

天弘中证 1000 指数增强型证券投资基金

2022 年年度报告

2022 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:中国农业银行股份有限公司

送出日期:2023 年 03 月 31 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年03月29日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自2022年01月04日起至2022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	11
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
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	17
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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	17
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	17
§6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	17
§7 年度财务报表	20
7.1 资产负债表	20
7.2 利润表	22
7.3 净资产（基金净值）变动表	24
7.4 报表附注	25
§8 投资组合报告	59
8.1 期末基金资产组合情况	59
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	60
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	61
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	70
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	74
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	74
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	74
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	74
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	74
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	75

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	75
8.12 投资组合报告附注.....	75
§9 基金份额持有人信息.....	76
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	76
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	77
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	77
§10 开放式基金份额变动.....	77
§11 重大事件揭示.....	78
11.1 基金份额持有人大会决议.....	78
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.....	78
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	78
11.4 基金投资策略的改变.....	78
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	78
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.....	78
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	79
11.8 其他重大事件.....	80
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	82
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.....	82
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	82
§13 备查文件目录.....	83
13.1 备查文件目录.....	83
13.2 存放地点.....	83
13.3 查阅方式.....	83

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	天弘中证1000指数增强型证券投资基金	
基金简称	天弘中证1000指数增强	
基金主代码	014201	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2022年01月04日	
基金管理人	天弘基金管理有限公司	
基金托管人	中国农业银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,120,571,293.42份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	天弘中证1000指数增强A	天弘中证1000指数增强C
下属分级基金的交易代码	014201	014202
报告期末下属分级基金的份额总额	412,377,610.84份	708,193,682.58份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票型指数增强基金，在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，力争获取高于标的指数的投资收益。
投资策略	本基金采用指数增强型投资策略，以中证1000指数作为基金投资组合的标的指数，结合深入的宏观面、基本面研究及数量化投资技术，在指数化投资基础上优化调整投资组合，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，年跟踪误差不超过7.75%，以实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人将采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。本基金运作过程中，当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照基金份额持

	有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。主要产品投资策略包括：资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、其他类型资产投资策略（资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、参与融资及转融通证券出借业务策略）。
业绩比较基准	中证1000指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	天弘基金管理有限公司	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	童建林
	联系电话	022-83310208
	电子邮箱	service@thfund.com.cn
客户服务电话	95046	95599
传真	022-83865564	010-68121816
注册地址	天津自贸试验区（中心商务区）新华路3678号宝风大厦23层	北京市东城区建国门内大街69号
办公地址	天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层	北京市西城区复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座F9
邮政编码	300203	100031
法定代表人	韩歆毅	谷澍

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金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	天弘基金管理有限公司	天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	本期2022年01月04日（基金合同生效日） - 2022年12月31日	
	天弘中证1000指数 增强A	天弘中证1000指数 增强C
本期已实现收益	-13,933,696.32	6,606,764.10
本期利润	-24,817,719.64	-32,420,960.86
加权平均基金份额本期利润	-0.0469	-0.1072
本期加权平均净值利润率	-4.92%	-11.03%
本期基金份额净值增长率	-6.48%	-6.75%
3.1.2 期末数据和指标	2022年末	
期末可供分配利润	-26,730,410.88	-47,830,452.24
期末可供分配基金份额利润	-0.0648	-0.0675
期末基金资产净值	385,647,199.96	660,363,230.34
期末基金份额净值	0.9352	0.9325
3.1.3 累计期末指标	2022年末	
基金份额累计净值增长率	-6.48%	-6.75%

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

天弘中证1000指数增强A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.94%	1.22%	2.46%	1.14%	0.48%	0.08%
过去六个月	-7.73%	1.28%	-9.67%	1.21%	1.94%	0.07%
自基金合同生效日起至今	-6.48%	1.53%	-20.49%	1.51%	14.01%	0.02%

天弘中证1000指数增强C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.87%	1.22%	2.46%	1.14%	0.41%	0.08%
过去六个月	-7.86%	1.28%	-9.67%	1.21%	1.81%	0.07%
自基金合同生效日起至今	-6.75%	1.53%	-20.49%	1.51%	13.74%	0.02%

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

天弘中证1000指数增强A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2022年01月04日-2022年12月31日)



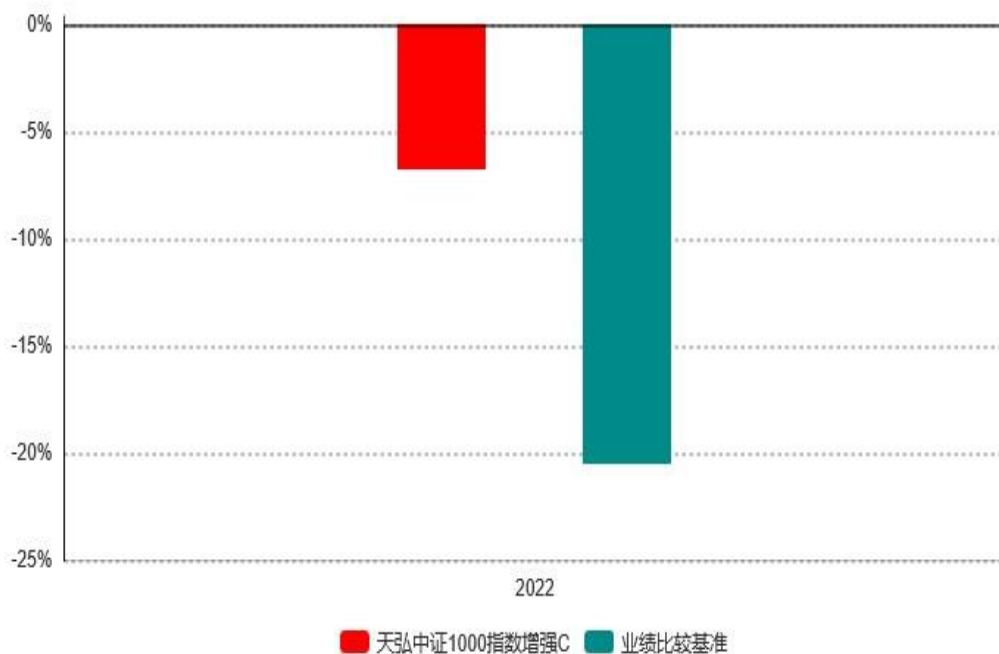
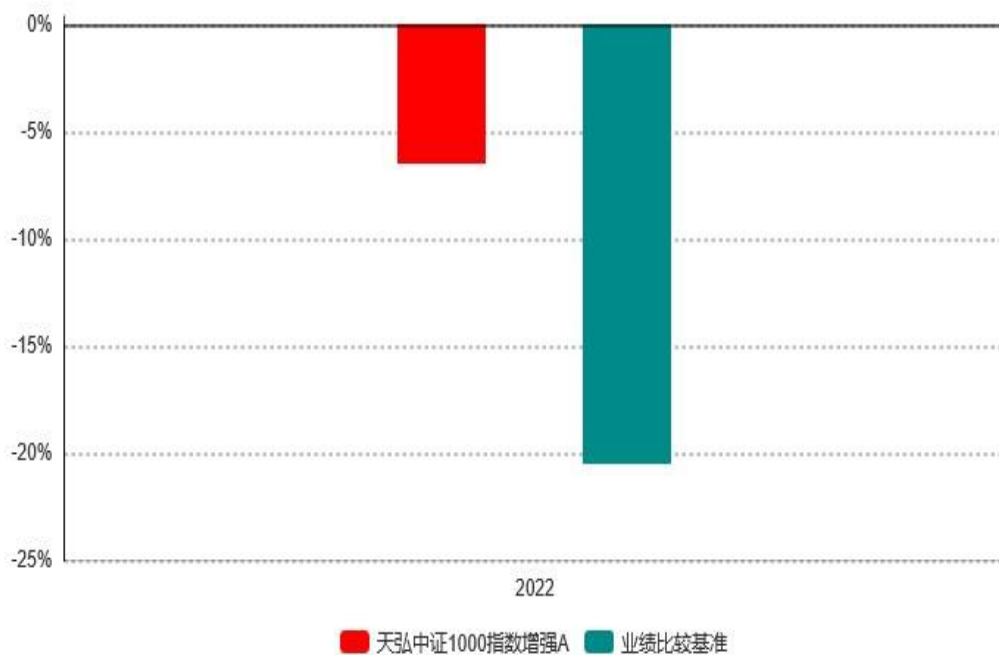
天弘中证1000指数增强C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2022年01月04日-2022年12月31日)



注：1、本基金合同于2022年01月04日生效。

2、按照本基金合同的约定，基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。本基金的建仓期为2022年01月04日至2022年07月03日，建仓期结束时及至报告期末，各项资产配置比例均符合基金合同的约定。

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2022年01月04日生效。基金合同生效当年2022年的净值增长率按照基金合同生效后当年的实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金于2022年01月04日成立，自基金合同生效以来未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

天弘基金管理有限公司（以下简称“公司”或“本基金管理人”）经中国证监会证监基金字[2004]164号文批准，于2004年11月8日正式成立，注册资本为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2022年12月31日，公司共管理运作170只公募基金，公司业务范围涵盖二级市场股票投资、债券投资、现金管理、衍生品投资等。公司始终秉承“稳健理财，值得信赖”的理念，坚持为投资者带来优质的基金产品和理财服务。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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

杨超	指数与数量投资部总经理、本基金基金经理	2022年01月	-	12年	男，金融数学与计算硕士。历任建信基金管理有限责任公司基金经理助理、泰达宏利基金管理有限公司基金经理。2019年1月加盟本公司。
林心龙	本基金基金经理助理	2022年01月	-	7年	男，光学工程专业硕士。历任南方基金管理股份有限公司研究员、新华基金管理股份有限公司基金经理助理，2019年8月加盟本公司，历任高级研究员。

注：1、上述任职日期/离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2、本基金经理助理协助基金经理进行投资、研究、头寸管理等日常工作。

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》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，对于不同投资合同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4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

2022年，权益市场一方面遭遇国内及国际众多超预期事件冲击，另一方面受到全球经济放缓、外资流动性收紧、国内增长偏缓等系统性因素制约，导致投资者预期转弱、风险偏好降低，虽然二季度及四季度出现阶段性上涨，但从全年维度来看，A股仍普遍遭遇了较大回撤。具体来说：中证全指下跌20.32%，沪深300下跌21.63%，中证500下跌20.31%，创业板指下跌29.37%，中证1000下跌21.58%。本基金于2022年1月成立，报告期内，基金管理人根据基金合同约定完成建仓，以基准指数为投资基础，通过选股模型围绕基准进行持续优化，力争在基准的行业分布内精选基本面更为优质的标的，并在结构化风险模型和优化器的辅助下构建收益风险比更具优势的投资组合。受益于上述策略的有效性，基金在报告期内取得了一定程度的超额收益。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2022年12月31日，天弘中证1000指数增强A基金份额净值为0.9352元，天弘中证1000指数增强C基金份额净值为0.9325元。报告期内份额净值增长率天弘中证1000指数增强A为-6.48%，同期业绩比较基准增长率为-20.49%；天弘中证1000指数增强C为-6.75%，同期业绩比较基准增长率为-20.49%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2023年，我们认为国内宏观经济环境将步入复苏通道并拾级而上，市场流动性料将保持充裕，伴随生产生活全面恢复，货币端向信用端的传导将更为顺畅，并促进实体融资需求逐步改善。总体而言，投资、生产、消费活动有望企稳回升，并进入相互促进的正向循环，居民和企业的预期及信心亦将伴随这一过程而逐步修复。虽然外部环境仍存在高度的不确定性，并可能对我国经济带来超预期扰动，但是国内需求扩大、产业数字化转型加速、民营经济不断恢复发展等众多积极因素仍将推动经济运行整体好转。基于国内巨大的消费市场、完善的产业链配套、持续的科技创新以及丰富的政策发力空间，我们对2023年的宏观经济环境持乐观态度，并对中国经济的中长期韧性和发展潜力抱有充分的信心。

证券市场方面，我们认为A股已具备较好的投资价值：一方面，随着防疫政策优化、国内经济活动复苏以及海外加息节奏趋缓，前期制约市场向上运行的不确定因素多数已边际好转；另一方面，经历过去一年的调整出清，市场估值已具备吸引力，投资的收益风险比明显改善。中长期看，在国内经济复苏、投资者信心修复的过程中，上市公司业绩有望逐步回稳，市场风险偏好亦将有所提升。同时，在国内流动性相对充裕以及海外通胀压力预期好转的背景下，A股料将迎来增量配置资金。总体来说，我们对国内证券市场在2023年的表现持相对乐观的态度。但是，也应看到当市场整体运行在波动率较大的区间时，无论是宽基指数还是细分行业指数，预测其变化的幅度、速率以及时间窗口的难度仍然较大，当未知因素变多时，一套以概率思维为指导的行之有效的应对方法，也许比更依赖单一结果的押注式预测更加具有现实意义。因此，我们亦鼓励投资者一方面以更长期的视角进行基金配置，更多考虑业绩与估值的匹配程度以及收益风险比，同时另一方面在投资时机以及投资品种上进行一定的分散化处理，以更好的进行风险对冲，最终力争实现收益的长期积累并更充分的发挥复利效应。

4.6 管理人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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人-天弘基金管理有限公司2022年01月04日至2022年12月31日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本托管人认为,天弘基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，天弘基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

§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(2023)第26232号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
--------	------

审计报告收件人	天弘中证1000指数增强型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一)我们审计的内容 我们审计了天弘中证1000指数增强型证券投资基金(以下简称“天弘中证1000基金”)的财务报表,包括2022年12月31日的资产负债表,2022年1月4日(基金合同生效日)至2022年12月31日止期间的利润表和净资产(基金净值)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,公允反映了天弘中证1000基金2022年12月31日的财务状况以及2022年1月4日(基金合同生效日)至2022年12月31日止期间的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于天弘中证1000基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	无
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>天弘中证1000基金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</p>

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

	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中证1000基金不能持续经营。(五) 评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	张振波、林佳璐
会计师事务所的地址	中国上海市浦东新区东育路588号前滩中心42楼
审计报告日期	2023-03-28

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：天弘中证1000指数增强型证券投资基金

报告截止日：2022年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022年12月31日
资产：		
银行存款	7.4.7.1	55,263,651.58
结算备付金		4,250,321.57
存出保证金		338,692.18
交易性金融资产	7.4.7.2	986,983,849.69
其中：股票投资		984,433,325.72
基金投资		-
债券投资		2,550,523.97
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-

其他投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
债权投资		-
其中：债券投资		-
资产支持证券投资		-
其他投资		-
其他债权投资		-
其他权益工具投资		-
应收清算款		588,716.78
应收股利		-
应收申购款		4,665,133.51
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.5	-
资产总计		1,052,090,365.31
负债和净资产	附注号	本期末 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		-
应付赎回款		4,558,400.18
应付管理人报酬		553,268.49
应付托管费		92,211.43
应付销售服务费		175,982.49
应付投资顾问费		-
应交税费		-
应付利润		-
递延所得税负债		-

其他负债	7.4.7.6	700,072.42
负债合计		6,079,935.01
净资产：		
实收基金	7.4.7.7	1,120,571,293.42
其他综合收益		-
未分配利润	7.4.7.8	-74,560,863.12
净资产合计		1,046,010,430.30
负债和净资产总计		1,052,090,365.31

注：1.报告截止日2022年12月31日，天弘中证1000指数增强型证券投资基金A类基金份额净值0.9352元，天弘中证1000指数增强型证券投资基金C类基金份额净值0.9325元；基金份额总额1,120,571,293.42份，其中天弘中证1000指数增强型证券投资基金A类基金份额412,377,610.84份，天弘中证1000指数增强型证券投资基金C类基金份额708,193,682.58份。

2.本财务报表的实际编制期间为2022年01月04日(基金合同生效日)至2022年12月31日，无上一年度可比期间(下同)。

7.2 利润表

会计主体：天弘中证1000指数增强型证券投资基金

本报告期：2022年01月04日（基金合同生效日）至2022年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022年01月04日（基金合同 生效日）至2022年12月31 日
一、营业总收入		-50,818,341.08
1.利息收入		509,551.66
其中：存款利息收入	7.4.7.9	509,551.66
债券利息收入		-
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		-
证券出借利息收入		-
其他利息收入		-

2.投资收益（损失以“-”填列）		-1,856,306.35
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-8,313,665.44
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.11	12,295.13
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	-
股利收益	7.4.7.15	6,445,063.96
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-
其他投资收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-49,911,748.28
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	440,161.89
减：二、营业总支出		6,420,339.42
1. 管理人报酬		4,681,814.71
2. 托管费		780,302.45
3. 销售服务费		847,638.74
4. 投资顾问费		-
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 信用减值损失	7.4.7.18	-
7. 税金及附加		-
8. 其他费用	7.4.7.19	110,583.52
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-57,238,680.50
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-57,238,680.50
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		-57,238,680.50

7.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：天弘中证1000指数增强型证券投资基金

本报告期：2022年01月04日（基金合同生效日）至2022年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月04日（基金合同生效日）至2022年12月31日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	-	-	-	-
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	801,558,434.01	-	-	801,558,434.01
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	319,012,859.41	-	-74,560,863.12	244,451,996.29
（一）、综合收益总额	-	-	-57,238,680.50	-57,238,680.50
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	319,012,859.41	-	-17,322,182.62	301,690,676.79
其中：1.基金申购款	1,705,339,888.54	-	-44,893,416.85	1,660,446,471.69
2.基金赎回款	-1,386,327,029.13	-	27,571,234.23	-1,358,755,794.90
（三）、本期向	-	-	-	-

基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)				
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	1,120,571,293.42	-	-74,560,863.12	1,046,010,430.30

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:

郭树强

薄贺龙

薄贺龙

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

天弘中证1000指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)本基金经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监基金字[2021]3444号《关于准予天弘中证1000指数增强型证券投资基金注册的批复》准予注册,由天弘基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘中证1000指数增强型证券投资基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币801,034,186.25元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2022)第0015号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《天弘中证1000指数增强型证券投资基金合同》于2022年1月4日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为801,558,434.01份基金份额,其中认购资金利息折合524,247.76份基金份额。本基金的基金管理人为天弘基金管理有限公司,基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《天弘中证1000指数增强型证券投资基金合同》和《天弘中证1000指数增强型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金根据认购/申购费用、赎回费用、销售服务费用收取方式的差异,将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购、赎回基金时收取认购/申购费用、赎回费用,并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为天弘中证1000指数增强型证券投资基金A类基金份额(以下简称“A类基金份额”);在投资人

认购/申购基金时不收取认购/申购费用、赎回时收取赎回费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为天弘中证1000指数增强型证券投资基金C类基金份额(以下简称“C类基金份额”)。本基金A类基金份额和C类基金份额分别设置代码，由于基金费用的不同，本基金A类基金份额及C类基金份额分别计算并公告基金份额净值和基金份额累计净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。投资者可自行选择认购/申购某一类别的基金份额。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘中证1000指数增强型证券投资基金合同》的有关规定，本基金的投资对象是具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括创业板及其他经中国证监会允许上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、金融债、地方政府债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券）、货币市场工具、同业存单、银行存款、债券回购、股指期货、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可以根据相关法律法规的规定参与融资和转融通证券出借业务。本基金投资于股票的资产不低于基金资产的90%，投资于标的指数成份股、备选成份股的资产的比例不低于非现金基金资产的80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为：中证1000指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。

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2023年3月28日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《天弘中证1000指数增强型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2022年01月04日(基金合同生效日)至2022年12月31日止期间财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2022年12月31日的财务状况以及2022年

01月04日(基金合同生效日)至2022年12月31日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2022年01月04日(基金合同生效日)至2022年12月31日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产

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

债务工具

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

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资、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 and 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。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

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。

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、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为

基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

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》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

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

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和可交换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和可交换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间

同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

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

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

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

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

(3)对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内

(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

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

(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 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2022年12月31日
活期存款	55,263,651.58
等于：本金	55,251,251.50
加：应计利息	12,400.08
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	55,263,651.58

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2022年12月31日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		1,034,342,369.00	-	984,433,325.72	-49,909,043.28
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	2,502,455.00	50,773.97	2,550,523.97	-2,705.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	2,502,455.00	50,773.97	2,550,523.97	-2,705.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,036,844,824.00	50,773.97	986,983,849.69	-49,911,748.28

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 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	620,072.42
其中：交易所市场	620,072.42
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	80,000.00
合计	700,072.42

7.4.7.7 实收基金

7.4.7.7.1 天弘中证1000指数增强A

金额单位：人民币元

项目 (天弘中证1000指数增强A)	本期 2022年01月04日（基金合同生效日）至2022年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	691,065,976.04	691,065,976.04
本期申购	170,600,345.37	170,600,345.37
本期赎回（以“-”号填列）	-449,288,710.57	-449,288,710.57
本期末	412,377,610.84	412,377,610.84

7.4.7.7.2 天弘中证1000指数增强C

金额单位：人民币元

项目 (天弘中证1000指数增强C)	本期 2022年01月04日（基金合同生效日）至2022年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	110,492,457.97	110,492,457.97
本期申购	1,534,739,543.17	1,534,739,543.17
本期赎回（以“-”号填列）	-937,038,318.56	-937,038,318.56
本期末	708,193,682.58	708,193,682.58

注：1、申购含转换转入份额；赎回含转换转出份额。

2、本基金合同于2022年01月04日生效,基金合同生效日的基金份额总额为801,558,434.01份基金份额，其中认购资金利息折合524,247.76份基金份额。

7.4.7.8 未分配利润

7.4.7.8.1 天弘中证1000指数增强A

单位：人民币元

项目 (天弘中证1000指数增强A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	-13,933,696.32	-10,884,023.32	-24,817,719.64
本期基金份额交易产生的变动数	5,692,841.23	-7,605,532.47	-1,912,691.24
其中：基金申购款	-3,284,510.81	-852,625.31	-4,137,136.12
基金赎回款	8,977,352.04	-6,752,907.16	2,224,444.88
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-8,240,855.09	-18,489,555.79	-26,730,410.88

7.4.7.8.2 天弘中证1000指数增强C

单位：人民币元

项目 (天弘中证1000指数增强C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	6,606,764.10	-39,027,724.96	-32,420,960.86
本期基金份额交易产生的变动数	-22,724,763.32	7,315,271.94	-15,409,491.38
其中：基金申购款	-31,852,413.25	-8,903,867.48	-40,756,280.73
基金赎回款	9,127,649.93	16,219,139.42	25,346,789.35
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-16,117,999.22	-31,712,453.02	-47,830,452.24

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月04日（基金合同生效日）至2022年12月31日
活期存款利息收入	455,699.88
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	50,072.38
其他	3,779.40
合计	509,551.66

7.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月04日（基金合同生效日）至2022年12月31日
卖出股票成交总额	4,159,845,355.84
减：卖出股票成本总额	4,160,935,886.83
减：交易费用	7,223,134.45
买卖股票差价收入	-8,313,665.44

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 2022年01月04日（基金合同生效日）至2022年12月31日
债券投资收益——利息收入	13,715.17
债券投资收益——买卖债券 （债转股及债券到期兑付） 差价收入	-1,420.04

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	12,295.13

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
	2022年01月04日（基金合同生效日）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	6,092,715.15
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	6,008,174.00
减：应计利息总额	85,955.15
减：交易费用	6.04
买卖债券差价收入	-1,420.04

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期未取得资产支持证券投资收益。

7.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期未取得贵金属投资收益。

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期未取得买卖权证差价收入。

7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期未取得其他衍生工具投资收益。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月04日（基金合同生效日）至2022年12月31日
股票投资产生的股利收益	6,445,063.96
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	6,445,063.96

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2022年01月04日（基金合同生效日）至2022年12月31日
1.交易性金融资产	-49,911,748.28
——股票投资	-49,909,043.28
——债券投资	-2,705.00
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-49,911,748.28

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月04日（基金合同生效日）至2022年12月31日

基金赎回费收入	433,518.43
基金转换费收入	6,643.46
合计	440,161.89

7.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内未发生信用减值损失。

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月04日（基金合同生效日）至2022年12月31日
审计费用	80,000.00
信息披露费	-
证券出借违约金	-
汇划手续费	30,183.52
开户费	400.00
合计	110,583.52

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、基金销售机构、基金注册登记机构
中国农业银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
蚂蚁科技集团股份有限公司	基金管理人的股东
天津信托有限责任公司	基金管理人的股东

内蒙古君正能源化工集团股份有限公司	基金管理人的股东
芜湖高新投资有限公司	基金管理人的股东
新疆天瑞博丰股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
新疆天惠新盟股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
新疆天阜恒基股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
新疆天聚宸兴股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
天弘创新资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

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 2022年01月04日（基金合同生效日）至2022年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	4,681,814.71
其中：支付销售机构的客户维护费	2,037,912.64

注:1、支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值0.60%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日管理人报酬=前一日基金资产净值×该日适用费率/当年天数。

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

7.4.10.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期
	2022年01月04日(基金合同生效日)至2022年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	780,302.45

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

7.4.10.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2022年01月04日(基金合同生效日)至2022年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	天弘中证1000指数增强A	天弘中证1000指数增强C	合计
天弘基金管理有限公司	-	180,348.63	180,348.63
中国农业银行股份有限公司	-	20,767.43	20,767.43
合计	-	201,116.06	201,116.06

注:1、支付基金销售机构的销售服务费按前一日各级基金资产净值的约定年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给天弘基金管理有限公司,再由天弘基金管理有

限公司计算并支付给各基金销售机构。天弘中证1000指数增强C按0.30%计提销售服务费。销售服务费的计算公式为：

日销售服务费=前一日各级基金资产净值×该日适用费率/当年天数。

2、天弘中证1000指数增强A不收取销售服务费。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行过银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月04日（基金合同生效日）至2022年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行股份有限公司	55,263,651.58	455,699.88

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

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期未在承销期内参与关联方承销证券交易。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况--固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期无利润分配事项。

7.4.12 期末（2022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
688432	有研硅	2022-11-03	6个月	科创板打新限售	9.91	11.24	20,044	198,636.04	225,294.56	-
688496	C清越	2022-12-21	6个月	科创板打新限售	9.16	8.65	12,000	109,920.00	103,800.00	-
600459	贵研铂业	2022-12-22	1个月内（含）	配股未上市	10.91	15.74	3,990	43,530.90	62,802.60	-
301269	华大九天	2022-07-21	6个月	创业板打新限售	32.69	87.94	659	21,542.71	57,952.46	-
301095	广立微	2022-07-2	6个月	创业板打	58.00	86.49	624	36,192.00	53,969.76	-

		8		新限售							
3013 27	华宝 新能	2022 -09-0 8	6个月	创业 板打 新限 售	237.5 0	176.9 7	242	57,47 5.00	42,82 6.74	-	
3012 39	普瑞 眼科	2022 -06-2 2	6个月	创业 板打 新限 售	33.65	69.68	575	19,34 8.75	40,06 6.00	-	
3013 67	怡和 嘉业	2022 -10-2 1	6个月	创业 板打 新限 售	119.8 8	175.7 8	223	26,73 3.24	39,19 8.94	-	
3011 75	中科 环保	2022 -06-3 0	6个月	创业 板打 新限 售	3.82	6.01	6,370	24,33 3.40	38,28 3.70	-	
3012 67	华夏 眼科	2022 -10-2 6	6个月	创业 板打 新限 售	50.88	66.20	578	29,40 8.64	38,26 3.60	-	
3011 65	锐捷 网络	2022 -11-1 4	6个月	创业 板打 新限 售	32.38	31.61	1,069	34,61 4.22	33,79 1.09	-	
3013 01	C川 宁	2022 -12-2 0	6个月	创业 板打 新限 售	5.00	7.53	3,574	17,87 0.00	26,91 2.22	-	
3011 52	天力 锂能	2022 -08-1 9	6个月	创业 板打 新限 售	57.00	46.64	433	24,68 1.00	20,19 5.12	-	

3013 91	卡莱 特	2022 -11-2 4	6个月	创业 板打 新限 售	96.00	80.97	247	23,71 2.00	19,99 9.59	-
3011 71	易点 天下	2022 -08-1 0	6个月	创业 板打 新限 售	18.18	17.72	985	17,90 7.30	17,45 4.20	-
3013 49	信德 新材	2022 -08-3 0	6个月	创业 板打 新限 售	138.8 8	103.5 2	157	21,80 4.16	16,25 2.64	-
3012 96	新巨 丰	2022 -08-2 6	6个月	创业 板打 新限 售	18.19	14.90	1,042	18,95 3.98	15,52 5.80	-
3013 28	维峰 电子	2022 -08-3 0	6个月	创业 板打 新限 售	78.80	76.96	191	15,05 0.80	14,69 9.36	-
3011 39	元道 通信	2022 -06-3 0	6个月	创业 板打 新限 售	38.46	25.31	566	21,76 8.36	14,32 5.46	-
3013 39	通行 宝	2022 -09-0 2	6个月	创业 板打 新限 售	18.78	15.59	913	17,14 6.14	14,23 3.67	-
3013 11	昆船 智能	2022 -11-2 3	6个月	创业 板打 新限 售	13.88	15.86	832	11,54 8.16	13,19 5.52	-
3012 30	泓博 医药	2022 -10-2	6个月	创业 板打	40.00	48.32	269	10,76 0.00	12,99 8.08	-

		1		新限售							
3013 96	宏景 科技	2022 -11-0 4	6个月	创业 板打 新限 售	40.13	31.90	396	15,89 1.48	12,63 2.40	-	
3013 38	凯格 精机	2022 -08-0 8	6个月	创业 板打 新限 售	46.33	48.99	257	11,90 6.81	12,59 0.43	-	
3013 66	一博 科技	2022 -09-1 9	6个月	创业 板打 新限 售	65.35	45.09	268	17,51 3.80	12,08 4.12	-	
3012 83	聚胶 股份	2022 -08-2 6	6个月	创业 板打 新限 售	52.69	51.41	235	12,38 2.15	12,08 1.35	-	
3012 90	东星 医疗	2022 -11-2 3	6个月	创业 板打 新限 售	44.09	35.13	330	14,54 9.70	11,59 2.90	-	
3011 32	满坤 科技	2022 -08-0 3	6个月	创业 板打 新限 售	26.80	24.48	468	12,54 2.40	11,45 6.64	-	
3012 77	新天 地	2022 -11-0 9	6个月	创业 板打 新限 售	27.00	25.78	439	11,85 3.00	11,31 7.42	-	
3012 82	金禄 电子	2022 -08-1 8	6个月	创业 板打 新限 售	30.38	25.25	434	13,18 4.92	10,95 8.50	-	

3013 61	众智 科技	2022 -11-0 8	6个月	创业 板打 新限 售	26.44	20.96	517	13,66 9.48	10,83 6.32	-
3012 65	华新 环保	2022 -12-0 8	6个月	创业 板打 新限 售	13.28	11.40	819	10,87 6.32	9,33 6.60	-
3011 76	逸豪 新材	2022 -09-2 1	6个月	创业 板打 新限 售	23.88	16.89	544	12,99 0.72	9,18 8.16	-
3012 27	森鹰 窗业	2022 -09-1 6	6个月	创业 板打 新限 售	38.25	29.49	284	10,86 3.00	8,37 5.16	-
3013 26	捷邦 科技	2022 -09-0 9	6个月	创业 板打 新限 售	51.72	36.62	227	11,74 0.44	8,31 2.74	-
3011 97	工大 科雅	2022 -07-2 9	6个月	创业 板打 新限 售	25.50	20.08	380	9,69 0.00	7,63 0.40	-
3011 61	唯万 密封	2022 -09-0 6	6个月	创业 板打 新限 售	18.66	21.73	346	6,45 6.36	7,51 8.58	-
3013 98	星源 卓镁	2022 -12-0 8	6个月	创业 板打 新限 售	34.40	28.94	255	8,77 2.00	7,37 9.70	-
3013 13	凡拓 数创	2022 -09-2	6个月	创业 板打	25.25	29.14	247	6,23 6.75	7,19 7.58	-

		2		新限售							
301285	鸿日达	2022-09-21	6个月	创业板打新限售	14.60	12.60	565	8,249.00	7,119.00	-	
301276	嘉曼服饰	2022-09-01	6个月	创业板打新限售	40.66	22.61	303	12,319.98	6,850.83	-	
301359	东南电子	2022-11-02	6个月	创业板打新限售	20.84	19.90	328	6,835.52	6,527.20	-	
301388	欣灵电气	2022-10-26	6个月	创业板打新限售	25.88	21.60	292	7,556.96	6,307.20	-	
301368	丰立智能	2022-12-07	6个月	创业板打新限售	22.33	18.52	337	7,525.21	6,241.24	-	
301300	远翔新材	2022-08-09	6个月	创业板打新限售	36.15	29.37	211	7,627.65	6,197.07	-	
301319	唯特偶	2022-09-22	6个月	创业板打新限售	47.75	53.27	115	5,491.25	6,126.05	-	
301270	汉仪股份	2022-08-19	6个月	创业板打新限售	25.68	28.37	210	5,392.80	5,957.70	-	

3012 31	荣信 文化	2022 -08-3 1	6个月	创业 板打 新限 售	25.49	20.38	275	7,00 9.75	5,60 4.50	-
3013 09	万得 凯	2022 -09-0 8	6个月	创业 板打 新限 售	39.00	24.46	228	8,89 2.00	5,57 6.88	-
3012 33	盛帮 股份	2022 -06-2 4	6个月	创业 板打 新限 售	41.52	34.30	158	6,56 0.16	5,41 9.40	-
3013 16	慧博 云通	2022 -09-2 9	6个月	创业 板打 新限 售	7.60	14.32	359	2,72 8.40	5,14 0.88	-

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

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

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2022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2022年12月31日，本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型指数基金，采用指数复制投资策略，按照个股在标的指数中的基准权重构建股票组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应地调整，以复制和跟踪标的指数。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，力争获取高于标的指数的投资收益。本基金的基金管理人奉行全面风险管理理念，建立了以审计与风险控制委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、内控合规部、风险管理部、内审部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。在全面风险管理体系的框架下，董事会负责监督检查公司的合法合规运营、内部控制、风险管理，从而控制公司的整体运营风险。在董事会下设立审计与风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理委员会，主要负责拟定公司风险管理战略，经董事会批准后组织实施；组织实施经董事会批准的年度风险预算、风险可容忍度限额及其他量化风险管理工具；根据公司总体风险控制目标，制定各业务和各环节风险控制目标和要求；落实公司就重大风险管理作出的决定或决议；听取并讨论会议议题，就重大风险管理事项形成决议；拟定或批准公司风险管理制度、流程。在业务操作层面风险管理职责主要由内控合规部和风险管理部负责，内控合规部负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理提供合规控制标准，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标；内控合规部对公司总经理负责，并由督察长分管。风险管理部通过投资交易系统的风控参数设置，保证各投资组合的投资比例合规；参与各投资组合新股申购、一级债申购、银行间交易等场外交易的风险识别与评估，保证各投资组合场外交易的事中合规控制；负责各投资组合投资绩效、大类风险的识别、计量和控制。风险管理部向公司首席风控官进行汇报。内审部对公司内部控制和风险管理的及时性、经营效率和效果等方面开展独立评价活动，向总经理和督察长汇报。本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风

险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款和定期存款存放在本基金的托管人中国农业银行股份有限公司及其他具有基金托管资格的国有银行和大型股份制银行，并实施不同区间的额度管理，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，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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2022年12月31日
A-1	-
A-1以下	-
未评级	2,550,523.97
合计	2,550,523.97

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

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末未持有短期信用评级的资产支持证券。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末未持有短期信用评级的同业存单。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末未持有长期信用评级的债券。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末未持有长期信用评级的资产支持证券。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末未持有长期信用评级的同业存单。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。此外，基金管理人经与基金托管人协商，在确保投资者得到公平对待的前提下，可依照法律法规及基金合同的约定，综合运用各类流动性风险管理工具，对赎回申请等进行适度调整，作为特定情形下基金管理人流动性风险管理的辅助措施。

于2022年12月31日，本基金所承担的全部金融负债的合约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。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理

人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注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。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。本期末，本基金组合资产中7个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

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

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

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2022年12月31日，本基金持有的交易性债券投资占基金净资产的比例为0.24%，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金采用指数增强型投资策略，以中证1000指数作为基金投资组合的标的指数，结合深入的宏观面、基本面研究及数量化投资技术，在指数化投资基础上优化调整投资组合。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于股票的资产不低于基金资产的90%，投资于标的指数成份股、备选成份股的资产的比例不低于非现金基金资产的80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

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 2022年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	984,433,325.72	94.11
交易性金融资产—基金投资	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-
其他	-	-
合计	984,433,325.72	94.11

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 2022年12月31日

	业绩比较基准上升5%	54,544,213.89
	业绩比较基准下降5%	-54,544,213.89

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

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年12月31日
第一层次	983,330,530.26
第二层次	2,550,523.97
第三层次	1,102,795.46
合计	986,983,849.69

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 2022年01月04日（基金合同生效日）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	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	2,489,352.60	2,489,352.60
转出第三层次	-	2,468,673.70	2,468,673.70
当期利得或损失总额	-	1,082,116.56	1,082,116.56
其中：计入损益的利得或损失	-	1,082,116.56	1,082,116.56
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,102,795.46	1,102,795.46
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	-	-335,184.31	-335,184.31

于2022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2022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	1,102,795.46	平均价格亚式期	预期年化波	0.1891~2.4756	负相关

资		权模型	动率		
---	--	-----	----	--	--

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2022年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	984,433,325.72	93.57
	其中：股票	984,433,325.72	93.57
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,550,523.97	0.24
	其中：债券	2,550,523.97	0.24
	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	59,513,973.15	5.66
8	其他各项资产	5,592,542.47	0.53
9	合计	1,052,090,365.31	100.00

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	5,165,409.00	0.49
B	采矿业	32,217,862.00	3.08
C	制造业	672,270,627.36	64.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	29,996,164.00	2.87
E	建筑业	36,550,257.22	3.49
F	批发和零售业	16,236,591.50	1.55
G	交通运输、仓储和邮政业	15,755,481.00	1.51
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	101,468,670.70	9.70
J	金融业	22,893,086.00	2.19
K	房地产业	15,560,790.00	1.49
L	租赁和商务服务业	9,251,257.00	0.88
M	科学研究和技术服务业	330,707.00	0.03
N	水利、环境和公共设施管理业	1,236,951.70	0.12
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	15,940,318.00	1.52
R	文化、体育和娱乐业	7,488,634.00	0.72
S	综合	89,088.00	0.01
	合计	982,451,894.48	93.92

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	1,605,414.42	0.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	196,494.51	0.02
J	金融业	82,553.38	0.01
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	36.75	0.00
M	科学研究和技术服务业	12,998.08	0.00
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	78,329.60	0.01
R	文化、体育和娱乐业	5,604.50	0.00
S	综合	-	-
	合计	1,981,431.24	0.19

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	300497	富祥药业	1,313,800	17,342,160.00	1.66
2	600481	双良节能	1,327,600	17,179,144.00	1.64
3	002036	联创电子	1,379,747	17,067,470.39	1.63

4	002324	普利特	1,047,300	16,756,800.00	1.60
5	600685	中船防务	800,400	16,616,304.00	1.59
6	002258	利尔化学	916,240	16,455,670.40	1.57
7	002421	达实智能	4,697,900	16,254,734.00	1.55
8	300377	赢时胜	1,937,100	15,903,591.00	1.52
9	688559	海目星	268,739	15,543,863.76	1.49
10	002091	江苏国泰	1,806,051	15,351,433.50	1.47
11	300602	飞荣达	1,064,600	15,319,594.00	1.46
12	600105	永鼎股份	4,473,500	15,254,635.00	1.46
13	000682	东方电子	1,849,700	14,871,588.00	1.42
14	000758	中色股份	3,091,600	14,685,100.00	1.40
15	300910	瑞丰新材	117,300	14,464,263.00	1.38
16	688518	联赢激光	473,875	13,841,888.75	1.32
17	603959	百利科技	1,302,500	13,767,425.00	1.32
18	002085	万丰奥威	2,263,200	13,466,040.00	1.29
19	300326	凯利泰	1,833,500	13,201,200.00	1.26
20	600478	科力远	1,403,000	13,160,140.00	1.26
21	002100	天康生物	1,563,200	12,990,192.00	1.24
22	603612	索通发展	494,533	12,867,748.66	1.23
23	002649	博彦科技	1,240,700	12,766,803.00	1.22
24	600206	有研新材	965,800	12,400,872.00	1.19
25	600583	海油工程	1,971,900	11,949,714.00	1.14
26	002517	恺英网络	1,763,700	11,569,872.00	1.11
27	002865	钧达股份	62,200	11,513,220.00	1.10
28	600129	太极集团	381,100	11,455,866.00	1.10
29	002176	江特电机	655,400	11,436,730.00	1.09
30	688366	昊海生科	115,947	11,309,470.38	1.08
31	601137	博威合金	754,500	11,174,145.00	1.07
32	002318	久立特材	639,800	10,646,272.00	1.02
33	002004	华邦健康	2,086,500	10,641,150.00	1.02
34	601567	三星医疗	784,200	10,571,016.00	1.01

35	002610	爱康科技	3,591,800	10,236,630.00	0.98
36	603032	德新科技	115,600	10,145,056.00	0.97
37	688321	微芯生物	443,991	9,758,922.18	0.93
38	000088	盐田港	1,911,600	9,691,812.00	0.93
39	002807	江阴银行	2,369,800	9,408,106.00	0.90
40	603279	景津装备	317,200	9,351,056.00	0.89
41	300143	盈康生命	896,100	9,113,337.00	0.87
42	600098	广州发展	1,616,200	8,969,910.00	0.86
43	300219	鸿利智汇	1,334,950	8,917,466.00	0.85
44	600590	泰豪科技	1,496,700	8,695,827.00	0.83
45	603690	至纯科技	228,900	8,661,576.00	0.83
46	603113	金能科技	934,500	8,475,915.00	0.81
47	600995	南网储能	583,500	8,414,070.00	0.80
48	688148	芳源股份	569,510	8,309,150.90	0.79
49	000517	荣安地产	2,810,100	8,289,795.00	0.79
50	000917	电广传媒	1,540,400	7,979,272.00	0.76
51	002139	拓邦股份	759,900	7,880,163.00	0.75
52	600750	江中药业	542,000	7,831,900.00	0.75
53	000860	顺鑫农业	260,600	7,771,092.00	0.74
54	605365	立达信	482,945	7,765,755.60	0.74
55	300332	天壕环境	633,100	7,590,869.00	0.73
56	000712	锦龙股份	582,000	7,531,080.00	0.72
57	603960	克来机电	424,719	7,530,267.87	0.72
58	600072	中船科技	624,600	7,432,740.00	0.71
59	300134	大富科技	930,817	7,223,139.92	0.69
60	002906	华阳集团	212,100	7,045,962.00	0.67
61	002044	美年健康	1,113,700	6,826,981.00	0.65
62	300456	赛微电子	454,200	6,713,076.00	0.64
63	300133	华策影视	1,241,000	6,614,530.00	0.63
64	603043	广州酒家	252,500	6,519,550.00	0.62
65	600284	浦东建设	958,800	6,462,312.00	0.62

66	002597	金禾实业	192,500	6,256,250.00	0.60
67	300035	中科电气	284,700	5,859,126.00	0.56
68	600602	云赛智联	618,200	5,384,522.00	0.51
69	600993	马应龙	236,700	5,349,420.00	0.51
70	600872	中炬高新	144,300	5,320,341.00	0.51
71	300725	药石科技	65,852	5,301,086.00	0.51
72	600210	紫江企业	1,003,900	5,019,500.00	0.48
73	300222	科大智能	790,200	5,017,770.00	0.48
74	300761	立华股份	143,700	4,921,725.00	0.47
75	002055	得润电子	569,000	4,904,780.00	0.47
76	000600	建投能源	907,400	4,763,850.00	0.46
77	300432	富临精工	329,300	4,751,799.00	0.45
78	000935	四川双马	223,300	4,689,300.00	0.45
79	605168	三人行	51,600	4,590,852.00	0.44
80	601975	招商南油	1,163,800	4,585,372.00	0.44
81	000603	盛达资源	357,300	4,487,688.00	0.43
82	300298	三诺生物	132,000	4,452,360.00	0.43
83	603876	鼎胜新材	107,200	4,399,488.00	0.42
84	002287	奇正藏药	192,400	4,396,340.00	0.42
85	002847	盐津铺子	38,400	4,158,336.00	0.40
86	000090	天健集团	750,000	4,095,000.00	0.39
87	600057	厦门象屿	397,900	4,086,433.00	0.39
88	600502	安徽建工	844,024	4,051,315.20	0.39
89	600246	万通发展	631,700	3,973,393.00	0.38
90	300616	尚品宅配	201,800	3,963,352.00	0.38
91	600100	同方股份	912,210	3,931,625.10	0.38
92	605007	五洲特纸	207,400	3,909,490.00	0.37
93	000567	海德股份	269,100	3,745,872.00	0.36
94	002276	万马股份	441,900	3,645,675.00	0.35
95	300607	拓斯达	243,400	3,541,470.00	0.34
96	002567	唐人神	499,852	3,538,952.16	0.34

97	002518	科士达	61,300	3,530,880.00	0.34
98	300791	仙乐健康	94,700	3,482,119.00	0.33
99	600720	祁连山	346,900	3,444,717.00	0.33
100	300123	亚光科技	582,500	3,442,575.00	0.33
101	002312	川发龙蟒	325,400	3,423,208.00	0.33
102	603313	梦百合	318,300	3,373,980.00	0.32
103	300770	新媒股份	89,500	3,370,570.00	0.32
104	688520	神州细胞	52,587	3,186,772.20	0.30
105	600675	中华企业	1,020,400	3,142,832.00	0.30
106	002291	遥望科技	239,100	3,108,300.00	0.30
107	688023	安恒信息	15,664	3,101,472.00	0.30
108	300748	金力永磁	104,900	3,069,374.00	0.29
109	002832	比音勒芬	117,000	2,996,370.00	0.29
110	603179	新泉股份	77,300	2,975,277.00	0.28
111	300856	科思股份	56,700	2,956,905.00	0.28
112	002626	金达威	133,546	2,767,073.12	0.26
113	300366	创意信息	281,400	2,707,068.00	0.26
114	603529	爱玛科技	57,400	2,632,938.00	0.25
115	000915	华特达因	54,100	2,461,550.00	0.24
116	301035	润丰股份	26,800	2,334,280.00	0.22
117	600305	恒顺醋业	185,400	2,282,274.00	0.22
118	600612	老凤祥	52,900	2,264,120.00	0.22
119	603601	再升科技	421,220	2,224,041.60	0.21
120	002544	普天科技	127,600	2,142,404.00	0.20
121	002839	张家港行	456,700	2,105,387.00	0.20
122	300294	博雅生物	54,400	1,988,864.00	0.19
123	688318	财富趋势	21,797	1,943,202.55	0.19
124	300567	精测电子	38,000	1,907,600.00	0.18
125	601126	四方股份	124,300	1,814,780.00	0.17
126	300487	蓝晓科技	24,300	1,691,037.00	0.16
127	300171	东富龙	70,400	1,670,592.00	0.16

128	603129	春风动力	14,500	1,631,540.00	0.16
129	601908	京运通	232,300	1,526,211.00	0.15
130	605388	均瑶健康	95,600	1,437,824.00	0.14
131	600366	宁波韵升	134,400	1,417,920.00	0.14
132	603896	寿仙谷	31,600	1,253,256.00	0.12
133	000546	金圆股份	98,900	1,198,668.00	0.11
134	002558	巨人网络	140,000	1,114,400.00	0.11
135	300663	科蓝软件	84,600	1,106,568.00	0.11
136	600395	盘江股份	163,000	1,095,360.00	0.10
137	688128	中国电研	55,503	947,991.24	0.09
138	600428	中远海特	153,100	912,476.00	0.09
139	600771	广誉远	32,200	895,804.00	0.09
140	600710	苏美达	150,400	884,352.00	0.08
141	300860	锋尚文化	16,800	874,104.00	0.08
142	600172	黄河旋风	180,500	873,620.00	0.08
143	600789	鲁抗医药	119,700	869,022.00	0.08
144	002446	盛路通信	90,800	868,048.00	0.08
145	300034	钢研高纳	17,100	783,864.00	0.07
146	002539	云图控股	69,400	771,728.00	0.07
147	300639	凯普生物	44,200	744,770.00	0.07
148	002643	万润股份	49,900	731,534.00	0.07
149	603098	森特股份	25,441	717,945.02	0.07
150	000016	深康佳 A	147,900	667,029.00	0.06
151	600966	博汇纸业	74,500	662,305.00	0.06
152	688425	铁建重工	166,483	657,607.85	0.06
153	603599	广信股份	21,300	626,220.00	0.06
154	300841	康华生物	7,300	617,726.00	0.06
155	688127	蓝特光学	38,624	615,280.32	0.06
156	002928	华夏航空	40,700	562,881.00	0.05
157	300203	聚光科技	16,000	542,400.00	0.05
158	002240	盛新锂能	14,300	536,107.00	0.05

159	688198	佰仁医疗	3,930	506,970.00	0.05
160	300659	中孚信息	16,500	440,055.00	0.04
161	603300	华铁应急	65,800	417,172.00	0.04
162	603733	仙鹤股份	13,100	399,157.00	0.04
163	600963	岳阳林纸	69,100	376,595.00	0.04
164	600114	东睦股份	34,500	293,250.00	0.03
165	300352	北信源	60,500	246,840.00	0.02
166	002234	民和股份	12,600	243,684.00	0.02
167	300031	宝通科技	15,900	219,897.00	0.02
168	603060	国检集团	16,900	218,010.00	0.02
169	600285	羚锐制药	13,900	181,256.00	0.02
170	000902	新洋丰	14,700	169,197.00	0.02
171	300662	科锐国际	3,200	156,800.00	0.01
172	000718	苏宁环球	46,900	154,770.00	0.01
173	000539	粤电力 A	27,300	151,515.00	0.01
174	300224	正海磁材	11,900	149,107.00	0.01
175	002216	三全食品	8,000	148,080.00	0.01
176	603027	千禾味业	7,000	145,460.00	0.01
177	600559	老白干酒	5,100	140,403.00	0.01
178	603105	芯能科技	9,500	139,935.00	0.01
179	603118	共进股份	17,200	136,740.00	0.01
180	688586	江航装备	6,508	106,080.40	0.01
181	000690	宝新能源	16,300	105,950.00	0.01
182	002961	瑞达期货	7,700	102,641.00	0.01
183	603306	华懋科技	2,700	101,007.00	0.01
184	688018	乐鑫科技	1,101	99,255.15	0.01
185	002405	四维图新	8,700	95,874.00	0.01
186	300887	谱尼测试	2,800	91,308.00	0.01
187	600770	综艺股份	12,800	89,088.00	0.01
188	600557	康缘药业	4,700	88,125.00	0.01
189	600458	时代新材	9,200	82,984.00	0.01

190	300737	科顺股份	6,100	76,738.00	0.01
191	600459	贵研铂业	3,990	62,802.60	0.01
192	300900	广联航空	2,100	60,333.00	0.01
193	000913	钱江摩托	3,100	57,288.00	0.01
194	300674	宇信科技	4,000	56,200.00	0.01
195	300170	汉得信息	5,000	40,700.00	0.00
196	002768	国恩股份	1,400	40,628.00	0.00
197	301175	中科环保	6,370	38,283.70	0.00
198	688106	金宏气体	1,900	35,644.00	0.00
199	002123	梦网科技	2,900	32,567.00	0.00
200	600063	皖维高新	5,200	30,420.00	0.00
201	600761	安徽合力	2,200	28,930.00	0.00
202	002292	奥飞娱乐	5,400	25,164.00	0.00
203	000928	中钢国际	4,000	23,520.00	0.00
204	688202	美迪西	100	21,389.00	0.00
205	002003	伟星股份	2,100	21,252.00	0.00
206	002261	拓维信息	3,200	21,216.00	0.00
207	688598	金博股份	81	17,777.88	0.00
208	000612	焦作万方	1,600	8,352.00	0.00
209	300343	联创股份	700	6,825.00	0.00
210	000811	冰轮环境	400	4,440.00	0.00
211	000557	西部创业	600	2,940.00	0.00
212	000976	华铁股份	800	2,936.00	0.00
213	688278	特宝生物	51	1,985.43	0.00
214	301238	瑞泰新材	75	1,686.75	0.00
215	688139	海尔生物	13	822.90	0.00
216	000652	泰达股份	200	806.00	0.00

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

号					值比例(%)
1	688047	龙芯中科	5,192	443,656.40	0.04
2	301301	C川宁	35,740	314,797.92	0.03
3	688432	有研硅	20,044	225,294.56	0.02
4	688496	C清越	12,000	103,800.00	0.01
5	601136	首创证券	4,739	82,553.38	0.01
6	001301	尚太科技	1,164	68,722.56	0.01
7	301269	华大九天	659	57,952.46	0.01
8	301095	广立微	624	53,969.76	0.01
9	301327	华宝新能	242	42,826.74	0.00
10	301239	普瑞眼科	575	40,066.00	0.00
11	301367	怡和嘉业	223	39,198.94	0.00
12	301267	华夏眼科	578	38,263.60	0.00
13	301165	锐捷网络	1,069	33,791.09	0.00
14	301152	天力锂能	433	20,195.12	0.00
15	301391	卡莱特	247	19,999.59	0.00
16	301171	易点天下	985	17,454.20	0.00
17	301349	信德新材	157	16,252.64	0.00
18	301296	新巨丰	1,042	15,525.80	0.00
19	301328	维峰电子	191	14,699.36	0.00
20	301139	元道通信	566	14,325.46	0.00
21	301339	通行宝	913	14,233.67	0.00
22	301160	翔楼新材	392	13,963.04	0.00
23	301311	昆船智能	832	13,195.52	0.00
24	301230	泓博医药	269	12,998.08	0.00
25	301396	宏景科技	396	12,632.40	0.00
26	301338	凯格精机	257	12,590.43	0.00
27	301366	一博科技	268	12,084.12	0.00
28	301283	聚胶股份	235	12,081.35	0.00
29	301290	东星医疗	330	11,592.90	0.00
30	301132	满坤科技	468	11,456.64	0.00

31	301277	新天地	439	11,317.42	0.00
32	301282	金禄电子	434	10,958.50	0.00
33	301361	众智科技	517	10,836.32	0.00
34	301220	亚香股份	285	10,496.55	0.00
35	301298	东利机械	634	9,605.10	0.00
36	301265	华新环保	819	9,336.60	0.00
37	301176	逸豪新材	544	9,188.16	0.00
38	301227	森鹰窗业	284	8,375.16	0.00
39	301326	捷邦科技	227	8,312.74	0.00
40	301197	工大科雅	380	7,630.40	0.00
41	301161	唯万密封	346	7,518.58	0.00
42	301398	星源卓镁	255	7,379.70	0.00
43	301313	凡拓数创	247	7,197.58	0.00
44	301285	鸿日达	565	7,119.00	0.00
45	301276	嘉曼服饰	303	6,850.83	0.00
46	301359	东南电子	328	6,527.20	0.00
47	301388	欣灵电气	292	6,307.20	0.00
48	301368	丰立智能	337	6,241.24	0.00
49	301300	远翔新材	211	6,197.07	0.00
50	301319	唯特偶	115	6,126.05	0.00
51	301270	汉仪股份	210	5,957.70	0.00
52	301231	荣信文化	275	5,604.50	0.00
53	301309	万得凯	228	5,576.88	0.00
54	301233	盛帮股份	158	5,419.40	0.00
55	301316	慧博云通	359	5,140.88	0.00
56	301102	兆讯传媒	1	36.75	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末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期末基金资产净值比例
----	------	------	----------	-------------

				(%)
1	600481	双良节能	43,500,772.38	4.16
2	002738	中矿资源	38,152,438.00	3.65
3	603688	石英股份	36,666,277.50	3.51
4	600105	永鼎股份	34,925,453.00	3.34
5	002258	利尔化学	34,922,391.40	3.34
6	002906	华阳集团	33,516,588.00	3.20
7	002192	融捷股份	32,977,361.83	3.15
8	600685	中船防务	32,719,653.46	3.13
9	000600	建投能源	31,278,051.34	2.99
10	002091	江苏国泰	30,825,806.68	2.95
11	300373	扬杰科技	28,867,629.92	2.76
12	002597	金禾实业	28,147,194.00	2.69
13	002176	江特电机	28,095,500.63	2.69
14	000762	西藏矿业	27,675,660.48	2.65
15	300602	飞荣达	26,982,336.85	2.58
16	601677	明泰铝业	26,787,058.17	2.56
17	603959	百利科技	26,608,141.70	2.54
18	603876	鼎胜新材	26,313,218.05	2.52
19	300118	东方日升	26,210,066.80	2.51
20	300143	盈康生命	25,460,779.93	2.43
21	002643	万润股份	25,309,137.75	2.42
22	300390	天华超净	24,315,609.43	2.32
23	601231	环旭电子	24,254,527.72	2.32
24	002100	天康生物	24,233,200.17	2.32
25	600873	梅花生物	24,231,898.15	2.32
26	002276	万马股份	24,060,921.00	2.30
27	688063	派能科技	24,048,205.01	2.30
28	300233	金城医药	23,966,389.00	2.29
29	000682	东方电子	23,367,044.50	2.23
30	603599	广信股份	23,275,010.91	2.23

31	300604	长川科技	23,233,969.99	2.22
32	603612	索通发展	23,225,121.74	2.22
33	603328	依顿电子	23,153,940.95	2.21
34	300573	兴齐眼药	23,128,217.00	2.21
35	002649	博彦科技	22,787,086.00	2.18
36	300432	富临精工	22,260,272.02	2.13
37	300171	东富龙	22,203,299.00	2.12
38	002567	唐人神	22,177,274.28	2.12
39	300226	上海钢联	22,143,328.50	2.12
40	600499	科达制造	22,140,592.15	2.12
41	002573	清新环境	21,920,522.71	2.10
42	603565	中谷物流	21,852,857.24	2.09
43	300393	中来股份	21,525,681.00	2.06
44	600929	雪天盐业	21,252,498.32	2.03
45	002324	普利特	21,224,207.14	2.03

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

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期末基金资产净值比例 (%)
1	002738	中矿资源	38,468,890.44	3.68
2	603688	石英股份	37,954,525.82	3.63
3	002192	融捷股份	30,480,416.88	2.91
4	300373	扬杰科技	30,430,775.39	2.91
5	000600	建投能源	29,056,918.79	2.78
6	000762	西藏矿业	28,867,711.56	2.76
7	600481	双良节能	28,739,757.22	2.75
8	601677	明泰铝业	28,595,210.12	2.73
9	600873	梅花生物	26,301,421.98	2.51

10	300118	东方日升	26,097,120.00	2.49
11	300390	天华超净	25,145,973.14	2.40
12	002906	华阳集团	24,972,664.40	2.39
13	300573	兴齐眼药	24,444,871.32	2.34
14	300233	金城医药	24,049,278.00	2.30
15	300769	德方纳米	23,911,470.08	2.29
16	600266	城建发展	23,538,112.00	2.25
17	601231	环旭电子	23,352,489.15	2.23
18	000543	皖能电力	23,161,081.86	2.21
19	600499	科达制造	22,720,885.00	2.17
20	300604	长川科技	22,603,902.06	2.16
21	603599	广信股份	22,392,577.20	2.14
22	002573	清新环境	22,263,099.11	2.13
23	688063	派能科技	22,238,454.11	2.13
24	002756	永兴材料	22,156,595.96	2.12
25	600929	雪天盐业	21,976,441.80	2.10
26	688339	亿华通	21,692,835.36	2.07
27	002643	万润股份	21,618,940.81	2.07
28	600641	万业企业	21,459,844.00	2.05
29	603328	依顿电子	21,364,956.00	2.04
30	600248	陕西建工	21,207,332.00	2.03
31	300226	上海钢联	21,178,650.76	2.02
32	002597	金禾实业	21,097,190.00	2.02
33	002446	盛路通信	20,945,321.67	2.00

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	5,195,278,255.83
卖出股票收入（成交）总额	4,159,845,355.84

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	2,550,523.97	0.24
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,550,523.97	0.24

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	019666	22国债01	25,000	2,550,523.97	0.24

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

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

8.12.2 基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	338,692.18
2	应收清算款	588,716.78
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	4,665,133.51
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,592,542.47

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限情况。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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	688432	有研硅	225,294.56	0.02	科创板打新限售
2	688496	清越科技	103,800.00	0.01	科创板打新限售
3	301301	川宁生物	26,912.22	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

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
天弘中证1000指数增强A	12,129	33,999.31	3,803,675.46	0.92%	408,573,935.38	99.08%
天弘中证1000指数增强C	19,184	36,915.85	141,998,204.06	20.05%	566,195,478.52	79.95%
合计	30,962	36,191.83	145,801,879.52	13.01%	974,769,413.90	86.99%

注：机构/个人投资者持有基金份额占总份额比例的计算中，针对分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	天弘中证1000指数增强A	521,140.01	0.13%
	天弘中证1000指数增强C	131,994.41	0.02%
	合计	653,134.42	0.06%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	天弘中证1000指数增强A	10~50
	天弘中证1000指数增强C	0
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	天弘中证1000指数增强A	10~50
	天弘中证1000指数增强C	0
	合计	10~50

§10 开放式基金份额变动

单位：份

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

基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	170,600,345.37	1,534,739,543.17
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	449,288,710.57	937,038,318.56
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	412,377,610.84	708,193,682.58

注：本基金合同于2022年01月04日生效。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，常勇先生任职公司副总经理，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》。

2022年3月，中国农业银行总行决定王霄勇任托管业务部总裁。

2022年3月，中国农业银行总行决定王洪滨任托管业务部高级专家。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

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80,000.00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1年。

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

本基金托管人及其高级管理人员在开展基金托管业务过程中无受稽查或处罚等情况。

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	
长江证券	1	-	-	-	-	-
诚通证券	2	-	-	-	-	-
第一创业证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	9,192,390,895.44	98.57%	2,126,245.95	95.62%	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中信建投证券	2	-	-	-	-	-
中信	3	133,323,911.28	1.43%	97,501.15	4.38%	-

证券						
----	--	--	--	--	--	--

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

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

3、本基金报告期内新租用交易单元：第一创业证券上海交易单元、第一创业证券深圳交易单元、中信证券北交所交易单元。

4、本基金报告期内停止租用交易单元：诚通证券上海交易单元、诚通证券深圳交易单元。

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
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
诚通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
第一创业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	14,517,389.00	100.00%	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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资产管理产品执行新金融工具相关会计准则的公告	中国证监会规定媒介	2022-01-04

2	天弘中证1000指数增强型证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会规定媒介	2022-01-05
3	天弘中证1000指数增强型证券投资基金产品资料概要（更新）	中国证监会规定媒介	2022-01-06
4	天弘基金管理有限公司关于天弘中证1000指数增强型证券投资基金开放日常申购、赎回、定期定额投资及转换业务的公告	中国证监会规定媒介	2022-01-15
5	天弘基金管理有限公司运用固有资金投资旗下公募基金的公告	中国证监会规定媒介	2022-03-17
6	天弘中证1000指数增强型证券投资基金2022年第一季度报告	中国证监会规定媒介	2022-04-22
7	天弘基金管理有限公司关于终止深圳前海凯恩斯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	2022-04-22
8	天弘基金管理有限公司关于设立浙江分公司公告	中国证监会规定媒介	2022-04-26
9	天弘基金管理有限公司关于注销天津理财中心的公告	中国证监会规定媒介	2022-05-06
10	天弘基金管理有限公司关于调整旗下部分基金在基金销售机构及直销机构的单笔最低申购金额、单笔最低赎回份额及最低持有份额的公告	中国证监会规定媒介	2022-06-16
11	天弘中证1000指数增强型证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会规定媒介	2022-06-21

12	天弘基金管理有限公司关于在网上直销交易系统开通中信银行快捷支付业务并实施相关费率优惠的公告	中国证监会规定媒介	2022-07-04
13	天弘基金管理有限公司关于增加贵州银行股份有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投、转换业务以及参加其费率优惠活动的公告	中国证监会规定媒介	2022-07-14
14	天弘中证1000指数增强型证券投资基金2022年第二季度报告	中国证监会规定媒介	2022-07-21
15	天弘中证1000指数增强型证券投资基金产品资料概要（更新）	中国证监会规定媒介	2022-08-11
16	天弘中证1000指数增强型证券投资基金2022年中期报告	中国证监会规定媒介	2022-08-31
17	天弘中证1000指数增强型证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会规定媒介	2022-10-21
18	天弘中证1000指数增强型证券投资基金2022年第三季度报告	中国证监会规定媒介	2022-10-26
19	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	2022-11-19

§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

本报告期内，本基金未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过本基金总份额20%的情况。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据《企业会计准则第22号—金融工具确认和计量》（财会(2017)7号）、《企业会计准则第23号—金融资产转移》（财会(2017)8号）、《企业会计准则第24号—套期会计》（财会(2017)9号）、《企业会计准则第37号—金融工具列报》（财会(2017)14号）和《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》（财会〔2020〕22号）等相关规定，自2022年1月1日起，天弘基金管理有限公司旗下资产管理产品开始执行新金融工具相关会计准则。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旗下资产管理产品执行新金融工具相关会计准则的公告》。

本报告期内，基金管理人根据法律法规及《基金合同》等法律文件相关规定，调整了本基金在基金销售机构及直销机构的单笔最低申购金额、单笔最低赎回份额及最低持有份额，并于2022年6月21日生效。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调整旗下部分基金在基金销售机构及直销机构的单笔最低申购金额、单笔最低赎回份额及最低持有份额的公告》。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准天弘中证1000指数增强型证券投资基金募集的文件
- 2、天弘中证1000指数增强型证券投资基金基金合同
- 3、天弘中证1000指数增强型证券投资基金托管协议
- 4、天弘中证1000指数增强型证券投资基金招募说明书
- 5、报告期内在指定报刊上披露的各项公告
- 6、中国证监会规定的其他文件

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
二〇二三年三月三十一日