

天弘中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

2024 年年度报告

2024 年 12 月 31 日

基金管理人:天弘基金管理有限公司

基金托管人:光大证券股份有限公司

送出日期:2025 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。

基金托管人光大证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2025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2024年01月01日起至2024年12月31日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	12
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	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	15
6.1 审计报告基本信息	15
6.2 审计报告的基本内容	15
§7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	20
7.3 净资产变动表	22
7.4 报表附注	24
§8 投资组合报告	52
8.1 期末基金资产组合情况	52
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	53
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	54
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	61
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	63
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	63
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	63
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	64
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	64
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	64

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	64
8.12 投资组合报告附注	64
§9 基金份额持有人信息	65
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	65
9.2 期末上市基金前十名持有人	65
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	66
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	66
§10 开放式基金份额变动	66
§11 重大事件揭示	66
11.1 基金份额持有人大会决议	66
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	67
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	67
11.4 基金投资策略的改变	67
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	67
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	67
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	67
11.8 其他重大事件	68
§12 影响投资者决策的其他重要信息	73
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	73
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	74
§13 备查文件目录	74
13.1 备查文件目录	74
13.2 存放地点	75
13.3 查阅方式	75

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	天弘中证1000增强策略ETF
场内简称	1000增强ETF天弘
基金主代码	159685
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2023年03月15日
基金管理人	天弘基金管理有限公司
基金托管人	光大证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	21,440,067.00份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2023年04月03日

2.2 基金产品说明

投资目标	在对标的指数进行有效跟踪被动投资基础上，通过量化策略进行组合投资，并结合增强型的主动投资力争获取超越业绩比较基准的超额收益，实现基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采用指数增强型投资策略，以中证1000指数作为基金投资组合的标的指数，结合深入的宏观面、基本面研究及数量化投资技术，在指数化投资基础上优化调整投资组合，力争控制本基金份额净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年跟踪误差不超过6.5%，以实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人将采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。本基金运作过程中，当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市，且指数编制机

	构暂未作出调整的，基金管理人应当按照基金份额持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。主要产品投资策略包括：资产配置策略、股票投资策略、存托凭证投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、股票期权投资策略、国债期货投资策略、参与融资及转融通证券出借业务的投资策略。
业绩比较基准	中证1000指数收益率
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	天弘基金管理有限公司	光大证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	童建林
	联系电话	022-83310208
	电子邮箱	service@thfund.com.cn
客户服务电话	95046	021-22167436
传真	022-83865564	021-22167424
注册地址	天津自贸试验区（中心商务区）新华路3678号宝风大厦23层	上海市新闻路1508号
办公地址	天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层	上海市新闻路1508号
邮政编码	300203	200040
法定代表人	黄辰立	刘秋明

2.4 信息披露方式

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

址	
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市东长安街1号东方广场毕马威大楼8层
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	2024年	2023年03月15日(基金合同生效日)-2023年12月31日
本期已实现收益	-438,413.94	-1,755,515.78
本期利润	1,076,229.41	-2,402,349.69
加权平均基金份额本期利润	0.0298	-0.0326
本期加权平均净值利润率	3.61%	-3.39%
本期基金份额净值增长率	9.40%	-10.87%
3.1.2 期末数据和指标	2024年末	2023年末
期末可供分配利润	-533,825.25	-5,809,036.74
期末可供分配基金份额利润	-0.0249	-0.1087
期末基金资产净值	20,906,241.75	47,631,030.26
期末基金份额净值	0.9751	0.8913
3.1.3 累计期末指标	2024年末	2023年末
基金份额累计净值增长率	-2.49%	-10.87%

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

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

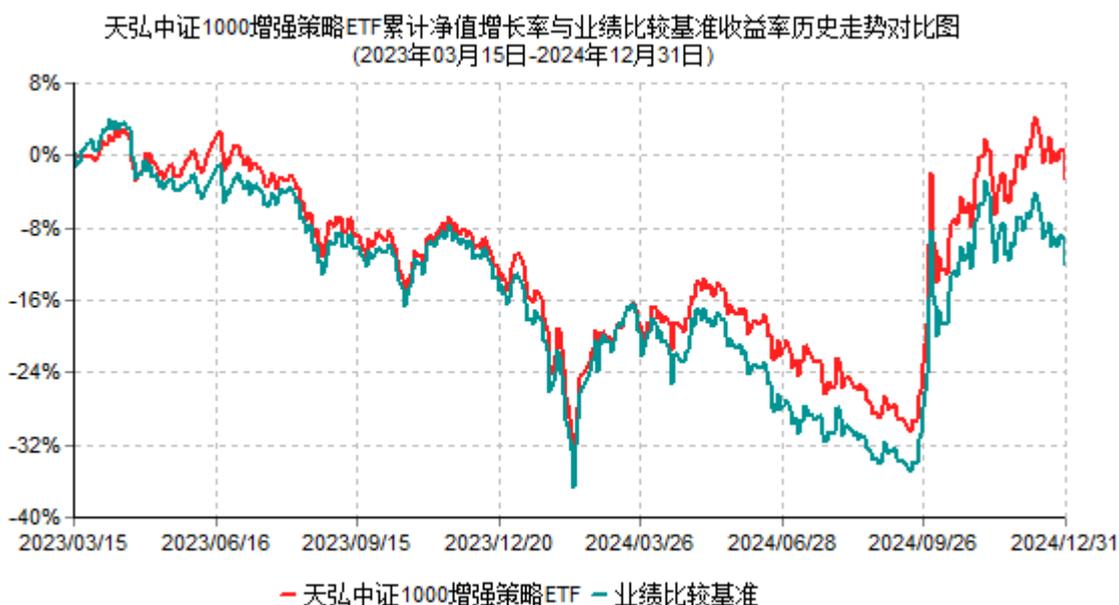
3、期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	8.07%	2.35%	4.36%	2.40%	3.71%	-0.05%
过去六个月	23.89%	2.23%	21.69%	2.24%	2.20%	-0.01%
过去一年	9.40%	2.09%	1.20%	2.12%	8.20%	-0.03%
自基金合同生效日起至 今	-2.49%	1.67%	-12.00%	1.70%	9.51%	-0.03%

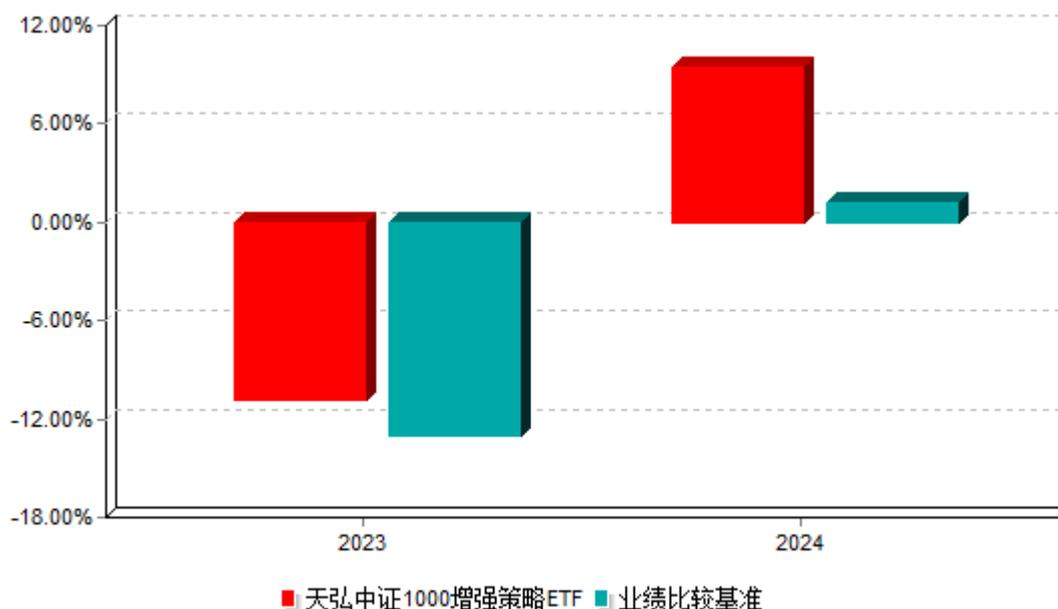
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、本基金合同于2023年03月15日生效。

2、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2023年03月15日生效。基金合同生效当年2023年的净值增长率按照基金合同生效后当年的实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

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

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

截至2024年12月31日，公司共管理运作210只公募基金，公司业务范围涵盖二级市场股票投资、债券投资、现金管理、衍生品投资等。公司始终秉承“稳健理财，值得信赖”的理念，坚持为投资者带来优质的基金产品和理财服务。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张戈	本基金基金经理	2023年03月	-	11年	男，管理科学与工程专业博士。历任建信基金管理有限责任公司研究员、投资经理，大家保险资产管理公司投资经理。2022年9月加盟本公司。
杨超	指数与数量投资部总经理、本基金基金经理	2023年03月	-	14年	男，金融数学与计算硕士。历任建信基金管理有限责任公司基金经理助理、泰达宏利基金管理有限公司基金经理。2019年1月加盟本公司。

注：1、上述任职日期/离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2、在本报告截止日至报告批准送出日之间，本基金管理人增聘林心龙先生为本基金基金经理，张戈先生不再担任本基金基金经理。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

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

本报告期内，本基金运作合法合规，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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2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，中证1000指数波动较大。2024年前三季度，在市场整体走势较弱的背景下，中小市值股票受到风格影响走势较差。9月底随着政策面大幅转暖，市场大涨，中证1000指数反弹，产品净值也有明显上升。基金管理人按照量化策略运作，不断迭代新因子，限制各类敞口风险，并尽量减少盘中申赎对产品的影响，产品取得超额收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2024年12月31日，本基金份额净值为0.9751元，本报告期份额净值增长率9.40%，同期业绩比较基准增长率1.20%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

中证1000指数成分股分散，行业分布均匀，上半年走势主要受到市场风格和流动性影响，小市值成长股长期处于逆风状态。叠加全市场流动性在二季度末出现衰减，以及量化行业受到政策监管等因素影响，指数跌幅显著。随着2024年三季度后货币政策和财政政策取向调整，国民经济将持续企稳向上，权益市场整体估值中枢有望震荡向上。中证1000作为中小市值代表性宽基，具备一定的向上弹性。

管理人在2024年二季度积极调整策略，在选股和风险控制两端都进行了模型更新迭代，产品超额收益明显改善。后续管理人将继续迭代选股因子，优化风险控制方案和交易成本控制方案，力争与产品风险等级相匹配的超额收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，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，监督投资管理人员及其配偶、利害关系人股票交易申报制度、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

本基金本报告期末进行利润分配，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

本基金已连续60个工作日基金资产净值低于5000万，已按照基金合同要求向中国证监会及其派出机构报告并提出持续运作的解决方案。2024年9月5日起由天弘基金自有资金承担本基金的审计费用、信息披露费用、ETF登记结算费用、IOPV计算与发布费用，不再从基金资产中计提。天弘基金自有资金承担上述费用的具体期间将在后续的基金定期报告中披露。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第2506408号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
--------	------

审计报告收件人	天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了后附的天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“该基金”)财务报表,包括2024年12月31日的资产负债表,2024年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》(以下合称“企业会计准则”)及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”)和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制,公允反映了该基金2024年12月31日的财务状况以及2024年度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(以下简称“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。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于该基金,并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	<p>该基金管理人天弘基金管理有限公司(以下简称“该基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括该基金2024年年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。</p> <p>我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读</p>

	<p>其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>该基金管理人管理层负责按照企业会计准则及财务报表附注7.4.2中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表，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。</p> <p>在编制财务报表时，该基金管理人管理层负责评估该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，除非该基金预计在清算时资产无法按照公允价值处置。</p> <p>该基金管理人治理层负责监督该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。</p> <p>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：</p> <p>(1) 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</p>

	<p>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。</p> <p>(2) 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。</p> <p>(3) 评价该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。</p> <p>(4) 对该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，就可能导致对该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该基金不能持续经营。</p> <p>(5) 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。</p> <p>我们与该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	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	左艳霞 李瑞丛
会计师事务所的地址	北京市东长安街1号东方广场毕马威大楼8层
审计报告日期	2025-03-27

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2024年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
资产：			
货币资金	7.4.7.1	736,136.78	2,050,219.39
结算备付金		415,909.74	407,902.84
存出保证金		218,253.20	490,679.63
交易性金融资产	7.4.7.2	19,514,092.34	44,983,105.04
其中：股票投资		19,514,092.34	44,983,105.04
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收清算款		27,090.59	174,872.02
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	48,359.68	-
资产总计		20,959,842.33	48,106,778.92
负债和净资产	附注号	本期末 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-

卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		7,377.87	330,854.23
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		10,423.93	19,270.05
应付托管费		2,084.79	3,854.02
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	33,713.99	121,770.36
负债合计		53,600.58	475,748.66
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	21,440,067.00	53,440,067.00
未分配利润	7.4.7.8	-533,825.25	-5,809,036.74
净资产合计		20,906,241.75	47,631,030.26
负债和净资产总计		20,959,842.33	48,106,778.92

注：1.报告截止日2024年12月31日，基金份额净值0.9751元，基金份额总额21,440,067.00份。

2.本财务报表的比较期间为2023年03月15日(基金合同生效日)至2023年12月31日(下同)。

7.2 利润表

会计主体：天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年01月01日至 2024年12月31日	上年度可比期间 2023年03月15日(基 金合同生效日)至2 023年12月31日
一、营业总收入		1,382,731.63	-1,878,275.57
1.利息收入		34,284.00	219,396.77

其中：存款利息收入	7.4.7.9	34,284.00	219,396.77
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		-228,738.78	-2,214,579.81
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-884,092.48	-2,632,602.99
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	-	-
资产支持证券投资	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	225,824.38	-219,043.86
股利收益	7.4.7.15	429,529.32	637,067.04
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	1,514,643.35	-646,833.91
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	62,543.06	763,741.38
减：二、营业总支出		306,502.22	524,074.12
1.管理人报酬		150,215.77	278,096.01
2.托管费		30,043.17	55,619.21
3.销售服务费		-	-
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-

6.信用减值损失	7.4.7.18	-	-
7.税金及附加		888.46	-
8.其他费用	7.4.7.19	125,354.82	190,358.90
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,076,229.41	-2,402,349.69
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,076,229.41	-2,402,349.69
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		1,076,229.41	-2,402,349.69

7.3 净资产变动表

会计主体：天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024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	53,440,067.00	-5,809,036.74	47,631,030.26
二、本期期初净资产	53,440,067.00	-5,809,036.74	47,631,030.26
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-32,000,000.00	5,275,211.49	-26,724,788.51
（一）、综合收益总额	-	1,076,229.41	1,076,229.41
（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	-32,000,000.00	4,198,982.08	-27,801,017.92

列)			
其中：1.基金申购款	104,000,000.00	-19,370,100.86	84,629,899.14
2.基金赎回款	-136,000,000.00	23,569,082.94	-112,430,917.06
(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	21,440,067.00	-533,825.25	20,906,241.75
项目	上年度可比期间		
	2023年03月15日(基金合同生效日)至2023年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-
二、本期期初净资产	281,440,067.00	-	281,440,067.00
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-228,000,000.00	-5,809,036.74	-233,809,036.74
(一)、综合收益总额	-	-2,402,349.69	-2,402,349.69
(二)、本期基金份额交易产生的净资产变动数(净资产减少以“-”号填列)	-228,000,000.00	-3,406,687.05	-231,406,687.05
其中：1.基金申购款	114,000,000.00	-3,639,256.25	110,360,743.75
2.基金赎回款	-342,000,000.00	232,569.20	-341,767,430.80
(三)、本期向基金份额持有人分配	-	-	-

利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）			
四、本期期末净资产	53,440,067.00	-5,809,036.74	47,631,030.26

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

高阳

薄贺龙

薄贺龙

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）[2022]3020号《关于准予天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》的准许，由基金管理人天弘基金管理有限公司向社会公开发行人募集，基金合同于2023年03月15日生效，首次设立募集规模为281,440,067.00份基金份额。本基金为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为天弘基金管理有限公司，基金托管人为光大证券股份有限公司。

根据《天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2023]223号文审核同意，本基金281,440,067.00份基金份额于2023年04月03日在深交所挂牌交易。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(含主板、创业板及其他中国证监会注册或核准上市的股票、存托凭证)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、衍生品(包括股指期货、股票期权、国债期货)、资产支持证券、货币市场工具、同业存单、债券回购、银行存款以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金可根据法律法规的规定参与融资、转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的80%，投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产不低于非现金基金资产的80%，因法律法规规定而受限的情形除外。股指期货、国债期货、股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定

执行。如法律法规或中国证监会变更上述投资品种的比例限制，以变更后的比例为准，基金管理人在依法履行适当程序后，可对本基金的投资比例做相应调整。

本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2025年03月27日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第2号《年度报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》、《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>》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会颁布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2024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2024年12月31日的财务状况以及2024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。比较财务报表的实际编制期间为2023年03月15日(基金合同生效日)至2023年12月31日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

本基金根据管理金融资产的业务模式和合同现金流量特征，在初始确认时将金融资产划分为以摊余成本计量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。本基金未持有以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；
- 该金融资产的合同条款规定，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。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

(2) 金融负债的分类

本基金将金融负债分类为以摊余成本计量的金融负债。本基金无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。

(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

(1) 金融工具的初始确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

(2) 金融工具的后续计量

初始确认后，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以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失(包括利息、股利收入和利息费用)计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

初始确认后，对于以摊余成本计量的金融资产和金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

(3) 金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 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；
- 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。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产在终止确认日的账面价值；

- 因转移金融资产而收到的对价。

金融负债(或其一部分)的现时义务已经解除的,本基金终止确认该金融负债(或部分金融负债)。

(4) 金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础,对以摊余成本计量的金融资产进行减值会计处理并确认损失准备。

预期信用损失,是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失,是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额,即全部现金短缺的现值。

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。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中,出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时,根据企业会计准则的规定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。

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和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值:

(1) 存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具,在估值日有报价的,除会计准则规定的情况外,将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量;估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的,采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价

值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，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，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 对不存在活跃市场的金融工具，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。采用估值技术确定公允价值时，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证券价格的重大事件，参考类似金融工具的现行市价及重大变化等因素，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的基金份额总额所对应的金额。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确认。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

利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

投资收益

股票投资收益、债券投资收益和衍生工具收益按相关金融资产于处置日成交金额与其初始计量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资，在其持有期间，按票面金额和票面利率计算的利息计入投资收益。

公允价值变动收益

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、衍生工具、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。不包括本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资在持有期间按票面利率计算的利息。

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。

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

本基金的每份基金份额享有同等分配权；

本基金收益分配方式为现金分红；

基金收益评价日核定的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，基金管理人可以进行收益分配；在收益评价日，基金管理人对基金份额净值增长率和标的指数同期增长率的计算方法如下：基金份额净值增长率为收益评价日基金份额净值与基金上市前一日基金份额净值之比减去1乘以100%（期间如发生基金份额折算、拆分或合并，则以基金份额折算日、经拆分或合并调整后的基金份额折算日为初始日重新计算）；标的指数同期增长率为收益评价日标的指数收盘值与基金上市前一日标的指数

收盘值之比减去1乘以100%（期间如发生基金份额折算、拆分或合并，则以基金份额折算日、经拆分或合并调整后的基金份额折算日为初始日重新计算）；

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。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值；

若基金合同生效不满3个月则可不进行收益分配；

法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人可对基金收益分配原则进行调整，无需召开基金份额持有人大会。

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

编制财务报表时，本基金需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入和支出的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本基金对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

对于证券交易所上市的股票，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《中国证券监督管理委员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。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，根据中基协发[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》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《关于固定收益品种的估值处理标准》在银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所及中国证券监督管理委员会认可的其他交易场所上市

交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外),采用第三方估值基准服务机构提供的价格数据进行估值。

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[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《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》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《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号文《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号文《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》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部 税务总局公告2024年第8号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》及其他相关税务法规和实务操作,本基金适用的主要税项列示如下:

a) 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,以管理人为增值税纳税人,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税;对国债、地方政府债利息收入以及金融同业往来取得的利息收入免征增值税;同业

存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。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。

b) 对证券投资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，股权的股息、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。

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

c) 对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）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。

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。

d) 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。自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

e) 对基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

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 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
活期存款	736,136.78	2,050,219.39
等于：本金	735,730.53	2,049,287.02
加：应计利息	406.25	932.37
减：坏账准备	-	-
定期存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
其中：存款期限1个月以	-	-

内		
存款期限1-3个月	-	-
存款期限3个月以上	-	-
其他存款	-	-
等于：本金	-	-
加：应计利息	-	-
减：坏账准备	-	-
合计	736,136.78	2,050,219.39

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年12月31日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	18,599,202.90	-	19,514,092.34	914,889.44
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	18,599,202.90	-	19,514,092.34	914,889.44
项目	上年度末 2023年12月31日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	45,630,898.95	-	44,983,105.04	-647,793.91
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-

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

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款估值增值。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2024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	1,238,240.00	-	-	-
--股指期货	1,238,240.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	1,238,240.00	-	-	-
项目	上年度末 2023年12月31日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	2,337,680.00	-	-	-
--股指期货	2,337,680.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-

合计	2,337,680.00	-	-	-
----	--------------	---	---	---

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IM2501	IM2501	1.00	1,191,160.00	-47,080.00
合计				-47,080.00
减：可抵销 期货暂收 款				-47,080.00
净额				-

注：1、买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

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

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末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 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
应收利息	-	-
其他应收款	48,359.68	-
待摊费用	-	-
合计	48,359.68	-

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	9,999.49	56,811.46
其中：交易所市场	9,999.49	56,811.46
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	23,714.50	64,958.90
合计	33,713.99	121,770.36

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	53,440,067.00	53,440,067.00
本期申购	104,000,000.00	104,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-136,000,000.00	-136,000,000.00
本期末	21,440,067.00	21,440,067.00

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	-2,691,464.84	-3,117,571.90	-5,809,036.74
本期期初	-2,691,464.84	-3,117,571.90	-5,809,036.74
本期利润	-438,413.94	1,514,643.35	1,076,229.41
本期基金份额交易产生的变动数	3,354,404.26	844,577.82	4,198,982.08
其中：基金申购款	-10,644,172.13	-8,725,928.73	-19,370,100.86

基金赎回款	13,998,576.39	9,570,506.55	23,569,082.94
本期已分配利润	-	-	-
本期末	224,525.48	-758,350.73	-533,825.25

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2 024年12月31日	上年度可比期间 2023年03月15日（基金合同生效 日）至2023年12月31日
活期存款利息收入	26,236.89	204,898.73
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	6,613.43	9,104.24
其他	1,433.68	5,393.80
合计	34,284.00	219,396.77

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日 至2024年12月31 日	上年度可比期间 2023年03月15日（基金合同 生效日）至2023年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	16,886.74	-4,361,994.74
股票投资收益——赎回差价收入	-900,979.22	1,729,391.75
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	-884,092.48	-2,632,602.99

7.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2024年01月01日至2024年12月31日	2023年03月15日（基金合同生效日）至2023年12月31日
卖出股票成交总额	230,818,666.12	418,720,386.85
减：卖出股票成本总额	230,498,719.54	422,244,904.71
减：交易费用	303,059.84	837,476.88
买卖股票差价收入	16,886.74	-4,361,994.74

7.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2024年01月01日至2024年12月31日	2023年03月15日（基金合同生效日）至2023年12月31日
赎回基金份额对价总额	112,430,917.06	341,767,430.80
减：现金支付赎回款总额	50,015,384.06	159,484,474.80
减：赎回股票成本总额	63,316,512.22	180,553,564.25
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	-900,979.22	1,729,391.75

7.4.7.11 债券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间未取得债券投资收益。

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期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 2024年01月01日至2 024年12月31日	上年度可比期间 2023年03月15日（基金合同生效 日）至2023年12月31日
期货投资	225,824.38	-219,043.86

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至 2024年12月31日	上年度可比期间 2023年03月15日（基金合同生效 日）至2023年12月31日
股票投资产生的股利收益	429,529.32	637,067.04
其中：证券出借权益补偿收入	-	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	429,529.32	637,067.04

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年01月01日至20 24年12月31日	上年度可比期间 2023年03月15日（基金合同生效日） 至2023年12月31日
1.交易性金融资产	1,562,683.35	-647,793.91
——股票投资	1,562,683.35	-647,793.91
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	-48,040.00	960.00
——权证投资	-	-
——期货投资	-48,040.00	960.00
3.其他	-	-
减：应税金融商品公允 价值变动产生的预估增	-	-

值税		
合计	1,514,643.35	-646,833.91

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2 024年12月31日	上年度可比期间 2023年03月15日（基金合同生效 日）至2023年12月31日
基金赎回费收入	-	-
基金转换费收入	-	-
ETF基金替代损益	62,543.06	763,741.38
合计	62,543.06	763,741.38

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 2024年01月01日至2 024年12月31日	上年度可比期间 2023年03月15日（基金合同生效 日）至2023年12月31日
审计费用	10,163.78	50,000.00
信息披露费	-	-
证券出借违约金	-	-
IOPV计算发布费	13,550.72	14,958.90
ETF登记结算费	101,640.32	125,000.00
开户费	-	400.00
合计	125,354.82	190,358.90

注：2024年9月5日起由天弘基金固有资金承担本基金的审计费用、信息披露费用、ETF登记结算费用、IOPV计算与发布费用，不再从基金资产中计提。

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年12月31日		上年度可比期间 2023年03月15日（基金合同生效日） 至2023年12月31日	
	成交金额	占当期 股票成 交总额 的比例	成交金额	占当期 股票成 交总额 的比例
光大证券 股份有限	270,489,684.66	59.68%	792,814,593.43	79.34%

公司				
----	--	--	--	--

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 债券交易

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债券交易。

7.4.10.1.4 债券回购交易

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债券回购交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
光大证券股份有限公司	117,604.99	74.18%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2023年03月15日（基金合同生效日）至2023年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
光大证券股份有限公司	344,409.74	87.74%	51,559.65	90.76%

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定。

2、根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自2024年7月1日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票

交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。该类佣金协议已根据此规定完成了更新。

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 2024年01月01日 至2024年12月31 日	上年度可比期间 2023年03月15日（基金合同 生效日）至2023年12月31 日
当期发生的基金应支付的管理费	150,215.77	278,096.01
其中：应支付销售机构的客户维护费	17,465.47	32,266.54
应支付基金管理人的净管理费	132,750.30	245,829.47

注:1、支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×该日适用费率/当年天数。

2、客户维护费是指基金管理人及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 2024年01月01日 至2024年12月31 日	上年度可比期间 2023年03月15日（基金合同生 效日）至2023年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	30,043.17	55,619.21

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

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期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

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

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

本基金本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

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 2024年01月01日至2024年12月31日		上年度可比期间 2023年03月15日（基金合同生效日） 至2023年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
光大证券股份有限公司	736,136.78	26,236.89	2,050,219.39	204,898.73

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

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券交易。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

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（2024年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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2024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2024年12月31日，本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是股票型指数基金，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。本基金在对标的指数进行有效跟踪被动投资基础上，通过量化策略进行组合投资，并结合增强型的主动投资力争获取超越业绩比较基准的超额收益，实现基金资产的长期增值。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；内控合规部由督察长分管。风险管理部通过投资交易系统的风控参数设置，保证各投资组合的投资比例合规；参与各投资组合新股申购、一级债申购、银行间交易等场外交易的风险识别与评估，保证各投资组合场外交易的事中合规控制；负责各投资组合投资绩效、大类风险的识别、计量和控制。风险管理部向公司首席风控官进行汇报。内审部对公司内部控制和风险管理的有效性，经营效率和效果等方面开展独立评价活动，向总经理和督察长汇报。本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款和定期存款存放在本基金的托管人光大证券股份有限公司开立于具有基金托管资格的银行的托管账户及其他具有基金托管资格的国有银行和大型股份制银行，并实施不同区间的额度管理，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，本基金以非约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司出借证券，本基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能

力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近1年的分类结果为A类，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

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

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末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2024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期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 2024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	736,136.78	-	-	-	736,136.78
结算备付金	415,909.74	-	-	-	415,909.74
存出保证金	39,579.20	-	-	178,674.00	218,253.20
交易性金融资产	-	-	-	19,514,092.34	19,514,092.34
应收清算款	-	-	-	27,090.59	27,090.59
其他资产	-	-	-	48,359.68	48,359.68
资产总计	1,191,625.72	-	-	19,768,216.61	20,959,842.33
负债					
应付清算款	-	-	-	7,377.87	7,377.87
应付管理人报酬	-	-	-	10,423.93	10,423.93
应付托管费	-	-	-	2,084.79	2,084.79
其他负债	-	-	-	33,713.99	33,713.99
负债总计	-	-	-	53,600.58	53,600.58
利率敏感度缺口	1,191,625.72	-	-	19,714,616.03	20,906,241.75
上年度末 2023年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	2,050,219.39	-	-	-	2,050,219.39
结算备付金	407,902.84	-	-	-	407,902.84
存出保证金	139,883.63	-	-	350,796.00	490,679.63
交易性金融资产	-	-	-	44,983,105.04	44,983,105.04
应收清算款	-	-	-	174,872.02	174,872.02
资产总计	2,598,005.86	-	-	45,508,773.06	48,106,778.92
负债					
应付清算款	-	-	-	330,854.23	330,854.23
应付管理人报酬	-	-	-	19,270.05	19,270.05
应付托管费	-	-	-	3,854.02	3,854.02
其他负债	-	-	-	121,770.36	121,770.36
负债总计	-	-	-	475,748.66	475,748.66

利率敏感度缺口	2,598,005.86	-	-	45,033,024.40	47,631,030.26
---------	--------------	---	---	---------------	---------------

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2024年12月31日，本基金未持有交易性债券投资(2023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(2023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。

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

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

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年12月31日		上年度末 2023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	19,514,092.34	93.34	44,983,105.04	94.44
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	19,514,092.34	93.34	44,983,105.04	94.44

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

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位：人民币元)	
		本期末 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
	业绩比较基准上升5%	1,048,228.51	2,350,721.67
	业绩比较基准下降5%	-1,048,228.51	-2,350,721.67

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	19,514,092.34	44,548,792.04
第二层次	-	434,313.00
第三层次	-	-
合计	19,514,092.34	44,983,105.04

7.4.14.2 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。

对于公开市场交易的证券投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，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投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2024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(2023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	19,514,092.34	93.10

	其中：股票	19,514,092.34	93.10
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	1,152,046.52	5.50
8	其他各项资产	293,703.47	1.40
9	合计	20,959,842.33	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	286,452.80	1.37
B	采矿业	459,692.00	2.20
C	制造业	11,335,336.49	54.22
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	714,217.00	3.42
E	建筑业	292,078.00	1.40
F	批发和零售业	866,197.00	4.14
G	交通运输、仓储和邮政业	897,406.00	4.29
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,728,061.25	13.05
J	金融业	588,967.00	2.82
K	房地产业	388,305.00	1.86

L	租赁和商务服务业	256,514.00	1.23
M	科学研究和技术服务业	404,394.80	1.93
N	水利、环境和公共设施管理业	51,794.00	0.25
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	244,677.00	1.17
S	综合	-	-
	合计	19,514,092.34	93.34

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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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	603881	数据港	12,768	289,195.20	1.38
2	688018	乐鑫科技	1,244	271,192.00	1.30
3	603236	移远通信	3,600	246,384.00	1.18
4	300857	协创数据	2,200	235,158.00	1.12
5	002245	蔚蓝锂芯	21,500	229,835.00	1.10
6	601126	四方股份	13,500	228,960.00	1.10
7	688183	生益电子	5,736	225,195.36	1.08
8	000415	渤海租赁	58,000	218,660.00	1.05
9	605333	沪光股份	6,700	218,621.00	1.05
10	600621	华鑫股份	13,200	217,536.00	1.04
11	002468	申通快递	21,100	213,743.00	1.02

12	002698	博实股份	12,500	212,500.00	1.02
13	300303	聚飞光电	31,100	212,102.00	1.01
14	688798	艾为电子	3,014	210,437.48	1.01
15	002705	新宝股份	13,900	208,500.00	1.00
16	301031	中熔电气	2,000	208,040.00	1.00
17	300685	艾德生物	9,100	207,480.00	0.99
18	600710	苏美达	22,300	207,390.00	0.99
19	300821	东岳硅材	26,300	204,088.00	0.98
20	600210	紫江企业	30,300	200,283.00	0.96
21	002534	西子洁能	18,000	199,980.00	0.96
22	002275	桂林三金	13,100	197,679.00	0.95
23	000062	深圳华强	8,800	197,120.00	0.94
24	600618	氯碱化工	19,900	196,214.00	0.94
25	603132	金徽股份	17,400	195,402.00	0.93
26	003039	顺控发展	14,900	194,892.00	0.93
27	002901	大博医疗	6,300	194,292.00	0.93
28	002249	大洋电机	32,800	192,536.00	0.92
29	002461	珠江啤酒	19,400	191,866.00	0.92
30	001914	招商积余	18,100	191,317.00	0.92
31	688336	三生国健	8,931	191,302.02	0.92
32	300570	太辰光	2,600	189,020.00	0.90
33	688088	虹软科技	4,882	188,249.92	0.90
34	002928	华夏航空	24,200	187,792.00	0.90
35	000550	江铃汽车	8,000	187,600.00	0.90
36	603162	海通发展	20,300	186,760.00	0.89
37	603171	税友股份	6,100	186,050.00	0.89
38	300770	新媒股份	4,600	185,886.00	0.89
39	300768	迪普科技	10,500	183,750.00	0.88
40	002773	康弘药业	9,300	182,280.00	0.87
41	600812	华北制药	35,100	181,467.00	0.87
42	603039	泛微网络	3,700	181,300.00	0.87

43	603299	苏盐井神	16,200	180,468.00	0.86
44	603328	依顿电子	18,300	180,438.00	0.86
45	300579	数字认证	5,700	179,094.00	0.86
46	688107	安路科技	6,015	177,923.70	0.85
47	002978	安宁股份	6,200	176,204.00	0.84
48	688083	中望软件	2,059	176,188.63	0.84
49	600273	嘉化能源	22,100	176,137.00	0.84
50	688321	微芯生物	9,464	175,841.12	0.84
51	600667	太极实业	25,400	175,768.00	0.84
52	002097	山河智能	23,300	174,750.00	0.84
53	603013	亚普股份	11,500	172,270.00	0.82
54	600320	振华重工	43,900	172,088.00	0.82
55	600420	国药现代	14,300	170,742.00	0.82
56	301180	万祥科技	11,000	170,170.00	0.81
57	603888	新华网	7,600	169,784.00	0.81
58	002212	天融信	26,100	168,345.00	0.81
59	301015	百洋医药	6,800	164,628.00	0.79
60	688123	聚辰股份	2,811	164,499.72	0.79
61	002267	陕天然气	19,400	163,930.00	0.78
62	300761	立华股份	8,180	159,182.80	0.76
63	688131	皓元医药	4,364	155,794.80	0.75
64	601963	重庆银行	16,400	152,192.00	0.73
65	605376	博迁新材	5,100	147,645.00	0.71
66	300182	捷成股份	24,900	146,163.00	0.70
67	002651	利君股份	19,600	143,668.00	0.69
68	300458	全志科技	3,700	143,412.00	0.69
69	688408	中信博	1,962	141,264.00	0.68
70	000791	甘肃能源	23,200	139,896.00	0.67
71	002967	广电计量	8,500	139,400.00	0.67
72	301050	雷电微力	2,660	137,202.80	0.66
73	600916	中国黄金	15,900	137,058.00	0.66

74	601528	瑞丰银行	24,100	135,683.00	0.65
75	600331	宏达股份	17,500	133,350.00	0.64
76	000029	深深房A	8,800	132,528.00	0.63
77	688608	恒玄科技	377	122,664.49	0.59
78	002214	大立科技	10,800	120,420.00	0.58
79	600575	淮河能源	30,000	119,100.00	0.57
80	000969	安泰科技	10,000	111,500.00	0.53
81	000795	英洛华	11,400	110,922.00	0.53
82	601886	江河集团	20,500	110,700.00	0.53
83	300492	华图山鼎	1,500	109,200.00	0.52
84	600285	羚锐制药	4,900	108,584.00	0.52
85	002239	奥特佳	35,100	107,055.00	0.51
86	300406	九强生物	7,700	102,872.00	0.49
87	600163	中闽能源	16,800	102,312.00	0.49
88	301078	孩子王	8,700	99,006.00	0.47
89	300083	创世纪	15,100	98,301.00	0.47
90	002837	英维克	2,400	96,960.00	0.46
91	300261	雅本化学	13,600	93,160.00	0.45
92	300623	捷捷微电	2,700	92,232.00	0.44
93	603583	捷昌驱动	3,700	91,427.00	0.44
94	000821	京山轻机	7,300	90,885.00	0.43
95	603025	大豪科技	5,900	89,975.00	0.43
96	603866	桃李面包	13,500	89,100.00	0.43
97	600787	中储股份	13,700	87,406.00	0.42
98	300123	亚光科技	15,000	87,000.00	0.42
99	300315	掌趣科技	15,700	86,350.00	0.41
100	605296	神农集团	3,100	85,870.00	0.41
101	605365	立达信	5,300	83,210.00	0.40
102	002125	湘潭电化	8,200	82,656.00	0.40
103	688232	新点软件	2,850	82,621.50	0.40
104	002043	兔宝宝	6,900	81,972.00	0.39

105	000555	神州信息	7,300	81,760.00	0.39
106	301219	腾远钴业	1,800	81,378.00	0.39
107	002626	金达威	5,300	80,030.00	0.38
108	600640	国脉文化	6,700	79,998.00	0.38
109	300641	正丹股份	3,200	79,488.00	0.38
110	688337	普源精电	2,013	78,507.00	0.38
111	300080	易成新能	17,300	75,601.00	0.36
112	000600	建投能源	13,100	74,146.00	0.35
113	600562	国睿科技	3,700	73,741.00	0.35
114	300151	昌红科技	4,100	69,700.00	0.33
115	300455	航天智装	5,000	64,800.00	0.31
116	300741	华宝股份	3,700	64,343.00	0.31
117	300232	洲明科技	9,300	63,891.00	0.31
118	300101	振芯科技	2,800	60,648.00	0.29
119	601969	海南矿业	7,900	56,011.00	0.27
120	300133	华策影视	7,500	54,150.00	0.26
121	600480	凌云股份	5,000	54,050.00	0.26
122	600657	信达地产	12,500	52,000.00	0.25
123	603915	国茂股份	4,200	49,224.00	0.24
124	600550	保变电气	6,200	48,670.00	0.23
125	600602	云赛智联	3,000	47,460.00	0.23
126	300618	寒锐钴业	1,300	43,901.00	0.21
127	000025	特力A	2,600	42,952.00	0.21
128	000048	京基智农	2,300	41,400.00	0.20
129	601609	金田股份	6,700	39,530.00	0.19
130	603766	隆鑫通用	4,300	39,130.00	0.19
131	301327	华宝新能	500	38,355.00	0.18
132	000061	农产品	5,400	37,854.00	0.18
133	002315	焦点科技	900	37,512.00	0.18
134	603093	南华期货	3,100	36,890.00	0.18
135	002948	青岛银行	9,400	36,472.00	0.17

136	603128	华贸物流	5,100	32,793.00	0.16
137	300319	麦捷科技	2,600	32,448.00	0.16
138	600882	妙可蓝多	1,800	32,220.00	0.15
139	300113	顺网科技	1,900	31,939.00	0.15
140	000860	顺鑫农业	1,600	31,152.00	0.15
141	603713	密尔克卫	600	30,720.00	0.15
142	600452	涪陵电力	2,700	28,593.00	0.14
143	688200	华峰测控	251	26,229.50	0.13
144	600782	新钢股份	7,700	25,718.00	0.12
145	300130	新国都	1,100	23,826.00	0.11
146	301205	联特科技	300	22,707.00	0.11
147	603466	风语筑	2,400	22,368.00	0.11
148	000885	城发环境	1,700	22,287.00	0.11
149	002088	鲁阳节能	1,700	21,743.00	0.10
150	301175	中科环保	3,800	20,520.00	0.10
151	002243	力合科创	2,500	20,150.00	0.10
152	688127	蓝特光学	721	19,539.10	0.09
153	600252	中恒集团	7,900	19,434.00	0.09
154	002023	海特高新	1,900	19,285.00	0.09
155	600216	浙江医药	1,200	19,032.00	0.09
156	600201	生物股份	2,700	18,522.00	0.09
157	600305	恒顺醋业	2,300	18,354.00	0.09
158	000968	蓝焰控股	2,700	17,955.00	0.09
159	300674	宇信科技	900	17,568.00	0.08
160	300475	香农芯创	600	17,094.00	0.08
161	603118	共进股份	1,900	16,910.00	0.08
162	688097	博众精工	600	15,750.00	0.08
163	000672	上峰水泥	2,000	15,300.00	0.07
164	000429	粤高速 A	1,000	14,700.00	0.07
165	300034	钢研高纳	900	14,040.00	0.07
166	300027	华谊兄弟	5,100	13,362.00	0.06

167	300672	国科微	200	13,350.00	0.06
168	002605	姚记科技	500	13,330.00	0.06
169	601022	宁波远洋	1,600	12,848.00	0.06
170	600649	城投控股	2,800	12,460.00	0.06
171	000603	盛达资源	1,000	11,990.00	0.06
172	600171	上海贝岭	300	11,904.00	0.06
173	301511	德福科技	900	11,304.00	0.05
174	300772	运达股份	800	10,592.00	0.05
175	688380	中微半导	328	9,807.20	0.05
176	603983	丸美生物	300	9,678.00	0.05
177	601333	广深铁路	2,800	9,604.00	0.05
178	601200	上海环境	1,100	8,987.00	0.04
179	603103	横店影视	600	8,634.00	0.04
180	000966	长源电力	1,700	8,075.00	0.04
181	000902	新洋丰	600	7,824.00	0.04
182	000059	华锦股份	1,500	7,185.00	0.03
183	601187	厦门银行	1,100	6,204.00	0.03
184	002716	湖南白银	1,800	6,102.00	0.03
185	600490	鹏欣资源	1,800	5,922.00	0.03
186	002163	海南发展	600	5,610.00	0.03
187	603638	艾迪精密	300	5,067.00	0.02
188	300738	奥飞数据	300	4,350.00	0.02
189	002936	郑州银行	1,900	3,990.00	0.02
190	603919	金徽酒	200	3,920.00	0.02
191	300170	汉得信息	300	3,720.00	0.02
192	000543	皖能电力	300	2,373.00	0.01
193	600033	福建高速	500	1,940.00	0.01
194	300773	拉卡拉	100	1,770.00	0.01
195	600572	康恩贝	300	1,398.00	0.01
196	000688	国城矿业	100	1,189.00	0.01
197	002221	东华能源	100	949.00	0.00

198	600971	恒源煤电	100	941.00	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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

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	688018	乐鑫科技	2,319,922.73	4.87
2	601811	新华文轩	1,704,158.00	3.58
3	600312	平高电气	1,700,538.00	3.57
4	600007	中国国贸	1,388,341.00	2.91
5	603328	依顿电子	1,335,481.00	2.80
6	603103	横店影视	1,293,538.00	2.72
7	600776	东方通信	1,283,126.00	2.69
8	603093	南华期货	1,265,295.00	2.66
9	688167	炬光科技	1,244,865.62	2.61
10	600210	紫江企业	1,231,291.00	2.59
11	600667	太极实业	1,210,859.00	2.54
12	002901	大博医疗	1,188,347.00	2.49
13	600623	华谊集团	1,170,456.00	2.46
14	600812	华北制药	1,167,735.00	2.45
15	300765	新诺威	1,150,387.00	2.42
16	688578	艾力斯	1,137,020.68	2.39
17	603766	隆鑫通用	1,081,732.00	2.27
18	600872	中炬高新	1,065,694.00	2.24
19	601333	广深铁路	1,055,999.00	2.22
20	601126	四方股份	1,044,239.20	2.19
21	601369	陕鼓动力	1,044,158.00	2.19

22	601311	骆驼股份	1,032,363.00	2.17
23	688408	中信博	1,018,032.72	2.14
24	601001	晋控煤业	1,015,456.00	2.13
25	600562	国睿科技	1,013,335.00	2.13
26	600125	铁龙物流	1,010,814.00	2.12
27	601952	苏垦农发	990,574.14	2.08

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

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	688018	乐鑫科技	2,718,236.71	5.71
2	601811	新华文轩	2,031,376.00	4.26
3	600312	平高电气	1,688,841.00	3.55
4	603328	依顿电子	1,687,630.00	3.54
5	688578	艾力斯	1,509,953.75	3.17
6	600007	中国国贸	1,505,294.00	3.16
7	600210	紫江企业	1,493,095.00	3.13
8	600125	铁龙物流	1,462,799.00	3.07
9	603093	南华期货	1,398,438.00	2.94
10	601311	骆驼股份	1,375,298.70	2.89
11	600662	外服控股	1,270,361.00	2.67
12	002130	沃尔核材	1,264,203.00	2.65
13	600776	东方通信	1,227,509.00	2.58
14	603103	横店影视	1,219,376.00	2.56
15	603766	隆鑫通用	1,214,520.00	2.55
16	601369	陕鼓动力	1,212,499.60	2.55
17	300765	新诺威	1,200,252.00	2.52

18	600623	华谊集团	1,192,574.00	2.50
19	600562	国睿科技	1,184,175.00	2.49
20	600812	华北制药	1,148,393.00	2.41
21	688167	炬光科技	1,143,794.45	2.40
22	600872	中炬高新	1,126,023.00	2.36
23	002274	华昌化工	1,123,263.00	2.36
24	601333	广深铁路	1,062,183.00	2.23
25	002467	二六三	1,061,720.00	2.23
26	603212	赛伍技术	1,031,302.00	2.17
27	601001	晋控煤业	1,024,074.00	2.15
28	600667	太极实业	973,164.00	2.04
29	601952	苏垦农发	971,798.00	2.04
30	601126	四方股份	969,418.00	2.04
31	601137	博威合金	953,031.00	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	222,386,502.71
卖出股票收入（成交）总额	230,818,666.12

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

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

在申赎相对较少时，本基金可能不使用股指期货。

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

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

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

8.12.2 基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	218,253.20
2	应收清算款	27,090.59
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	48,359.68

7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	293,703.47

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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
366	58,579.42	12,629,666.00	58.91%	8,810,401.00	41.09%

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	招商证券股份有限公司	4,793,472.00	22.36%
2	方正证券股份有限公司	2,567,900.00	11.98%
3	广发证券股份有限公司	2,067,635.00	9.64%
4	华泰证券股份有限公司	1,264,139.00	5.90%

5	中信证券股份有限公司	1,199,330.00	5.59%
6	胡恒	1,000,068.00	4.66%
7	海通证券股份有限公司	724,700.00	3.38%
8	李秀仪	500,068.00	2.33%
9	李爱萍	475,027.00	2.22%
10	陈嫣	385,601.00	1.80%

注：持有人为场内持有人。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	10,000.00	0.05%

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(2023年03月15日)基金份额总额	281,440,067.00
本报告期期初基金份额总额	53,440,067.00
本报告期基金总申购份额	104,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	136,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	21,440,067.00

§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，基金管理人根据法律法规及《基金合同》等相关规定以通讯方式召开基金份额持有人大会，大会审议通过《关于天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金修改基金合同终止条款的议案》，本次大会决议自2024年7月30日起生效。

修订后的《基金合同》等法律文件自2024年7月31日起生效。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天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会决议生效的公告》。

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，聂挺进先生新任公司副总经理，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，黄辰立先生担任公司董事长，韩歆毅先生不再担任公司董事长，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董事长变更的公告》。

本报告期内，熊军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，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期，无涉及基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略没有改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，为本基金提供审计服务的机构由普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）变更为毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）。本报告期内本基金应向毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）支付服务费10,163.78元。截至本报告期末，毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）已为本基金提供审计服务4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，基金托管人及其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

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	
德邦证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	270,489,684.66	59.68%	117,604.99	74.18%	-
华泰证券	2	90,424,666.55	19.95%	21,751.90	13.72%	-
中信建投证券	2	92,290,817.62	20.36%	19,188.68	12.10%	-

注：1、基金专用交易单元的选择标准为：财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强；具有较强的综合服务能力，能及时、全面提供高质量的关于宏观策略、行业、资本市场、个股分析的研究服务及丰富全面的信息咨询服务；具有较强的证券交易服务能力，能够提供安全、便捷、优质的证券交易服务及合理的佣金费率。

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：中信建投证券上海交易单元1个，中信建投证券深圳交易单元1个。

4、本基金报告期内停止租用交易单元：无。

5、本基金管理人严格落实《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》的要求，2024年6月30日前完成股票交易佣金费率的调整。6月30日前的股票交易佣金费率按照原费率执行，7月1日起按照调整后的费率执行。

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	关于天弘中证1000增强策略	中国证监会规定媒介	2024-01-04

	交易型开放式指数证券投资基金基金资产净值连续低于5000万元的提示性公告		
2	关于天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金资产净值连续低于5000万元的提示性公告	中国证监会规定媒介	2024-01-11
3	天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金2023年第4季度报告	中国证监会规定媒介	2024-01-22
4	天弘基金管理有限公司关于天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金二级市场交易价格溢价风险提示公告	中国证监会规定媒介	2024-01-23
5	天弘基金将严格落实《证监会新闻发言人就“两融”融券业务有关情况答记者问》相关要求	中国证监会规定媒介	2024-02-06
6	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	2024-02-21
7	关于天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金资产净值连续低于5000万元的提示性公告	中国证监会规定媒介	2024-03-06
8	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	2024-03-07
9	关于天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金资产净值连续低于5000万元的提示性公告	中国证监会规定媒介	2024-03-20

10	关于天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金资产净值连续低于5000万元的提示性公告	中国证监会规定媒介	2024-03-27
11	天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金2023年年度报告	中国证监会规定媒介	2024-03-29
12	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	2024-03-30
13	天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金2024年第1季度报告	中国证监会规定媒介	2024-04-22
14	关于天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金资产净值连续低于5000万元的提示性公告	中国证监会规定媒介	2024-05-18
15	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	2024-05-28
16	关于天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金资产净值连续低于5000万元的提示性公告	中国证监会规定媒介	2024-06-01
17	关于天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金资产净值连续低于5000万元的提示性公告	中国证监会规定媒介	2024-06-08
18	天弘基金管理有限公司关于以通讯方式召开天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的公告	中国证监会规定媒介	2024-06-27
19	天弘中证1000增强策略交易	中国证监会规定媒介	2024-06-28

	型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要（更新）		
20	天弘基金管理有限公司关于以通讯方式召开天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	中国证监会规定媒介	2024-06-28
21	天弘基金管理有限公司关于以通讯方式召开天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	中国证监会规定媒介	2024-07-01
22	关于天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商终止的公告	中国证监会规定媒介	2024-07-03
23	天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金2024年第2季度报告	中国证监会规定媒介	2024-07-19
24	关于天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金资产净值连续低于5000万元的提示性公告	中国证监会规定媒介	2024-07-26
25	关于天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的停牌提示性公告	中国证监会规定媒介	2024-07-30
26	天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要（更新）	中国证监会规定媒介	2024-07-31
27	天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金	中国证监会规定媒介	2024-07-31

	基金合同		
28	天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会规定媒介	2024-07-31
29	天弘基金管理有限公司关于天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会决议生效的公告	中国证监会规定媒介	2024-07-31
30	天弘基金管理有限公司关于终止喜鹊财富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	2024-08-02
31	天弘基金管理有限公司关于终止中民财富基金销售（上海）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	2024-08-20
32	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	2024-08-21
33	天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金2024年中期报告	中国证监会规定媒介	2024-08-30
34	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金改聘会计师事务所的公告	中国证监会规定媒介	2024-09-03
35	天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会规定媒介	2024-10-21
36	天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金2024年第3季度报告	中国证监会规定媒介	2024-10-25
37	天弘基金管理有限公司关于	中国证监会规定媒介	2024-11-08

	旗下部分基金新增申购赎回代办证券公司的公告		
38	天弘基金管理有限公司关于董事长变更的公告	中国证监会规定媒介	2024-11-15
39	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	2024-12-26

§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
机构	1	20240612-20240612	-	32,000,000.00	32,000,000.00	-	-
	2	20240101-20240101, 20240105-20240107, 20240424-20240424, 20240426-20240428, 20240430-20240505	11,700,979.00	69,982,868.00	81,683,847.00	-	-
	3	20240506-20240611, 20240613-20241117, 20241119-20241119,	7,629,184.00	60,985,427.00	63,821,139.00	4,793,472.00	22.36%

		20241121- 20241204, 20241223- 20241223, 20241225- 20241231					
产品特有风险							
<p>基金管理人秉承谨慎勤勉、独立决策、规范运作、充分披露原则，公平对待投资者，保障投资者合法权益。当单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%时，由此可能导致的特有风险主要包括：</p> <p>(1) 超出基金管理人允许的单一投资者持有基金份额比例的申购申请不被确认的风险；</p> <p>(2) 极端市场环境下投资者集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对赎回申请的风险；</p> <p>(3) 持有基金份额占比较高的投资者大额赎回可能引发基金净值大幅波动的风险；</p> <p>(4) 持有基金份额占比较高的投资者在召开基金份额持有人大会并对重大事项进行投票表决时，可能拥有较大话语权；</p> <p>(5) 极端情况下，持有基金份额占比较高的投资者大量赎回后，可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平，面临转换基金运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等风险。</p>							

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

2、份额占比精度处理方式四舍五入。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金募集的文件
- 2、天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金合同
- 3、天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金托管协议
- 4、天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金招募说明书

- 5、报告期内在指定报刊上披露的各项公告
- 6、中国证监会规定的其他文件

13.2 存放地点

天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层

13.3 查阅方式

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

公司网站：www.thfund.com.cn

天弘基金管理有限公司
二〇二五年三月三十一日