-	

301489	思泉新材	2023-10-16	6个月	创业板打新限售	41.66	64.11	128	5,332.48	8,206.08	-
688651	盛邦安全	2023-07-19	6个月	科创板打新限售	39.90	46.05	178	7,102.20	8,196.90	-
301517	陕西华达	2023-10-09	6个月	创业板打新限售	26.87	43.69	185	4,970.95	8,082.65	-
301578	C辰奕	2023-12-21	6个月	创业板打新限售	48.94	68.32	118	5,774.92	8,061.76	-
301548	崇德科技	2023-09-11	6个月	创业板打新限售	66.80	58.99	136	9,084.80	8,022.64	-
688657	浩辰软件	2023-09-25	6个月	科创板打新限售	103.40	78.23	101	10,443.40	7,901.23	-
688646	逸飞激光	2023-07-21	6个月	科创板打新限售	46.80	36.07	219	10,249.20	7,899.33	-
688671	碧兴物联	2023-08-02	6个月	科创板打新限售	36.12	34.30	226	8,163.12	7,751.80	-
688693	锆威	2023-08-10	6个月	科创	40.83	43.41	178	7,267.74	7,726.98	-

	特		月	板打 新限售						
6032 75	众辰 科技	2023- 08-16	6个 月	新股 锁定	49.97	39.70	193	9,64 4.21	7,66 2.10	-
3015 33	威马 农机	2023- 08-07	6个 月	创业 板打 新限售	29.50	33.16	225	6,63 7.50	7,46 1.00	-
6030 62	麦加 芯彩	2023- 10-31	6个 月	新股 锁定	58.08	57.81	126	7,31 8.08	7,28 4.06	-
3015 55	惠柏 新材	2023- 10-24	6个 月	创业 板打 新限售	22.88	32.44	224	5,12 5.12	7,26 6.56	-
3015 05	苏州 规划	2023- 07-12	6个 月	创业 板打 新限售	26.35	35.81	194	5,11 1.90	6,94 7.14	-
3015 29	福赛 科技	2023- 08-31	6个 月	创业 板打 新限售	36.60	37.88	182	6,66 1.20	6,89 4.16	-
3015 15	港通 医疗	2023- 07-13	6个 月	创业 板打 新限售	31.16	28.27	230	7,16 6.80	6,50 2.10	-
6886 48	中邮 科技	2023- 11-06	6个 月	科创 板打 新限售	15.18	21.43	303	4,59 9.54	6,49 3.29	-
6884 50	光格 科技	2023- 07-17	6个 月	科创 板打	53.09	36.42	167	8,86 6.03	6,08 2.14	-

				新限售						
603004	C鼎龙	2023-12-20	6个月	新股锁定	16.80	31.19	195	3,276.00	6,082.05	-
603270	金帝股份	2023-08-25	6个月	新股锁定	21.77	29.58	195	4,245.15	5,768.10	-
603119	浙江荣泰	2023-07-21	6个月	新股锁定	15.32	23.87	226	3,462.32	5,394.62	-
603107	上海汽配	2023-10-25	6个月	新股锁定	14.23	18.19	292	4,155.16	5,311.48	-
603193	润本股份	2023-10-09	6个月	新股锁定	17.38	16.66	303	5,266.14	5,047.98	-
001306	夏厦精密	2023-11-09	6个月	新股锁定	53.63	75.36	64	3,432.32	4,823.04	-
001326	联域股份	2023-11-01	6个月	新股锁定	41.18	48.64	99	4,076.82	4,815.36	-
603075	热威股份	2023-09-01	6个月	新股锁定	23.10	23.31	182	4,204.20	4,242.42	-
001358	兴欣新材	2023-12-14	6个月	新股锁定	41.00	44.16	87	3,567.00	3,841.92	-
001239	永达股份	2023-12-04	6个月	新股锁定	12.05	19.92	189	2,277.45	3,764.88	-
603231	索宝蛋白	2023-12-06	6个月	新股锁定	21.29	21.53	161	3,427.69	3,466.33	-
603273	天元智能	2023-10-16	6个月	新股锁定	9.50	18.97	178	1,691.00	3,376.66	-
603276	恒兴新材	2023-09-18	6个月	新股锁定	25.73	24.88	134	3,447.82	3,333.92	-
603373	安邦护卫	2023-12-13	6个月	新股锁定	19.10	34.75	88	1,680.80	3,058.00	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股中需要限售的部分或作为战略投资者参与配售

获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

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

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	000001	平安银行	2024年01月05日- 2024年01月11日	9.39	43,200	405,648.00
2	000002	万科A	2024年01月02日- 2024年01月11日	10.46	605,600	6,334,576.0 0
3	000063	中兴通讯	2024年01月11日- 2024年01月11日	26.48	6,100	161,528.00
4	000069	华侨城A	2024年01月04日- 2024年01月11日	3.11	21,800	67,798.00
5	000100	TCL科技	2024年01月11日- 2024年01月11日	4.30	36,300	156,090.00
6	000157	中联重科	2024年01月11日- 2024年01月11日	6.53	9,600	62,688.00
7	000166	申万宏源	2024年01月11日- 2024年01月11日	4.44	17,400	77,256.00
8	000301	东方盛虹	2024年01月11日-	9.60	5,100	48,960.00

			2024年01月11日			
9	000333	美的集团	2024年01月11日- 2024年01月11日	54.63	9,500	518,985.00
10	000338	潍柴动力	2024年01月11日- 2024年01月11日	13.65	10,500	143,325.00
11	000408	藏格矿业	2024年01月03日- 2024年01月11日	25.34	49,700	1,259,398.00
12	000425	徐工机械	2024年01月11日- 2024年01月11日	5.46	13,700	74,802.00
13	000538	云南白药	2024年01月11日- 2024年01月11日	49.15	1,700	83,555.00
14	000568	泸州老窖	2024年01月02日- 2024年01月11日	179.42	4,900	879,158.00
15	000617	中油资本	2024年01月11日- 2024年01月11日	5.40	4,800	25,920.00
16	000625	长安汽车	2024年01月02日- 2024年01月11日	16.83	111,600	1,878,228.00
17	000651	格力电器	2024年01月11日- 2024年01月11日	32.17	8,700	279,879.00
18	000708	中信特钢	2024年01月11日- 2024年01月11日	14.04	1,900	26,676.00
19	000725	京东方A	2024年01月02日- 2024年01月11日	3.90	441,600	1,722,240.00
20	000768	中航西飞	2024年01月08日- 2024年01月11日	22.37	107,300	2,400,301.00
21	000776	广发证券	2024年01月02日- 2024年01月12日	14.29	25,800	368,682.00
22	000786	北新建材	2024年01月04日- 2024年01月12日	23.36	91,400	2,135,104.00
23	000792	盐湖股份	2024年01月11日- 2024年01月11日	15.95	10,500	167,475.00
24	000800	一汽解放	2024年01月02日-	8.50	66,600	566,100.00

			2024年01月11日			
25	000858	五粮液	2024年01月11日- 2024年01月11日	140.31	3,700	519,147.00
26	000876	新希望	2024年01月03日- 2024年01月11日	9.32	62,400	581,568.00
27	000877	天山股份	2024年01月11日- 2024年01月11日	6.68	3,300	22,044.00
28	000895	双汇发展	2024年01月11日- 2024年01月11日	26.71	3,000	80,130.00
29	000938	紫光股份	2024年01月11日- 2024年01月11日	19.35	4,400	85,140.00
30	000963	华东医药	2024年01月02日- 2024年01月11日	41.46	3,700	153,402.00
31	000977	浪潮信息	2024年01月02日- 2024年01月12日	33.20	91,700	3,044,440.0 0
32	000983	山西焦煤	2024年01月02日- 2024年01月11日	9.88	201,100	1,986,868.0 0
33	001289	龙源电力	2024年01月08日- 2024年01月08日	19.81	13,200	261,492.00
34	001979	招商蛇口	2024年01月02日- 2024年01月11日	9.53	120,600	1,149,318.0 0
35	002001	新和成	2024年01月11日- 2024年01月11日	16.96	2,900	49,184.00
36	002007	华兰生物	2024年01月11日- 2024年01月11日	22.13	2,100	46,473.00
37	002027	分众传媒	2024年01月11日- 2024年01月11日	6.32	19,500	123,240.00
38	002049	紫光国微	2024年01月11日- 2024年01月11日	67.45	1,300	87,685.00
39	002050	三花智控	2024年01月02日- 2024年01月11日	29.40	21,900	643,860.00
40	002074	国轩高科	2024年01月11日-	21.50	2,000	43,000.00

			2024年01月11日			
41	002129	TCL中环	2024年01月03日- 2024年01月11日	15.64	9,000	140,760.00
42	002142	宁波银行	2024年01月11日- 2024年01月11日	20.11	7,600	152,836.00
43	002179	中航光电	2024年01月11日- 2024年01月11日	39.00	2,000	78,000.00
44	002180	纳思达	2024年01月11日- 2024年01月12日	22.63	13,400	303,242.00
45	002202	金风科技	2024年01月11日- 2024年01月11日	8.00	5,300	42,400.00
46	002230	科大讯飞	2024年01月02日- 2024年01月12日	46.38	38,700	1,794,906.0 0
47	002236	大华股份	2024年01月11日- 2024年01月11日	18.45	3,800	70,110.00
48	002241	歌尔股份	2024年01月05日- 2024年01月11日	21.01	216,000	4,538,160.0 0
49	002252	上海莱士	2024年01月11日- 2024年01月11日	8.00	10,200	81,600.00
50	002271	东方雨虹	2024年01月11日- 2024年01月11日	19.20	3,800	72,960.00
51	002304	洋河股份	2024年01月11日- 2024年01月11日	109.90	1,100	120,890.00
52	002311	海大集团	2024年01月11日- 2024年01月11日	44.91	1,600	71,856.00
53	002352	顺丰控股	2024年01月11日- 2024年01月11日	40.40	4,700	189,880.00
54	002410	广联达	2024年01月10日- 2024年01月11日	17.14	39,500	677,030.00
55	002415	海康威视	2024年01月11日- 2024年01月11日	34.72	7,200	249,984.00
56	002459	晶澳科技	2024年01月03日-	20.72	6,500	134,680.00

			2024年01月11日			
57	002460	赣锋锂业	2024年01月11日- 2024年01月11日	42.80	2,100	89,880.00
58	002466	天齐锂业	2024年01月04日- 2024年01月12日	55.79	24,500	1,366,855.0 0
59	002475	立讯精密	2024年01月11日- 2024年01月11日	34.45	9,600	330,720.00
60	002493	荣盛石化	2024年01月03日- 2024年01月12日	10.35	200,900	2,079,315.0 0
61	002555	三七互娱	2024年01月02日- 2024年01月11日	18.81	137,900	2,593,899.0 0
62	002594	比亚迪	2024年01月03日- 2024年01月11日	198.00	10,300	2,039,400.0 0
63	002601	龙佰集团	2024年01月11日- 2024年01月11日	17.13	3,200	54,816.00
64	002603	以岭药业	2024年01月02日- 2024年01月11日	23.07	74,300	1,714,101.0 0
65	002648	卫星化学	2024年01月08日- 2024年01月11日	14.75	29,800	439,550.00
66	002709	天赐材料	2024年01月04日- 2024年01月11日	25.08	8,800	220,704.00
67	002714	牧原股份	2024年01月02日- 2024年01月11日	41.18	10,300	424,154.00
68	002736	国信证券	2024年01月11日- 2024年01月11日	8.54	5,500	46,970.00
69	002812	恩捷股份	2024年01月02日- 2024年01月11日	56.82	50,400	2,863,728.0 0
70	002938	鹏鼎控股	2024年01月11日- 2024年01月12日	22.32	6,200	138,384.00
71	003816	中国广核	2024年01月11日- 2024年01月11日	3.11	15,200	47,272.00
72	300014	亿纬锂能	2024年01月11日-	42.20	2,300	97,060.00

			2024年01月11日			
73	300015	爱尔眼科	2024年01月11日- 2024年01月11日	15.82	9,000	142,380.00
74	300033	同花顺	2024年01月03日- 2024年01月03日	156.87	3,200	501,984.00
75	300059	东方财富	2024年01月03日- 2024年01月11日	14.04	29,500	414,180.00
76	300122	智飞生物	2024年01月11日- 2024年01月11日	61.11	2,300	140,553.00
77	300124	汇川技术	2024年01月11日- 2024年01月11日	63.14	4,100	258,874.00
78	300142	沃森生物	2024年01月04日- 2024年01月12日	23.51	6,400	150,464.00
79	300274	阳光电源	2024年01月03日- 2024年01月11日	87.59	3,500	306,565.00
80	300308	中际旭创	2024年01月11日- 2024年01月11日	112.91	1,200	135,492.00
81	300316	晶盛机电	2024年01月11日- 2024年01月11日	44.09	1,200	52,908.00
82	300347	泰格医药	2024年01月02日- 2024年01月11日	54.97	2,100	115,437.00
83	300408	三环集团	2024年01月11日- 2024年01月11日	29.45	2,500	73,625.00
84	300413	芒果超媒	2024年01月02日- 2024年01月11日	25.20	35,300	889,560.00
85	300433	蓝思科技	2024年01月04日- 2024年01月11日	13.20	42,600	562,320.00
86	300450	先导智能	2024年01月11日- 2024年01月11日	25.60	2,100	53,760.00
87	300498	温氏股份	2024年01月11日- 2024年01月11日	20.06	10,200	204,612.00
88	300628	亿联网络	2024年01月04日-	29.55	5,800	171,390.00

			2024年01月04日			
89	300750	宁德时代	2024年01月11日- 2024年01月11日	163.26	5,100	832,626.00
90	300751	迈为股份	2024年01月11日- 2024年01月11日	129.51	3,600	466,236.00
91	300759	康龙化成	2024年01月08日- 2024年01月11日	28.98	3,400	98,532.00
92	300760	迈瑞医疗	2024年01月11日- 2024年01月11日	290.60	1,100	319,660.00
93	300896	爱美客	2024年01月10日- 2024年01月10日	294.33	1,900	559,227.00
94	300957	贝泰妮	2024年01月02日- 2024年01月03日	68.17	14,800	1,008,916.0 0
95	300979	华利集团	2024年01月03日- 2024年01月09日	52.64	11,300	594,832.00
96	300999	金龙鱼	2024年01月11日- 2024年01月11日	33.38	3,200	106,816.00
97	301269	华大九天	2024年01月10日- 2024年01月11日	105.85	6,900	730,365.00
98	600000	浦发银行	2024年01月11日- 2024年01月11日	6.62	22,700	150,274.00
99	600009	上海机场	2024年01月08日- 2024年01月11日	32.78	33,000	1,081,740.0 0
10 0	600010	包钢股份	2024年01月02日- 2024年01月11日	1.46	187,300	273,458.00
10 1	600011	华能国际	2024年01月08日- 2024年01月11日	7.70	24,200	186,340.00
10 2	600015	华夏银行	2024年01月11日- 2024年01月11日	5.62	12,300	69,126.00
10 3	600016	民生银行	2024年01月11日- 2024年01月11日	3.74	48,000	179,520.00
10 4	600018	上港集团	2024年01月11日-	4.90	5,400	26,460.00

			2024年01月11日			
10 5	600019	宝钢股份	2024年01月11日- 2024年01月11日	5.93	17,100	101,403.00
10 6	600023	浙能电力	2024年01月11日- 2024年01月11日	4.61	7,700	35,497.00
10 7	600025	华能水电	2024年01月05日- 2024年01月11日	8.63	160,000	1,380,800.0 0
10 8	600028	中国石化	2024年01月11日- 2024年01月11日	5.58	36,800	205,344.00
10 9	600029	南方航空	2024年01月11日- 2024年01月11日	5.76	10,400	59,904.00
11 0	600030	中信证券	2024年01月03日- 2024年01月11日	20.37	25,200	513,324.00
11 1	600031	三一重工	2024年01月11日- 2024年01月11日	13.77	11,400	156,978.00
11 2	600036	招商银行	2024年01月11日- 2024年01月11日	27.82	23,900	664,898.00
11 3	600039	四川路桥	2024年01月11日- 2024年01月11日	7.49	3,300	24,717.00
11 4	600048	保利发展	2024年01月05日- 2024年01月11日	9.90	122,200	1,209,780.0 0
11 5	600050	中国联通	2024年01月11日- 2024年01月11日	4.38	36,900	161,622.00
11 6	600061	国投资本	2024年01月03日- 2024年01月11日	6.74	10,200	68,748.00
11 7	600085	同仁堂	2024年01月11日- 2024年01月12日	53.70	13,200	708,840.00
11 8	600089	特变电工	2024年01月11日- 2024年01月11日	13.80	9,700	133,860.00
11 9	600104	上汽集团	2024年01月11日- 2024年01月11日	13.53	9,000	121,770.00
12 0	600111	北方稀土	2024年01月02日-	19.34	195,600	3,782,904.0 0

			2024年01月11日			
12 1	600115	中国东航	2024年01月08日- 2024年01月11日	3.88	381,900	1,481,772.0 0
12 2	600150	中国船舶	2024年01月11日- 2024年01月11日	29.44	4,300	126,592.00
12 3	600176	中国巨石	2024年01月11日- 2024年01月11日	9.83	4,600	45,218.00
12 4	600183	生益科技	2024年01月11日- 2024年01月11日	18.31	2,200	40,282.00
12 5	600188	兖矿能源	2024年01月03日- 2024年01月11日	19.81	95,900	1,899,779.0 0
12 6	600196	复星医药	2024年01月03日- 2024年01月11日	25.03	7,100	177,713.00
12 7	600219	南山铝业	2024年01月11日- 2024年01月11日	2.94	13,500	39,690.00
12 8	600233	圆通速递	2024年01月11日- 2024年01月11日	12.29	3,300	40,557.00
12 9	600276	恒瑞医药	2024年01月09日- 2024年01月11日	45.23	20,300	918,169.00
13 0	600309	万华化学	2024年01月08日- 2024年01月11日	76.82	9,400	722,108.00
13 1	600332	白云山	2024年01月11日- 2024年01月11日	28.60	1,300	37,180.00
13 2	600346	恒力石化	2024年01月05日- 2024年01月11日	13.17	124,300	1,637,031.0 0
13 3	600362	江西铜业	2024年01月03日- 2024年01月11日	17.86	23,400	417,924.00
13 4	600372	中航机载	2024年01月11日- 2024年01月11日	13.18	3,700	48,766.00
13 5	600406	国电南瑞	2024年01月11日- 2024年01月11日	22.32	7,700	171,864.00
13 6	600426	华鲁恒升	2024年01月11日-	27.59	2,800	77,252.00

			2024年01月11日			
13 7	600438	通威股份	2024年01月03日- 2024年01月11日	25.03	9,400	235,282.00
13 8	600460	士兰微	2024年01月02日- 2024年01月11日	22.83	42,700	974,841.00
13 9	600489	中金黄金	2024年01月11日- 2024年01月11日	9.96	5,600	55,776.00
14 0	600515	海南机场	2024年01月02日- 2024年01月11日	3.70	442,100	1,635,770.0 0
14 1	600519	贵州茅台	2024年01月11日- 2024年01月11日	1,726.00	1,200	2,071,200.0 0
14 2	600547	山东黄金	2024年01月11日- 2024年01月11日	22.87	3,400	77,758.00
14 3	600570	恒生电子	2024年01月11日- 2024年01月12日	28.76	7,100	204,196.00
14 4	600584	长电科技	2024年01月11日- 2024年01月11日	29.86	2,700	80,622.00
14 5	600585	海螺水泥	2024年01月11日- 2024年01月11日	22.56	4,600	103,776.00
14 6	600588	用友网络	2024年01月11日- 2024年01月11日	17.79	3,900	69,381.00
14 7	600606	绿地控股	2024年01月08日- 2024年01月11日	2.30	102,900	236,670.00
14 8	600660	福耀玻璃	2024年01月08日- 2024年01月11日	37.39	24,400	912,316.00
14 9	600674	川投能源	2024年01月04日- 2024年01月11日	15.12	198,100	2,995,272.0 0
15 0	600690	海尔智家	2024年01月05日- 2024年01月11日	21.00	31,200	655,200.00
15 1	600732	爱旭股份	2024年01月02日- 2024年01月12日	17.64	23,400	412,776.00
15 2	600741	华域汽车	2024年01月11日-	16.28	3,000	48,840.00

			2024年01月11日			
15 3	600745	闻泰科技	2024年01月02日- 2024年01月11日	42.31	8,200	346,942.00
15 4	600754	锦江酒店	2024年01月08日- 2024年01月08日	29.90	20,700	618,930.00
15 5	600760	中航沈飞	2024年01月11日- 2024年01月11日	42.18	2,100	88,578.00
15 6	600795	国电电力	2024年01月11日- 2024年01月11日	4.16	17,200	71,552.00
15 7	600803	新奥股份	2024年01月11日- 2024年01月11日	16.82	1,700	28,594.00
15 8	600837	海通证券	2024年01月11日- 2024年01月11日	9.37	18,600	174,282.00
15 9	600845	宝信软件	2024年01月11日- 2024年01月11日	48.80	1,300	63,440.00
16 0	600875	东方电气	2024年01月11日- 2024年01月11日	14.62	2,100	30,702.00
16 1	600886	国投电力	2024年01月11日- 2024年01月12日	13.18	228,300	3,008,994.0 0
16 2	600887	伊利股份	2024年01月11日- 2024年01月11日	26.75	12,300	329,025.00
16 3	600893	航发动力	2024年01月11日- 2024年01月11日	37.38	2,500	93,450.00
16 4	600900	长江电力	2024年01月11日- 2024年01月11日	23.34	18,900	441,126.00
16 5	600905	三峡能源	2024年01月11日- 2024年01月11日	4.37	27,600	120,612.00
16 6	600918	中泰证券	2024年01月11日- 2024年01月11日	6.86	5,300	36,358.00
16 7	600919	江苏银行	2024年01月11日- 2024年01月11日	6.69	35,500	237,495.00
16 8	600926	杭州银行	2024年01月11日-	10.01	6,800	68,068.00

			2024年01月11日			
169	600938	中国海油	2024年01月11日- 2024年01月11日	20.97	4,000	83,880.00
170	600941	中国移动	2024年01月08日- 2024年01月11日	99.48	11,800	1,173,864.00
171	600958	东方证券	2024年01月03日- 2024年01月11日	8.70	16,700	145,290.00
172	600989	宝丰能源	2024年01月03日- 2024年01月11日	14.77	75,000	1,107,750.00
173	600999	招商证券	2024年01月11日- 2024年01月11日	13.64	7,100	96,844.00
174	601006	大秦铁路	2024年01月04日- 2024年01月11日	7.21	546,600	3,940,986.00
175	601009	南京银行	2024年01月11日- 2024年01月11日	7.38	10,000	73,800.00
176	601012	隆基绿能	2024年01月03日- 2024年01月12日	22.90	17,000	389,300.00
177	601066	中信建投	2024年01月02日- 2024年01月11日	23.66	30,000	709,800.00
178	601088	中国神华	2024年01月11日- 2024年01月11日	31.35	6,300	197,505.00
179	601100	恒立液压	2024年01月10日- 2024年01月11日	54.68	2,000	109,360.00
180	601111	中国国航	2024年01月11日- 2024年01月11日	7.34	9,000	66,060.00
181	601117	中国化学	2024年01月11日- 2024年01月11日	6.36	7,000	44,520.00
182	601138	工业富联	2024年01月11日- 2024年01月11日	15.12	7,600	114,912.00
183	601155	新城控股	2024年01月03日- 2024年01月11日	11.41	51,500	587,615.00
184	601166	兴业银行	2024年01月11日-	16.21	28,100	455,501.00

			2024年01月11日			
18 5	601169	北京银行	2024年01月11日- 2024年01月11日	4.53	28,600	129,558.00
18 6	601186	中国铁建	2024年01月11日- 2024年01月11日	7.61	8,900	67,729.00
18 7	601211	国泰君安	2024年01月11日- 2024年01月11日	14.88	8,700	129,456.00
18 8	601225	陕西煤业	2024年01月11日- 2024年01月11日	20.89	7,500	156,675.00
18 9	601229	上海银行	2024年01月05日- 2024年01月12日	5.97	46,900	279,993.00
19 0	601236	红塔证券	2024年01月03日- 2024年01月11日	7.59	17,200	130,548.00
19 1	601238	广汽集团	2024年01月04日- 2024年01月11日	8.75	76,600	670,250.00
19 2	601288	农业银行	2024年01月11日- 2024年01月11日	3.64	61,700	224,588.00
19 3	601318	中国平安	2024年01月11日- 2024年01月11日	40.30	20,800	838,240.00
19 4	601319	中国人保	2024年01月02日- 2024年01月11日	4.84	9,900	47,916.00
19 5	601328	交通银行	2024年01月11日- 2024年01月11日	5.74	53,100	304,794.00
19 6	601336	新华保险	2024年01月02日- 2024年01月11日	31.13	7,200	224,136.00
19 7	601360	三六零	2024年01月02日- 2024年01月11日	9.01	317,800	2,863,378.0 0
19 8	601377	兴业证券	2024年01月11日- 2024年01月11日	5.87	13,300	78,071.00
19 9	601390	中国中铁	2024年01月11日- 2024年01月11日	5.68	19,800	112,464.00
20 0	601398	工商银行	2024年01月11日-	4.78	67,800	324,084.00

			2024年01月11日			
20 1	601600	中国铝业	2024年01月11日- 2024年01月11日	5.64	25,700	144,948.00
20 2	601601	中国太保	2024年01月11日- 2024年01月11日	23.78	6,600	156,948.00
20 3	601607	上海医药	2024年01月11日- 2024年01月11日	16.73	2,100	35,133.00
20 4	601615	明阳智能	2024年01月11日- 2024年01月11日	12.54	3,500	43,890.00
20 5	601618	中国中冶	2024年01月11日- 2024年01月11日	3.06	13,800	42,228.00
20 6	601628	中国人寿	2024年01月11日- 2024年01月11日	28.35	3,200	90,720.00
20 7	601633	长城汽车	2024年01月11日- 2024年01月11日	25.22	2,300	58,006.00
20 8	601658	邮储银行	2024年01月11日- 2024年01月11日	4.35	21,400	93,090.00
20 9	601668	中国建筑	2024年01月11日- 2024年01月11日	4.81	40,500	194,805.00
21 0	601669	中国电建	2024年01月11日- 2024年01月11日	4.89	16,600	81,174.00
21 1	601688	华泰证券	2024年01月11日- 2024年01月11日	13.95	9,900	138,105.00
21 2	601689	拓普集团	2024年01月04日- 2024年01月04日	73.50	1,400	102,900.00
21 3	601698	中国卫通	2024年01月02日- 2024年01月11日	17.31	56,200	972,822.00
21 4	601699	潞安环能	2024年01月03日- 2024年01月11日	21.91	106,300	2,329,033.0 0
21 5	601728	中国电信	2024年01月11日- 2024年01月11日	5.41	30,000	162,300.00
21 6	601766	中国中车	2024年01月11日-	5.26	23,500	123,610.00

			2024年01月11日			
21 7	601788	光大证券	2024年01月02日- 2024年01月11日	15.42	28,000	431,760.00
21 8	601799	星宇股份	2024年01月02日- 2024年01月12日	131.11	8,400	1,101,324.0 0
21 9	601800	中国交建	2024年01月11日- 2024年01月11日	7.60	6,800	51,680.00
22 0	601808	中海油服	2024年01月11日- 2024年01月11日	14.62	1,100	16,082.00
22 1	601816	京沪高铁	2024年01月11日- 2024年01月11日	4.92	47,500	233,700.00
22 2	601818	光大银行	2024年01月11日- 2024年01月11日	2.90	35,900	104,110.00
22 3	601838	成都银行	2024年01月11日- 2024年01月11日	11.26	3,600	40,536.00
22 4	601857	中国石油	2024年01月05日- 2024年01月11日	7.06	36,200	255,572.00
22 5	601865	福莱特	2024年01月03日- 2024年01月12日	26.70	22,000	587,400.00
22 6	601868	中国能建	2024年01月11日- 2024年01月11日	2.10	25,100	52,710.00
22 7	601872	招商轮船	2024年01月03日- 2024年01月12日	5.88	87,800	516,264.00
22 8	601877	正泰电器	2024年01月11日- 2024年01月11日	21.51	2,000	43,020.00
22 9	601878	浙商证券	2024年01月03日- 2024年01月11日	10.43	10,300	107,429.00
23 0	601881	中国银河	2024年01月02日- 2024年01月11日	12.05	66,500	801,325.00
23 1	601888	中国中免	2024年01月02日- 2024年01月12日	83.69	20,600	1,724,014.0 0
23 2	601898	中煤能源	2024年01月11日-	9.69	24,700	239,343.00

			2024年01月11日			
23 3	601899	紫金矿业	2024年01月11日- 2024年01月11日	12.46	31,800	396,228.00
23 4	601901	方正证券	2024年01月02日- 2024年01月11日	8.06	59,200	477,152.00
23 5	601916	浙商银行	2024年01月11日- 2024年01月11日	2.52	29,100	73,332.00
23 6	601919	中远海控	2024年01月03日- 2024年01月11日	9.58	52,200	500,076.00
23 7	601939	建设银行	2024年01月02日- 2024年01月11日	6.51	14,100	91,791.00
23 8	601985	中国核电	2024年01月11日- 2024年01月11日	7.50	18,200	136,500.00
23 9	601988	中国银行	2024年01月11日- 2024年01月11日	3.99	40,700	162,393.00
24 0	601989	中国重工	2024年01月04日- 2024年01月04日	4.13	221,700	915,621.00
24 1	601995	中金公司	2024年01月03日- 2024年01月11日	38.05	5,700	216,885.00
24 2	601998	中信银行	2024年01月11日- 2024年01月11日	5.29	5,900	31,211.00
24 3	603019	中科曙光	2024年01月02日- 2024年01月11日	39.49	19,800	781,902.00
24 4	603259	药明康德	2024年01月02日- 2024年01月11日	72.76	47,600	3,463,376.0 0
24 5	603288	海天味业	2024年01月11日- 2024年01月12日	37.95	9,400	356,730.00
24 6	603290	斯达半导	2024年01月04日- 2024年01月09日	181.00	7,400	1,339,400.0 0
24 7	603369	今世缘	2024年01月02日- 2024年01月11日	48.75	16,100	784,875.00
24 8	603501	韦尔股份	2024年01月04日-	106.71	4,900	522,879.00

			2024年01月11日			
24 9	603659	璞泰来	2024年01月11日- 2024年01月11日	20.93	1,600	33,488.00
25 0	603799	华友钴业	2024年01月11日- 2024年01月11日	32.93	2,600	85,618.00
25 1	603806	福斯特	2024年01月04日- 2024年01月12日	24.27	11,600	281,532.00
25 2	603833	欧派家居	2024年01月02日- 2024年01月04日	69.61	15,500	1,078,955.0 0
25 3	603986	兆易创新	2024年01月04日- 2024年01月11日	92.39	2,300	212,497.00
25 4	603993	洛阳钼业	2024年01月03日- 2024年01月11日	5.20	50,100	260,520.00
25 5	605117	德业股份	2024年01月02日- 2024年01月08日	83.90	14,800	1,241,720.0 0
25 6	688008	澜起科技	2024年01月11日- 2024年01月11日	58.76	1,700	99,892.00
25 7	688036	传音控股	2024年01月03日- 2024年01月10日	138.40	27,800	3,847,520.0 0
25 8	688041	海光信息	2024年01月04日- 2024年01月11日	70.98	8,100	574,938.00
25 9	688065	凯赛生物	2024年01月05日- 2024年01月11日	54.98	14,200	780,716.00
26 0	688126	沪硅产业	2024年01月11日- 2024年01月11日	17.32	3,100	53,692.00
26 1	688187	时代电气	2024年01月12日- 2024年01月12日	36.33	23,000	835,590.00
26 2	688223	晶科能源	2024年01月10日- 2024年01月12日	8.86	17,100	151,506.00
26 3	688256	寒武纪	2024年01月03日- 2024年01月12日	134.96	5,700	769,272.00
26 4	688271	联影医疗	2024年01月04日-	137.01	24,000	3,288,240.0 0

			2024年01月08日			
26 5	688363	华熙生物	2024年01月05日- 2024年01月10日	66.93	5,800	388,194.00
26 6	688396	华润微	2024年01月11日- 2024年01月11日	44.69	1,000	44,690.00
26 7	688599	天合光能	2024年01月11日- 2024年01月11日	28.53	2,100	59,913.00
26 8	688981	中芯国际	2024年01月02日- 2024年01月11日	53.02	24,500	1,298,990.0 0
合 计	-	-	-	-	9,707,500	149,178,48 9.00

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。

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同责任，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。

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

本基金本报告期末及上年度末均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

本基金本报告期末及上年度末均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

本基金本报告期末及上年度末均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

本基金本报告期末及上年度末均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

本基金本报告期末及上年度末均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

本基金本报告期末及上年度末均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	11,909,031.86	-	-	-	11,909,031.86
结算备付金	476,132.10	-	-	-	476,132.10
存出保证金	714,040.90	-	-	-	714,040.90
交易性金融资产	-	-	-	7,870,025,029.84	7,870,025,029.84
应收清算款	-	-	-	51,175,997.68	51,175,997.68

其他资产	-	-	-	82,577.45	82,577.45
资产总计	13,099,204.86	-	-	7,921,283,604.97	7,934,382,809.83
负债					
应付清算款	-	-	-	55,312,022.98	55,312,022.98
应付管理人报酬	-	-	-	3,236,536.55	3,236,536.55
应付托管费	-	-	-	647,307.34	647,307.34
应交税费	-	-	-	5,023.96	5,023.96
其他负债	-	-	-	1,397,803.33	1,397,803.33
负债总计	-	-	-	60,598,694.16	60,598,694.16
利率敏感度缺口	13,099,204.86	-	-	7,860,684,910.81	7,873,784,115.67
上年度末 2022年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	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。

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(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)。

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。

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		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	7,870,025,029.84	99.95	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	7,870,025,029.84	99.95	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	上年度末 2022年12月31日
	业绩比较基准上升5%	388,127,388.27	343,478,078.02
	业绩比较基准下降5%	-388,127,388.27	-343,478,078.02

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	上年度末 2022年12月31日
第一层次	7,868,716,971.53	6,851,553,540.12
第二层次	-	-
第三层次	1,308,058.31	5,288,949.33
合计	7,870,025,029.84	6,856,842,489.45

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券的公允价值应属第二层次还是第三层次。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	5,288,949.33	5,288,949.33
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	3,509,626.07	3,509,626.07
转出第三层次	-	9,113,757.12	9,113,757.12
当期利得或损失总额	-	1,623,240.03	1,623,240.03
其中：计入损益的利得或损失	-	1,623,240.03	1,623,240.03
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,308,058.31	1,308,058.31
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-294,168.95	-294,168.95
项目	上年度可比期间		

	2022年01月01日至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	1,853,726.16	1,853,726.16
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	9,260,042.47	9,260,042.47
转出第三层次	-	12,608,651.52	12,608,651.52
当期利得或损失总额	-	6,783,832.22	6,783,832.22
其中：计入损益的利得或损失	-	6,783,832.22	6,783,832.22
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	5,288,949.33	5,288,949.33
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	-1,401,339.25	-1,401,339.25

注：于2023年12月31日，本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。于2023年度，本基金从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资。计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股票投资	1,308,058.31	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	0.1962~2.1988	负相关
项目	上年度末公	采用的估值技	不可观察输入值		

	允价值	术	名称	范围/加权 平均值	与公允价值之 间的关系
股票 投资	5,288,949.33	平均价格亚式 期权模型	预期年化 波动率	0.1891~2.47 56	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2023年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2022年12月31日：同)。

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	7,870,025,029.84	99.19
	其中：股票	7,870,025,029.84	99.19
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	12,385,163.96	0.16
8	其他各项资产	51,972,616.03	0.66
9	合计	7,934,382,809.83	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149,178,489.00元，占基金资产净值的比例为1.89%。

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	99,264,600.58	1.26
B	采矿业	375,467,082.10	4.77
C	制造业	4,312,554,867.95	54.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	264,053,872.00	3.35
E	建筑业	162,342,294.60	2.06
F	批发和零售业	24,916,562.00	0.32
G	交通运输、仓储和邮政业	245,853,072.40	3.12
H	住宿和餐饮业	6,186,310.00	0.08
I	信息传输、软件和信息技术服务业	374,083,001.44	4.75
J	金融业	1,700,546,285.87	21.60
K	房地产业	103,158,723.13	1.31
L	租赁和商务服务业	65,932,941.00	0.84
M	科学研究和技术服务业	92,398,936.78	1.17
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	33,415,067.28	0.42
R	文化、体育和娱乐业	8,543,354.40	0.11

S	综合	-	-
	合计	7,868,716,971.53	99.94

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	1,139,916.00	0.01
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	56,342.59	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	13,981.41	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	59,263.03	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	3,058.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	26,564.46	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	8,932.82	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,308,058.31	0.02

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	284,449	490,958,974.00	6.24
2	601318	中国平安	4,874,086	196,425,665.80	2.49
3	300750	宁德时代	1,195,340	195,151,208.40	2.48
4	600036	招商银行	5,605,406	155,942,394.92	1.98
5	000858	五粮液	878,928	123,322,387.68	1.57
6	000333	美的集团	2,226,771	121,648,499.73	1.54
7	601166	兴业银行	6,585,118	106,744,762.78	1.36
8	600900	长江电力	4,432,300	103,449,882.00	1.31
9	601899	紫金矿业	7,459,700	92,947,862.00	1.18
10	600276	恒瑞医药	2,022,199	91,464,060.77	1.16
11	600030	中信证券	4,420,125	90,037,946.25	1.14
12	002594	比亚迪	410,600	81,298,800.00	1.03
13	300059	东方财富	5,744,817	80,657,230.68	1.02
14	300760	迈瑞医疗	274,500	79,769,700.00	1.01
15	002475	立讯精密	2,265,677	78,052,572.65	0.99
16	600887	伊利股份	2,882,900	77,117,575.00	0.98
17	601398	工商银行	15,873,100	75,873,418.00	0.96
18	601328	交通银行	12,443,100	71,423,394.00	0.91
19	603259	药明康德	929,619	67,639,078.44	0.86
20	000725	京东方 A	16,967,100	66,171,690.00	0.84
21	000651	格力电器	2,040,222	65,633,941.74	0.83
22	600309	万华化学	853,194	65,542,363.08	0.83
23	601012	隆基绿能	2,745,204	62,865,171.60	0.80
24	300124	汇川技术	966,662	61,035,038.68	0.78
25	000568	泸州老窖	333,300	59,800,686.00	0.76
26	002415	海康威视	1,690,100	58,680,272.00	0.75

27	600919	江苏银行	8,311,210	55,601,994.90	0.71
28	601816	京沪高铁	11,119,900	54,709,908.00	0.69
29	601288	农业银行	14,457,600	52,625,664.00	0.67
30	600809	山西汾酒	221,041	51,000,789.93	0.65
31	002714	牧原股份	1,237,605	50,964,573.90	0.65
32	300498	温氏股份	2,407,778	48,300,026.68	0.61
33	600028	中国石化	8,613,440	48,062,995.20	0.61
34	688981	中芯国际	893,821	47,390,389.42	0.60
35	601088	中国神华	1,493,600	46,824,360.00	0.59
36	601668	中国建筑	9,492,700	45,659,887.00	0.58
37	002352	顺丰控股	1,108,200	44,771,280.00	0.57
38	600016	民生银行	11,241,400	42,042,836.00	0.53
39	000001	平安银行	4,393,640	41,256,279.60	0.52
40	300274	阳光电源	470,800	41,237,372.00	0.52
41	600837	海通证券	4,372,600	40,971,262.00	0.52
42	600941	中国移动	408,800	40,667,424.00	0.52
43	600406	国电南瑞	1,818,792	40,595,437.44	0.52
44	000792	盐湖股份	2,460,400	39,243,380.00	0.50
45	002230	科大讯飞	839,000	38,912,820.00	0.49
46	000063	中兴通讯	1,443,500	38,223,880.00	0.49
47	601988	中国银行	9,544,000	38,080,560.00	0.48
48	601728	中国电信	7,031,500	38,040,415.00	0.48
49	600050	中国联通	8,642,400	37,853,712.00	0.48
50	000625	长安汽车	2,248,602	37,843,971.66	0.48
51	600031	三一重工	2,689,900	37,039,923.00	0.47
52	601888	中国中免	442,100	36,999,349.00	0.47
53	601601	中国太保	1,550,100	36,861,378.00	0.47
54	601225	陕西煤业	1,756,300	36,689,107.00	0.47
55	000100	TCL科技	8,504,540	36,569,522.00	0.46
56	601857	中国石油	5,133,185	36,240,286.10	0.46
57	002142	宁波银行	1,794,432	36,086,027.52	0.46

58	600690	海尔智家	1,714,400	36,002,400.00	0.46
59	603501	韦尔股份	330,260	35,242,044.60	0.45
60	600000	浦发银行	5,317,395	35,201,154.90	0.45
61	000338	潍柴动力	2,457,400	33,543,510.00	0.43
62	300015	爱尔眼科	2,112,204	33,415,067.28	0.42
63	300122	智飞生物	543,447	33,210,046.17	0.42
64	600436	片仔癀	136,674	33,073,741.26	0.42
65	688111	金山办公	104,542	33,056,180.40	0.42
66	300308	中际旭创	290,900	32,845,519.00	0.42
67	601688	华泰证券	2,331,800	32,528,610.00	0.41
68	000002	万科A	3,081,621	32,233,755.66	0.41
69	600048	保利发展	3,253,400	32,208,660.00	0.41
70	601985	中国核电	4,275,600	32,067,000.00	0.41
71	600089	特变电工	2,288,250	31,577,850.00	0.40
72	600438	通威股份	1,223,300	30,619,199.00	0.39
73	601211	国泰君安	2,041,599	30,378,993.12	0.39
74	601169	北京银行	6,702,800	30,363,684.00	0.39
75	688012	中微公司	196,353	30,159,820.80	0.38
76	002304	洋河股份	272,945	29,996,655.50	0.38
77	688041	海光信息	421,212	29,897,627.76	0.38
78	002050	三花智控	1,014,300	29,820,420.00	0.38
79	600150	中国船舶	1,012,800	29,816,832.00	0.38
80	002371	北方华创	120,000	29,485,200.00	0.37
81	601766	中国中车	5,507,600	28,969,976.00	0.37
82	002027	分众传媒	4,578,100	28,933,592.00	0.37
83	603288	海天味业	755,578	28,674,185.10	0.36
84	600104	上汽集团	2,116,400	28,634,892.00	0.36
85	600905	三峡能源	6,482,200	28,327,214.00	0.36
86	603986	兆易创新	302,024	27,903,997.36	0.35
87	601919	中远海控	2,888,930	27,675,949.40	0.35
88	601138	工业富联	1,799,500	27,208,440.00	0.35

89	600660	福耀玻璃	725,600	27,130,184.00	0.34
90	601229	上海银行	4,502,000	26,876,940.00	0.34
91	601390	中国中铁	4,652,000	26,423,360.00	0.34
92	002466	天齐锂业	468,300	26,126,457.00	0.33
93	688271	联影医疗	186,662	25,574,560.62	0.32
94	600585	海螺水泥	1,087,000	24,522,720.00	0.31
95	601818	光大银行	8,404,300	24,372,470.00	0.31
96	688008	澜起科技	412,395	24,232,330.20	0.31
97	300782	卓胜微	169,180	23,854,380.00	0.30
98	600019	宝钢股份	4,007,332	23,763,478.76	0.30
99	300014	亿纬锂能	555,652	23,448,514.40	0.30
100	600999	招商证券	1,680,831	22,926,534.84	0.29
101	002129	TCL中环	1,464,400	22,903,216.00	0.29
102	002241	歌尔股份	1,084,600	22,787,446.00	0.29
103	600893	航发动力	603,700	22,566,306.00	0.29
104	600111	北方稀土	1,146,200	22,167,508.00	0.28
105	002460	赣锋锂业	511,589	21,896,009.20	0.28
106	601658	邮储银行	5,026,100	21,863,535.00	0.28
107	601628	中国人寿	754,304	21,384,518.40	0.27
108	000661	长春高新	146,583	21,371,801.40	0.27
109	601989	中国重工	5,163,200	21,324,016.00	0.27
110	600760	中航沈飞	499,096	21,051,869.28	0.27
111	603019	中科曙光	530,174	20,936,571.26	0.27
112	002049	紫光国微	307,820	20,762,459.00	0.26
113	600958	东方证券	2,368,240	20,603,688.00	0.26
114	603799	华友钴业	619,500	20,400,135.00	0.26
115	601600	中国铝业	3,591,000	20,253,240.00	0.26
116	688036	传音控股	146,123	20,223,423.20	0.26
117	601006	大秦铁路	2,784,300	20,074,803.00	0.25
118	000938	紫光股份	1,036,040	20,047,374.00	0.25
119	000538	云南白药	406,899	19,999,085.85	0.25

120	600938	中国海油	947,900	19,877,463.00	0.25
121	601939	建设银行	3,040,500	19,793,655.00	0.25
122	600570	恒生电子	688,199	19,792,603.24	0.25
123	600584	长电科技	648,100	19,352,266.00	0.25
124	002252	上海莱士	2,408,300	19,266,400.00	0.24
125	000776	广发证券	1,340,600	19,157,174.00	0.24
126	601669	中国电建	3,898,900	19,065,621.00	0.24
127	002179	中航光电	479,960	18,718,440.00	0.24
128	600547	山东黄金	818,340	18,715,435.80	0.24
129	600426	华鲁恒升	673,100	18,570,829.00	0.24
130	600009	上海机场	563,300	18,464,974.00	0.23
131	601377	兴业证券	3,128,270	18,362,944.90	0.23
132	000166	申万宏源	4,082,400	18,125,856.00	0.23
133	300408	三环集团	607,700	17,896,765.00	0.23
134	600886	国投电力	1,350,400	17,798,272.00	0.23
135	000425	徐工机械	3,210,700	17,530,422.00	0.22
136	002271	东方雨虹	912,350	17,517,120.00	0.22
137	601009	南京银行	2,341,800	17,282,484.00	0.22
138	000596	古井贡酒	73,978	17,222,078.40	0.22
139	601916	浙商银行	6,830,100	17,211,852.00	0.22
140	300142	沃森生物	728,100	17,117,631.00	0.22
141	002311	海大集团	376,643	16,915,037.13	0.21
142	600795	国电电力	4,048,700	16,842,592.00	0.21
143	600745	闻泰科技	394,200	16,678,602.00	0.21
144	600085	同仁堂	310,538	16,675,890.60	0.21
145	603993	洛阳钼业	3,200,600	16,643,120.00	0.21
146	600588	用友网络	929,120	16,529,044.80	0.21
147	002236	大华股份	895,290	16,518,100.50	0.21
148	000963	华东医药	397,200	16,467,912.00	0.21
149	002920	德赛西威	125,700	16,279,407.00	0.21
150	600015	华夏银行	2,882,300	16,198,526.00	0.21

151	600926	杭州银行	1,611,940	16,135,519.40	0.20
152	600845	宝信软件	325,867	15,902,309.60	0.20
153	601186	中国铁建	2,083,400	15,854,674.00	0.20
154	001979	招商蛇口	1,641,111	15,639,787.83	0.20
155	002459	晶澳科技	750,892	15,558,482.24	0.20
156	000977	浪潮信息	466,747	15,496,000.40	0.20
157	601111	中国国航	2,109,400	15,482,996.00	0.20
158	600011	华能国际	1,991,500	15,334,550.00	0.19
159	600674	川投能源	1,011,000	15,286,320.00	0.19
160	300033	同花顺	97,382	15,276,314.34	0.19
161	601995	中金公司	397,200	15,113,460.00	0.19
162	002812	恩捷股份	265,700	15,097,074.00	0.19
163	600115	中国东航	3,875,500	15,036,940.00	0.19
164	601901	方正证券	1,864,900	15,031,094.00	0.19
165	600010	包钢股份	10,278,200	15,006,172.00	0.19
166	600989	宝丰能源	996,200	14,713,874.00	0.19
167	000157	中联重科	2,249,200	14,687,276.00	0.19
168	601689	拓普集团	199,700	14,677,950.00	0.19
169	601360	三六零	1,618,000	14,578,180.00	0.19
170	600196	复星医药	576,200	14,422,286.00	0.18
171	300896	爱美客	49,000	14,422,170.00	0.18
172	002493	荣盛石化	1,375,350	14,234,872.50	0.18
173	601633	长城汽车	559,429	14,108,799.38	0.18
174	000768	中航西飞	629,800	14,088,626.00	0.18
175	600029	南方航空	2,442,200	14,067,072.00	0.18
176	688599	天合光能	492,308	14,045,547.24	0.18
177	601066	中信建投	588,333	13,919,958.78	0.18
178	603369	今世缘	283,897	13,839,978.75	0.18
179	601788	光大证券	884,800	13,643,616.00	0.17
180	300496	中科创达	166,600	13,337,996.00	0.17
181	601100	恒立液压	242,836	13,278,272.48	0.17

182	002555	三七互娱	703,339	13,229,806.59	0.17
183	300661	圣邦股份	148,210	13,192,172.10	0.17
184	600489	中金黄金	1,317,900	13,126,284.00	0.17
185	002709	天赐材料	522,840	13,112,827.20	0.17
186	300316	晶盛机电	296,395	13,068,055.55	0.17
187	300347	泰格医药	237,622	13,062,081.34	0.17
188	002601	龙佰集团	756,700	12,962,271.00	0.16
189	603392	万泰生物	172,285	12,943,772.05	0.16
190	688126	沪硅产业	746,580	12,930,765.60	0.16
191	688256	寒武纪	94,233	12,717,685.68	0.16
192	300450	先导智能	496,600	12,712,960.00	0.16
193	600346	恒力石化	956,600	12,598,422.00	0.16
194	002821	凯莱英	108,501	12,596,966.10	0.16
195	000895	双汇发展	470,700	12,572,397.00	0.16
196	600188	兖矿能源	623,300	12,347,573.00	0.16
197	601868	中国能建	5,873,800	12,334,980.00	0.16
198	601800	中国交建	1,609,700	12,233,720.00	0.16
199	600600	青岛啤酒	160,600	12,004,850.00	0.15
200	300433	蓝思科技	902,500	11,913,000.00	0.15
201	002001	新和成	700,088	11,873,492.48	0.15
202	601699	潞安环能	541,900	11,873,029.00	0.15
203	601881	中国银河	984,000	11,857,200.00	0.15
204	601336	新华保险	377,716	11,758,299.08	0.15
205	300759	康龙化成	403,650	11,697,777.00	0.15
206	600741	华域汽车	713,800	11,620,664.00	0.15
207	600372	中航机载	876,400	11,550,952.00	0.15
208	000301	东方盛虹	1,197,300	11,494,080.00	0.15
209	600515	海南机场	3,102,500	11,479,250.00	0.15
210	002648	卫星化学	763,400	11,260,150.00	0.14
211	002736	国信证券	1,306,500	11,157,510.00	0.14
212	601021	春秋航空	221,515	11,120,053.00	0.14

213	003816	中国广核	3,562,000	11,077,820.00	0.14
214	002007	华兰生物	496,840	10,995,069.20	0.14
215	000786	北新建材	459,100	10,724,576.00	0.14
216	600176	中国巨石	1,087,529	10,690,410.07	0.14
217	688396	华润微	239,200	10,689,848.00	0.14
218	601117	中国化学	1,660,300	10,559,508.00	0.13
219	601877	正泰电器	486,400	10,462,464.00	0.13
220	301269	华大九天	98,300	10,405,055.00	0.13
221	002074	国轩高科	483,500	10,395,250.00	0.13
222	002410	广联达	603,060	10,336,448.40	0.13
223	601615	明阳智能	823,100	10,321,674.00	0.13
224	000733	振华科技	175,100	10,302,884.00	0.13
225	000983	山西焦煤	1,028,500	10,161,580.00	0.13
226	002180	纳思达	448,900	10,158,607.00	0.13
227	002202	金风科技	1,250,100	10,000,800.00	0.13
228	601618	中国中冶	3,234,600	9,897,876.00	0.13
229	600183	生益科技	532,800	9,755,568.00	0.12
230	601838	成都银行	863,000	9,717,380.00	0.12
231	000876	新希望	1,029,100	9,591,212.00	0.12
232	600233	圆通速递	779,300	9,577,597.00	0.12
233	600219	南山铝业	3,180,200	9,349,788.00	0.12
234	601878	浙商证券	877,718	9,154,598.74	0.12
235	600332	白云山	318,400	9,106,240.00	0.12
236	000408	藏格矿业	357,900	9,069,186.00	0.12
237	300999	金龙鱼	270,100	9,015,938.00	0.11
238	000999	华润三九	179,000	8,901,670.00	0.11
239	601238	广汽集团	1,003,800	8,783,250.00	0.11
240	600732	爱旭股份	496,660	8,761,082.40	0.11
241	002603	以岭药业	378,400	8,729,688.00	0.11
242	002841	视源股份	190,449	8,714,946.24	0.11
243	601872	招商轮船	1,473,500	8,664,180.00	0.11

244	600918	中泰证券	1,261,800	8,655,948.00	0.11
245	688303	大全能源	291,600	8,622,612.00	0.11
246	600460	士兰微	377,000	8,606,910.00	0.11
247	300413	芒果超媒	339,022	8,543,354.40	0.11
248	601799	星宇股份	64,700	8,482,817.00	0.11
249	300223	北京君正	130,800	8,456,220.00	0.11
250	601607	上海医药	505,000	8,448,650.00	0.11
251	600023	浙能电力	1,822,600	8,402,186.00	0.11
252	600362	江西铜业	469,900	8,392,414.00	0.11
253	603806	福斯特	337,592	8,193,357.84	0.10
254	603260	合盛硅业	160,600	8,190,600.00	0.10
255	300454	深信服	113,200	8,183,228.00	0.10
256	300751	迈为股份	63,060	8,166,900.60	0.10
257	603659	璞泰来	387,275	8,105,665.75	0.10
258	601898	中煤能源	829,100	8,033,979.00	0.10
259	688223	晶科能源	906,100	8,028,046.00	0.10
260	600061	国投资本	1,163,088	7,839,213.12	0.10
261	300763	锦浪科技	108,900	7,612,110.00	0.10
262	300919	中伟股份	151,600	7,448,108.00	0.09
263	600875	东方电气	503,800	7,365,556.00	0.09
264	601998	中信银行	1,388,200	7,343,578.00	0.09
265	600132	重庆啤酒	109,600	7,282,920.00	0.09
266	600803	新奥股份	420,800	7,077,856.00	0.09
267	600025	华能水电	815,200	7,035,176.00	0.09
268	002938	鹏鼎控股	315,100	7,033,032.00	0.09
269	603290	斯达半导	38,700	7,004,700.00	0.09
270	601319	中国人保	1,446,400	7,000,576.00	0.09
271	000069	华侨城 A	2,227,000	6,925,970.00	0.09
272	601865	福莱特	258,200	6,893,940.00	0.09
273	300628	亿联网络	228,875	6,763,256.25	0.09
274	605499	东鹏饮料	36,200	6,606,862.00	0.08

275	002916	深南电路	92,848	6,591,279.52	0.08
276	605117	德业股份	77,940	6,539,166.00	0.08
277	000708	中信特钢	457,200	6,419,088.00	0.08
278	603899	晨光股份	167,900	6,304,645.00	0.08
279	600018	上港集团	1,266,800	6,207,320.00	0.08
280	600754	锦江酒店	206,900	6,186,310.00	0.08
281	000617	中油资本	1,144,900	6,182,460.00	0.08
282	600039	四川路桥	790,120	5,917,998.80	0.08
283	688363	华熙生物	87,394	5,849,280.42	0.07
284	688065	凯赛生物	105,695	5,811,111.10	0.07
285	603195	公牛集团	60,632	5,799,450.80	0.07
286	603833	欧派家居	82,800	5,763,708.00	0.07
287	000877	天山股份	784,200	5,238,456.00	0.07
288	300957	贝泰妮	76,700	5,228,639.00	0.07
289	688561	奇安信	124,181	4,978,416.29	0.06
290	601698	中国卫通	286,900	4,966,239.00	0.06
291	601236	红塔证券	639,920	4,856,992.80	0.06
292	601155	新城控股	409,404	4,671,299.64	0.06
293	600606	绿地控股	1,910,726	4,394,669.80	0.06
294	603486	科沃斯	104,500	4,330,480.00	0.05
295	688187	时代电气	118,000	4,286,940.00	0.05
296	601808	中海油服	268,400	3,924,008.00	0.05
297	300979	华利集团	68,700	3,616,368.00	0.05
298	000800	一汽解放	419,800	3,568,300.00	0.05
299	601059	信达证券	146,700	2,639,133.00	0.03
300	001289	龙源电力	68,400	1,355,004.00	0.02

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	688563	航材股份	1,501	90,795.49	0.00
2	688548	广钢气体	4,048	51,612.00	0.00
3	603296	华勤技术	593	46,105.75	0.00
4	301526	C国际复	9,723	43,267.35	0.00
5	301487	盟固利	867	35,512.32	0.00
6	688549	中巨芯	4,294	34,738.46	0.00
7	301348	蓝箭电子	613	27,321.41	0.00
8	688702	盛科通信	549	26,450.82	0.00
9	688582	芯动联科	648	25,058.16	0.00
10	301559	中集环科	1,315	23,985.60	0.00
11	301486	致尚科技	482	22,774.50	0.00
12	688652	京仪装备	416	21,736.00	0.00
13	301525	儒竞科技	266	21,668.36	0.00
14	301498	乖宝宠物	554	21,500.74	0.00
15	301371	敷尔佳	564	21,195.12	0.00
16	301370	国科恒泰	1,240	19,852.40	0.00
17	301421	波长光电	332	19,710.84	0.00
18	301558	三态股份	1,458	19,537.20	0.00
19	688627	精智达	222	19,473.84	0.00
20	688591	泰凌微	681	19,081.62	0.00
21	300904	威力传动	304	18,705.12	0.00
22	301488	豪恩汽电	262	18,101.58	0.00
23	301381	赛维时代	571	16,952.99	0.00
24	301172	君逸数码	438	16,714.08	0.00
25	301509	金凯生科	266	16,553.18	0.00
26	688612	威迈斯	422	16,023.34	0.00
27	601096	宏盛华源	3,918	15,907.08	0.00
28	301393	昊帆生物	260	15,436.20	0.00
29	601083	锦江航运	1,263	13,981.41	0.00
30	301510	固高科技	396	13,863.96	0.00

31	301507	民生健康	851	13,488.35	0.00
32	301210	金杨股份	281	12,779.88	0.00
33	301566	N达利	576	12,752.64	0.00
34	301456	盘古智能	407	12,368.73	0.00
35	688602	康鹏科技	1,066	11,789.96	0.00
36	688719	爱科赛博	194	11,659.40	0.00
37	301550	斯菱股份	260	11,328.20	0.00
38	301292	海科新源	583	11,281.05	0.00
39	301508	中机认检	419	11,178.92	0.00
40	301251	威尔高	321	11,103.39	0.00
41	688592	司南导航	216	10,914.48	0.00
42	301499	维科精密	371	10,733.03	0.00
43	688603	天承科技	140	10,379.60	0.00
44	688653	康希通信	648	10,361.52	0.00
45	301528	多浦乐	148	10,198.68	0.00
46	301329	信音电子	458	10,181.34	0.00
47	301261	恒工精密	198	10,068.30	0.00
48	301202	朗威股份	306	9,730.80	0.00
49	301395	仁信新材	520	9,718.80	0.00
50	688716	中研股份	267	9,716.13	0.00
51	301413	安培龙	164	9,543.16	0.00
52	301500	飞南资源	455	9,504.95	0.00
53	301418	协昌科技	189	9,487.80	0.00
54	301516	中远通	604	9,368.04	0.00
55	301272	英华特	173	9,234.74	0.00
56	301469	恒达新材	275	9,099.75	0.00
57	301519	舜禹股份	442	8,932.82	0.00
58	301518	长华化学	385	8,858.85	0.00
59	301568	思泰克	246	8,752.68	0.00
60	301520	万邦医药	160	8,438.40	0.00
61	301459	丰茂股份	208	8,286.72	0.00

62	688720	艾森股份	165	8,223.60	0.00
63	688573	信宇人	285	8,208.00	0.00
64	301489	思泉新材	128	8,206.08	0.00
65	688651	盛邦安全	178	8,196.90	0.00
66	301517	陕西华达	185	8,082.65	0.00
67	301578	C辰奕	118	8,061.76	0.00
68	301548	崇德科技	136	8,022.64	0.00
69	688657	浩辰软件	101	7,901.23	0.00
70	688646	逸飞激光	219	7,899.33	0.00
71	688671	碧兴物联	226	7,751.80	0.00
72	688693	锆威特	178	7,726.98	0.00
73	603275	众辰科技	193	7,662.10	0.00
74	301533	威马农机	225	7,461.00	0.00
75	603062	麦加芯彩	126	7,284.06	0.00
76	301555	惠柏新材	224	7,266.56	0.00
77	301505	苏州规划	194	6,947.14	0.00
78	301529	福赛科技	182	6,894.16	0.00
79	301515	港通医疗	230	6,502.10	0.00
80	688648	中邮科技	303	6,493.29	0.00
81	688450	光格科技	167	6,082.14	0.00
82	603004	C鼎龙	195	6,082.05	0.00
83	603270	金帝股份	195	5,768.10	0.00
84	603119	浙江荣泰	226	5,394.62	0.00
85	603107	上海汽配	292	5,311.48	0.00
86	603193	润本股份	303	5,047.98	0.00
87	001306	夏厦精密	64	4,823.04	0.00
88	001326	联域股份	99	4,815.36	0.00
89	603075	热威股份	182	4,242.42	0.00
90	001358	兴欣新材	87	3,841.92	0.00
91	001239	永达股份	189	3,764.88	0.00
92	603231	索宝蛋白	161	3,466.33	0.00

93	603273	天元智能	178	3,376.66	0.00
94	603276	恒兴新材	134	3,333.92	0.00
95	603373	安邦护卫	88	3,058.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值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	300750	宁德时代	68,697,061.82	1.00
2	000858	五粮液	39,099,346.24	0.57
3	300760	迈瑞医疗	35,772,245.88	0.52
4	002594	比亚迪	35,206,750.10	0.51
5	000333	美的集团	34,129,661.70	0.50
6	300308	中际旭创	32,455,627.98	0.47
7	688041	海光信息	31,002,081.69	0.45
8	688271	联影医疗	26,881,644.02	0.39
9	300059	东方财富	25,900,914.80	0.38
10	300124	汇川技术	21,332,721.50	0.31
11	002415	海康威视	20,637,636.04	0.30
12	002475	立讯精密	20,213,293.58	0.29
13	000651	格力电器	20,112,037.64	0.29
14	002371	北方华创	20,062,726.81	0.29
15	000568	泸州老窖	19,613,581.50	0.29
16	000725	京东方A	18,832,608.00	0.27
17	600919	江苏银行	18,712,121.00	0.27
18	600938	中国海油	18,261,046.00	0.27
19	601916	浙商银行	17,025,976.95	0.25
20	300498	温氏股份	15,724,566.00	0.23

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	600519	贵州茅台	22,148,009.00	0.32
2	002415	海康威视	21,909,183.50	0.32
3	300750	宁德时代	20,750,484.62	0.30
4	600900	长江电力	17,051,787.69	0.25
5	002594	比亚迪	16,635,540.38	0.24
6	002371	北方华创	14,417,921.60	0.21
7	002602	世纪华通	13,827,937.28	0.20
8	000858	五粮液	12,808,797.84	0.19
9	601318	中国平安	11,069,011.00	0.16
10	000333	美的集团	10,658,703.00	0.15
11	300207	欣旺达	10,426,710.00	0.15
12	600436	片仔癀	10,305,317.00	0.15
13	300601	康泰生物	10,186,666.60	0.15
14	600763	通策医疗	9,838,939.00	0.14
15	002756	永兴材料	9,323,513.94	0.14
16	000723	美锦能源	8,814,765.00	0.13
17	300760	迈瑞医疗	8,737,515.68	0.13
18	300059	东方财富	8,340,923.77	0.12
19	600036	招商银行	8,221,669.28	0.12
20	002008	大族激光	7,815,536.60	0.11

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,709,675,777.67
--------------	------------------

卖出股票收入（成交）总额	876,590,123.14
--------------	----------------

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

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。

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】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2023年11月27日收到国家外汇管理局深圳市分局出具罚款处罚、没收违法所得的通报，于2023年12月13日收到国家金融监督管理总局深圳监管局出具公开处罚的通报。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。

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	714,040.90
2	应收清算款	51,175,997.68
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	82,577.45
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	51,972,616.03

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600519	贵州茅台	2,071,200.00	0.03	转融通证券出借
2	600276	恒瑞医药	918,169.00	0.01	转融通证券出借
3	601318	中国平安	838,240.00	0.01	转融通证券出借
4	300750	宁德时代	832,626.00	0.01	转融通证券出借
5	600036	招商银行	664,898.00	0.01	转融通证券出借
6	000858	五粮液	519,147.00	0.01	转融通证券出借
7	000333	美的集团	518,985.00	0.01	转融通证券出借
8	601166	兴业银行	455,501.00	0.01	转融通证券出借
9	600900	长江电力	441,126.00	0.01	转融通证券出借
10	601899	紫金矿业	396,228.00	0.01	转融通证券出借

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

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	688563	航材股份	90,795.49	0.00	科创板打新限售
2	688548	广钢气体	51,612.00	0.00	科创板打新限售
3	603296	华勤技术	46,105.75	0.00	新股锁定
4	301526	C国际复	43,267.35	0.00	创业板打新限售
5	301487	盟固利	35,512.32	0.00	创业板打新限售

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	户均持有的基	持有人结构
----	--------	-------

人户数 (户)	金份额	机构投资者		个人投资者		联接基金	
		持有份额	占总 份额 比例	持有份额	占总 份额 比例	持有份额	占总 份额 比例
8,018	1,046,109.94	256,191,116.00	3.05%	170,688,280.00	2.03%	7,960,830,100.00	94.91%

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	中国平安人寿保险股份有限公司—自有资金	226,592,400.00	2.70%
2	中信证券股份有限公司	5,534,523.00	0.07%
3	中国平安人寿保险股份有限公司—投连—团体退休金平衡	4,974,000.00	0.06%
4	广发证券股份有限公司	4,263,338.00	0.05%
5	陈伟保	2,249,700.00	0.03%
6	朱剑	1,618,500.00	0.02%
7	项丹妮	1,498,200.00	0.02%
8	段德朋	1,450,000.00	0.02%
9	山西焦煤集团有限责任公司企业年金计划—中国工商银行股份有限公司	1,435,200.00	0.02%
10	冯信烈	1,420,500.00	0.02%
-	招商证券股份有限公司-天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金	7,960,830,100.00	94.91%

注：持有人为场内持有人。前十名持有人为除天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金之外的前十名持有人。

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	13,100.00	0.00%

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(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	2,142,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	393,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	8,387,709,496.00

§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》。

2023年7月23日，本基金托管人招商证券股份有限公司免去赵斗斗担任的托管部副总经理职务，另有任用。

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。
本报告期无涉及公募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120,000.00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4年1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，基金托管人及其托管业务高级管理人员未受稽查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
渤海证券	1	-	-	-	-	-
长江证券	2	380,477,076.83	14.87%	169,652.97	15.41%	-

第一创业 证券	2	-	-	-	-	-
东方 财富 证券	2	1,242,618,890.66	48.56%	542,710.22	49.29%	-
方正 证券	3	9,312,982.78	0.36%	4,152.55	0.38%	-
光大 证券	3	292,699,804.06	11.44%	129,289.35	11.74%	-
广发 证券	2	-	-	-	-	-
国投 证券	1	-	-	-	-	-
海通 证券	2	-	-	-	-	-
恒泰 证券	1	-	-	-	-	-
华安 证券	2	-	-	-	-	-
华林 证券	2	172,871,935.22	6.76%	74,657.70	6.78%	-
华泰 证券	3	-	-	-	-	-
开源 证券	4	-	-	-	-	-
天风 证券	2	35,804,137.70	1.40%	15,442.68	1.40%	-
兴业 证券	1	-	-	-	-	-
银河 证券	1	47,580,598.54	1.86%	21,216.83	1.93%	-
英大	2	23,020,728.47	0.90%	5,661.55	0.51%	-

招商证券	5	81,846,478.64	3.20%	20,117.24	1.83%	-
中金财富	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	272,446,945.45	10.65%	118,063.38	10.72%	-

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

2、基金专用交易单元的选择程序：本基金管理人根据上述标准进行考察后，确定选用交易席位的证券经营机构。然后基金管理人和被选用的证券经营机构签订交易席位租用协议。

3、本基金报告期内新租用交易单元：长江证券北交所交易单元、广发证券深圳交易单元、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、英大证券上海交易单元、英大证券深圳交易单元。

4、本基金报告期内停止租用交易单元：无。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
渤海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
第一创业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	3,380,351.92	46.20%	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	1,585,651.34	21.67%	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-

国投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
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	7.56%	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
英大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	1,797,200.00	24.56%	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-

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年第四季度报告	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
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1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
12	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
13	天弘沪深300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	2023-07-05
14	天弘沪深300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
15	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
16	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
17	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	中国证监会规定媒介	2023-08-31
18	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
19	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金新增申购赎回	中国证监会规定媒介	2023-09-04

	代办证券公司的公告		
20	天弘沪深300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	2023-10-21
21	天弘沪深300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
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	2023-10-26
23	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会规定媒介	2023-11-13
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	2023-11-20
25	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
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	2023-12-30

§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%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
联接	1	20230101-20231231	6,535,354,500.00	2,389,473,700.00	963,998,100.00	7,960,830,100.00	94.91%

基金							
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

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