

天弘中证 1000 指数增强型证券投资基金

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:中国农业银行股份有限公司

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。

基金托管人中国农业银行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	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	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	14
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	15
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	17
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	18
§6 审计报告	18
6.1 审计报告基本信息	18
6.2 审计报告的基本内容	18
§7 年度财务报表	21
7.1 资产负债表	21
7.2 利润表	23
7.3 净资产变动表	24
7.4 报表附注	26
§8 投资组合报告	61
8.1 期末基金资产组合情况	61
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	62
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	64
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	73
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	75
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	76
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	76
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	76
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	76
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	76

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	76
8.12 投资组合报告附注	76
§9 基金份额持有人信息	78
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	78
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	78
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	79
§10 开放式基金份额变动	79
§11 重大事件揭示	79
11.1 基金份额持有人大会决议	79
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	80
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	80
11.4 基金投资策略的改变	80
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	80
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	80
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	80
11.8 其他重大事件	83
§12 影响投资者决策的其他重要信息	84
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	84
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	84
§13 备查文件目录	84
13.1 备查文件目录	84
13.2 存放地点	85
13.3 查阅方式	85

§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	901,896,686.74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	330,561,858.20份	571,334,828.54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	任航
	联系电话	022-83310208	010-66060069
	电子邮箱	service@thfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
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		黄辰立	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	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	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	2024年		2023年		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	天弘中证1000指数增强A	天弘中证1000指数增强C	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	25,983,214.49	26,405,939.10	-8,098,267.25	3,113,044.42	-13,933,696.32	6,606,764.10
本期利润	47,626,550.13	37,233,696.51	2,429,859.93	7,534,335.45	-24,817,719.64	-32,420,960.86
加权平均基金份额本期利润	0.1211	0.0732	0.0057	0.0106	-0.0469	-0.1072
本期加权平均净值利润率	13.61%	8.27%	0.58%	1.08%	-4.92%	-11.03%
本期基金份额净值增长率	10.73%	10.40%	-0.73%	-1.03%	-6.48%	-6.75%
3.1.2 期末数据和指标	2024年末		2023年末		2022年末	

期末可供分配利润	9,241,691.32	10,780,343.22	-28,067,586.65	-44,288,189.84	-26,730,410.88	-47,830,452.24
期末可供分配基金份额利润	0.0280	0.0189	-0.0716	-0.0771	-0.0648	-0.0675
期末基金资产净值	339,803,549.52	582,115,171.76	363,906,726.66	530,442,247.53	385,647,199.96	660,363,230.34
期末基金份额净值	1.0280	1.0189	0.9284	0.9229	0.9352	0.9325
3.1.3 累计期末指标	2024年末		2023年末		2022年末	
基金份额累计净值增长率	2.80%	1.89%	-7.16%	-7.71%	-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	5.66%	2.29%	4.23%	2.28%	1.43%	0.01%
过去六个月	22.66%	2.14%	20.68%	2.13%	1.98%	0.01%
过去一年	10.73%	1.98%	1.41%	2.01%	9.32%	-0.03%
自基金合同生效日起至今	2.80%	1.53%	-24.13%	1.54%	26.93%	-0.01%

天弘中证1000指数增强C

阶段	份额净值	份额净值	业绩比较	业绩比较	①-③	②-④
----	------	------	------	------	-----	-----

	增长率①	增长率标准差②	基准收益率③	基准收益率标准差④		
过去三个月	5.59%	2.30%	4.23%	2.28%	1.36%	0.02%
过去六个月	22.48%	2.14%	20.68%	2.13%	1.80%	0.01%
过去一年	10.40%	1.98%	1.41%	2.01%	8.99%	-0.03%
自基金合同生效日起至 今	1.89%	1.53%	-24.13%	1.54%	26.02%	-0.01%

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

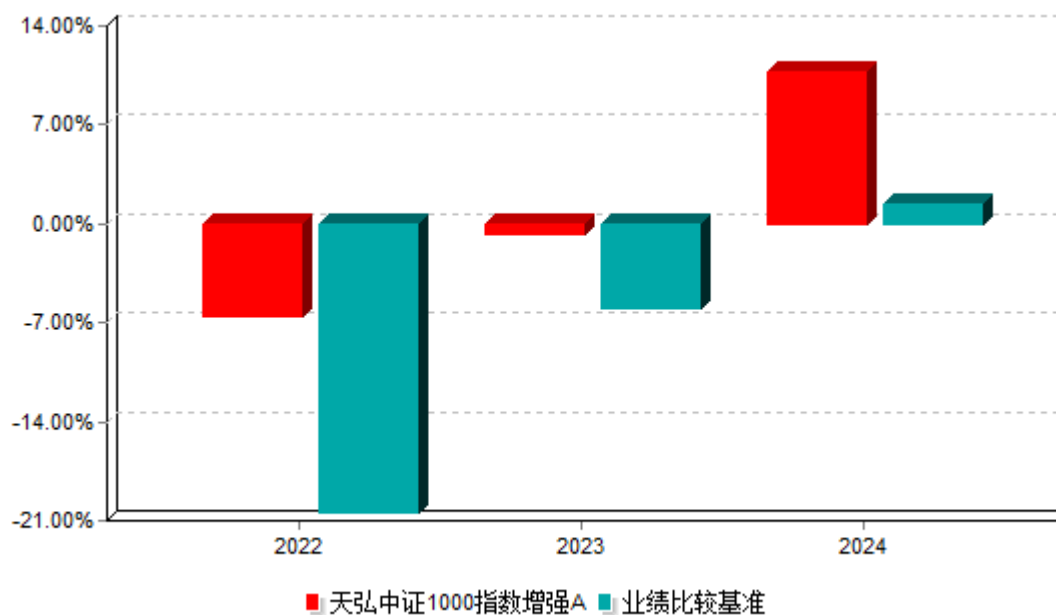


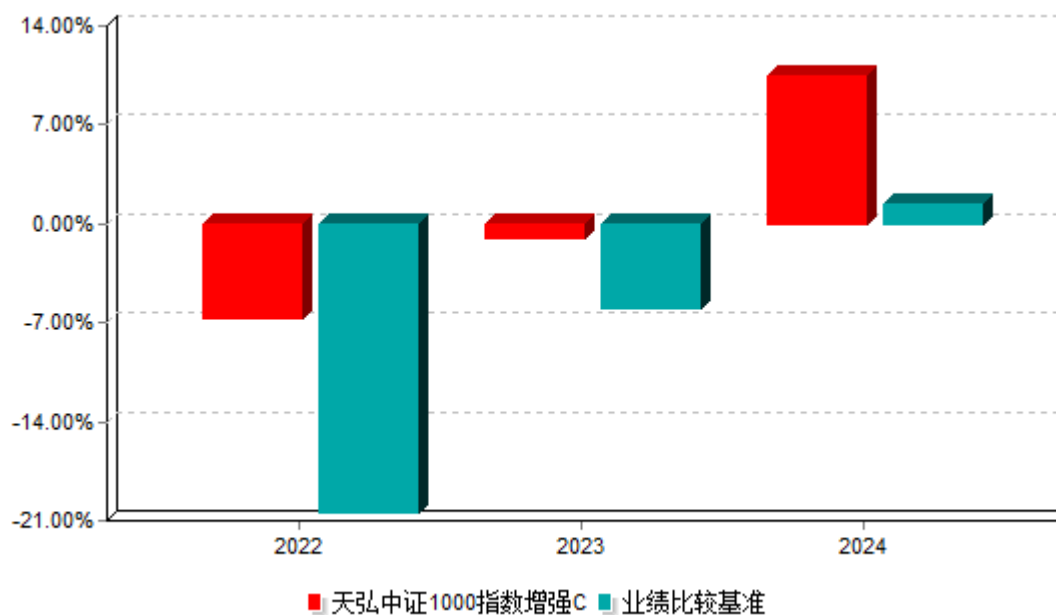


注：1、本基金合同于2022年01月04日生效。

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		
杨超	指数与数量投资部 总经理、本基金基金 经理	2022 年01 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。
林心龙	本基金基金经理助理	2022 年01 月	-	9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《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，市场整体企稳回升，全年来看，多数宽基指数取得了正收益，但市场在风格及结构上体现出了一定的分化。具体来说，根据万得数据统计：中证全指上涨7.43%，沪深300上涨14.68%，中证500上涨5.46%，创业板指上涨13.23%，中证1000上涨1.20%。报告期内，基金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2024年12月31日，天弘中证1000指数增强A基金份额净值为1.0280元，天弘中证1000指数增强C基金份额净值为1.0189元。报告期内份额净值增长率天弘中证1000指数增强A为10.73%，同期业绩比较基准增长率为1.41%；天弘中证1000指数增强C为10.40%，同期业绩比较基准增长率为1.41%。

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2025年，尽管宏观经济仍然面临居民有效需求不足、部分行业经营压力增大等挑战，但在政策持续发力与结构性调整不断深化的背景下，有望迎来拐点并呈现积极变化。政策层面：财政政策或将更加积极，赤字率的提升及超长期特别国债的发行将为经济运行提供有力支撑；货币政策有望保持宽松，降准降息仍有一定空间，各类创新工具的运用也将为金融市场提供必要的流动性保障，并增强实体经济活力。经济结构调整层

面：传统行业在市场出清的过程中进一步磨底，而高端制造业凭借规模效应的积累和技术迭代的加速，有望持续扩大全球竞争优势。同时，人工智能技术在取得“从零到一”的突破后，产业应用进程将加快，算力的普及和算法的优化将不断降低大模型的使用门槛，持续催生可落地的应用场景。科技赋能的深化不仅将推动经济结构优化，还可能孕育出若干具有长期增长潜力的重要投资机会。

证券市场方面，我们对2025年的A股市场持相对乐观态度，并认为市场的积极因素仍在逐步积累：一方面，价值板块从估值、股息率等角度衡量，在大类资产中已具备较好的配置优势，特别是在无风险收益率下行的过程中有望吸引增量配置资金；另一方面，成长板块将持续受益于高端制造业全球竞争力的提升以及国内人工智能领域的科技突破，在风险偏好修复的过程中可能实现系统性的估值提升。此外，金融政策的支持以及创新型流动性工具的应用，也将为市场注入新的活力。总体而言，我们认为当前权益市场的收益风险比占优，具备中长期持有价值。当然，我们也应认识到，无论是宽基指数还是细分行业指数，准确预测其变化的幅度、速率以及时间窗口始终存在较大挑战，面对市场的不确定性，一套以概率思维为指导的投资框架和应对方法，往往比依赖单一结果的押注式预测更加有效，也更有可能带来良好的投资体验。因此，我们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适度分散化，以更好的对冲风险，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

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、不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报告期内基金的投资运作，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	毕马威华振审字第2506428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	我们审计了后附的天弘中证1000指数增强型证券投资基金(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。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。
形成审计意见的基础	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。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	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。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。 结合我们对财务报表的审计, 我们的责任是阅读其他信息, 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。 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。
管理层和治理层对财务报表的责任	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。 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。 该基金管理人治理层负责监督该基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	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： (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。 (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。 (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。 (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。 (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。 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。	
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指数增强型证券投资基金

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	56,302,887.50	43,917,846.74
结算备付金		2,267,170.48	2,847,810.79
存出保证金		130,329.50	355,355.36
交易性金融资产	7.4.7.2	873,705,022.04	851,073,670.17
其中：股票投资		872,487,270.37	849,063,204.42
基金投资		-	-
债券投资		1,217,751.67	2,010,465.75
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		-	329,413.33
应收股利		-	-
应收申购款		10,280,957.27	1,915,659.85
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		942,686,366.79	900,439,756.24
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		10,678,129.88	1,143,355.80
应付赎回款		8,756,113.78	3,484,276.51
应付管理人报酬		491,403.81	461,187.50
应付托管费		81,900.63	76,864.60
应付销售服务费		145,103.19	137,299.32
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	614,994.22	787,798.32
负债合计		20,767,645.51	6,090,782.05
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	901,896,686.74	966,704,750.68

未分配利润	7.4.7.8	20,022,034.54	-72,355,776.49
净资产合计		921,918,721.28	894,348,974.19
负债和净资产总计		942,686,366.79	900,439,756.24

注：报告截止日2024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1.0280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1.0189元；基金份额总额901,896,686.74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330,561,858.20份，天弘中证1000指数增强型证券投资基金C类基金份额571,334,828.54份。

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：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2 024年12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2 023年12月31日
一、营业总收入		91,997,649.02	20,117,471.76
1.利息收入		374,763.57	550,617.99
其中：存款利息收入	7.4.7.9	374,763.57	550,617.99
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）		58,710,325.07	4,099,825.78
其中：股票投资收益	7.4.7.10	47,218,195.26	-9,418,410.33
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	94,133.03	764,553.13
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	11,397,996.78	12,753,682.98
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	32,471,093.05	14,949,418.21
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	441,467.33	517,609.78
减：二、营业总支出		7,137,402.38	10,153,276.38
1.管理人报酬		4,802,508.20	6,694,193.15
2.托管费		800,417.99	1,115,698.88
3.销售服务费		1,352,716.48	2,098,985.02
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		0.28	1.25
8.其他费用	7.4.7.19	181,759.43	244,398.08
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		84,860,246.64	9,964,195.38
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		84,860,246.64	9,964,195.38
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		84,860,246.64	9,964,195.38

7.3 净资产变动表

会计主体：天弘中证1000指数增强型证券投资基金

本报告期：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	966,704,750.68	-72,355,776.49	894,348,974.19
二、本期期初净资产	966,704,750.68	-72,355,776.49	894,348,974.19
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-64,808,063.94	92,377,811.03	27,569,747.09
（一）、综合收益总额	-	84,860,246.64	84,860,246.64
（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）	-64,808,063.94	7,517,564.39	-57,290,499.55
其中：1.基金申购款	1,599,158,165.61	-110,940,935.10	1,488,217,230.51
2.基金赎回款	-1,663,966,229.55	118,458,499.49	-1,545,507,730.06
（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	901,896,686.74	20,022,034.54	921,918,721.28
项 目	上年度可比期间		
	2023年01月01日至2023年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1,120,571,293.42	-74,560,863.12	1,046,010,430.30

产			
二、本期期初净资产	1,120,571,293.42	-74,560,863.12	1,046,010,430.30
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-153,866,542.74	2,205,086.63	-151,661,456.11
（一）、综合收益总额	-	9,964,195.38	9,964,195.38
（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）	-153,866,542.74	-7,759,108.75	-161,625,651.49
其中：1.基金申购款	2,870,389,501.47	-30,578,413.24	2,839,811,088.23
2.基金赎回款	-3,024,256,044.21	22,819,304.49	-3,001,436,739.72
（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	966,704,750.68	-72,355,776.49	894,348,974.19

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指数增强型证券投资基金（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”）证监许可[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》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募集，基金合同于2022年01月04日生效，首次设立募集规模为801,558,434.01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，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

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(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。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。基金的投资组合比例为：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。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

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。

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(或该部分金融负债)。

(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、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

本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为对应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；

由于本基金A类基金份额不收取销售服务费，而C类基金份额收取销售服务费，各类别基金份额对应的可供分配利润将有所不同，本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

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	56,302,887.50	43,917,846.74
等于：本金	56,288,684.93	43,907,195.56
加：应计利息	14,202.57	10,651.18

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	56,302,887.50	43,917,846.74

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		874,972,679.39	-	872,487,270.37	-2,485,409.02
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	1,207,508.00	16,071.67	1,217,751.67	-5,828.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	1,207,508.00	16,071.67	1,217,751.67	-5,828.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-

合计		876,180,187.39	16,071.67	873,705,022.04	-2,491,237.02
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		884,025,125.49	-	849,063,204.42	-34,961,921.07
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	1,996,409.00	14,465.75	2,010,465.75	-409.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	1,996,409.00	14,465.75	2,010,465.75	-409.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		886,021,534.49	14,465.75	851,073,670.17	-34,962,330.07

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度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

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 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	56.14	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	454,938.08	577,798.32
其中：交易所市场	454,938.08	577,798.32
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	160,000.00	210,000.00
合计	614,994.22	787,798.32

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 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	391,974,313.31	391,974,313.31
本期申购	231,244,027.38	231,244,027.38
本期赎回（以“-”号填列）	-292,656,482.49	-292,656,482.49
本期末	330,561,858.20	330,561,858.20

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 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	574,730,437.37	574,730,437.37
本期申购	1,367,914,138.23	1,367,914,138.23
本期赎回（以“-”号填列）	-1,371,309,747.06	-1,371,309,747.06
本期末	571,334,828.54	571,334,828.54

注：申购含转换转入份额；赎回含转换转出份额。

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
上年度末	-11,977,769.50	-16,089,817.15	-28,067,586.65
本期期初	-11,977,769.50	-16,089,817.15	-28,067,586.65
本期利润	25,983,214.49	21,643,335.64	47,626,550.13
本期基金份额交易产生的变动数	-3,945,119.07	-6,372,153.09	-10,317,272.16
其中：基金申购款	-20,970,922.64	5,299,950.44	-15,670,972.20
基金赎回款	17,025,803.57	-11,672,103.53	5,353,700.04
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,060,325.92	-818,634.60	9,241,691.32

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
上年度末	-20,746,823.15	-23,541,366.69	-44,288,189.84
本期期初	-20,746,823.15	-23,541,366.69	-44,288,189.84
本期利润	26,405,939.10	10,827,757.41	37,233,696.51
本期基金份额交易产生的变动数	6,661,065.29	11,173,771.26	17,834,836.55
其中：基金申购款	-106,203,555.29	10,933,592.39	-95,269,962.90
基金赎回款	112,864,620.58	240,178.87	113,104,799.45
本期已分配利润	-	-	-
本期末	12,320,181.24	-1,539,838.02	10,780,343.22

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2024年 12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年 12月31日
活期存款利息收入	336,193.60	482,080.80
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	31,472.76	61,666.40
其他	7,097.21	6,870.79
合计	374,763.57	550,617.99

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 2024年01月01日至2024年 12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年 12月31日
卖出股票成交总额	3,219,251,451.68	5,606,440,582.33
减：卖出股票成本总额	3,168,558,656.69	5,607,585,022.31
减：交易费用	3,474,599.73	8,273,970.35
买卖股票差价收入	47,218,195.26	-9,418,410.33

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 2024年01月01日至2024年 12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年 12月31日
债券投资收益——利息收入	39,218.70	39,529.93
债券投资收益——买卖债券 （债转股及债券到期兑付） 差价收入	54,914.33	725,023.20
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	94,133.03	764,553.13

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 2024年01月01日至2024年12月 31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年12月 31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	4,419,062.05	12,480,591.69
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	4,315,719.00	11,579,283.00
减：应计利息总额	48,410.17	176,205.33
减：交易费用	18.55	80.16
买卖债券差价收入	54,914.33	725,023.20

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

本基金本报告期及上年度可比期间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 2024年01月01日至2024 年12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023 年12月31日
股票投资产生的股利收益	11,397,996.78	12,753,682.98
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	11,397,996.78	12,753,682.98

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2024年12 月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年12 月31日
1.交易性金融资产	32,471,093.05	14,949,418.21
——股票投资	32,476,512.05	14,947,122.21
——债券投资	-5,419.00	2,296.00
——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	32,471,093.05	14,949,418.21

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2024年 12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年 12月31日

基金赎回费收入	434,393.63	513,807.37
基金转换费收入	7,073.70	3,802.41
合计	441,467.33	517,609.78

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2024年 12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年 12月31日
审计费用	40,000.00	90,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
汇划手续费	21,759.43	34,398.08
合计	181,759.43	244,398.08

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

本基金本报告期及上年度可比期间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

本基金本报告期及上年度可比期间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 2024年01月01日至20	上年度可比期间 2023年01月01日至20
----	----------------------	---------------------------

	24年12月31日	23年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	4,802,508.20	6,694,193.15
其中：应支付销售机构的客户维护费	2,109,338.03	2,550,859.75
应支付基金管理人的净管理费	2,693,170.17	4,143,333.40

注:1、支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值0.60%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 2024年01月01日至2024 年12月31日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023 年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	800,417.99	1,115,698.88

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 2024年01月01日至2024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	-	39,713.27	39,713.27
中国农业 银行股份	-	40,720.76	40,720.76

有限公司			
合计	-	80,434.03	80,434.03
获得销售 服务费的 各关联方 名称	上年度可比期间 2023年01月01日至2023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	-	334,271.51	334,271.51
中国农业 银行股份 有限公司	-	39,923.18	39,923.18
合计	-	374,194.69	374,194.69

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的销售服务费率为0.30%。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

天弘中证1000指数增强A

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。

天弘中证1000指数增强C

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01月01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
中国农业银行股份有限公司	56,302,887.50	336,193.60	43,917,846.74	482,080.80

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

天弘中证1000指数增强A

本报告期无利润分配事项。

天弘中证1000指数增强C

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

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
301626	苏州天脉	2024-10-17	6个月	创业板打新限售	21.23	65.78	957	20,317.11	62,951.46	-
688615	合合信息	2024-09-19	6个月	科创板打新限售	55.18	165.78	289	15,947.02	47,910.42	-
301611	珂玛科技	2024-08-07	6个月	创业板打新限售	8.00	56.10	804	6,432.00	45,104.40	-
688449	联芸科技	2024-11-20	6个月	科创板打新限售	11.25	29.44	1,406	15,817.50	41,392.64	-
688605	先锋精科	2024-12-04	6个月	科创板打新限售	11.29	53.68	744	8,399.76	39,937.92	-
688708	佳驰科技	2024-11-27	6个月	科创板打新限售	27.08	48.95	780	21,122.40	38,181.00	-
688726	拉普拉斯	2024-10-22	6个月	科创板打新限售	17.58	33.06	979	17,210.82	32,365.74	-

				售						
001391	N国货航	2024-12-23	6个月	新股锁定	2.30	6.80	4,686	10,777.80	31,864.80	-
301551	无线传媒	2024-09-19	6个月	创业板打新限售	9.40	43.23	652	6,128.80	28,185.96	-
688750	金天钛业	2024-11-12	6个月	科创板打新限售	7.16	15.44	1,685	12,064.60	26,016.40	-
603072	天和磁材	2024-12-24	1个月内(含)	新股未上市	12.30	12.30	2,029	24,956.70	24,956.70	-
301522	上大股份	2024-10-09	6个月	创业板打新限售	6.88	24.84	816	5,614.08	20,269.44	-
688721	龙图光罩	2024-07-30	6个月	科创板打新限售	18.50	56.85	279	5,161.50	15,861.15	-
301556	托普云农	2024-10-10	6个月	创业板打新限售	14.50	59.05	267	3,871.50	15,766.35	-
301631	壹连科技	2024-11-12	6个月	创业板打新限售	72.99	101.96	153	11,167.47	15,599.88	-
301606	绿联科技	2024-07-17	6个月	创业板打新限售	21.21	36.49	396	8,399.16	14,450.04	-

				售						
301571	国科天成	2024-08-14	6个月	创业板打新限售	11.14	40.83	350	3,899.00	14,290.50	-
301622	英思特	2024-11-26	6个月	创业板打新限售	22.36	44.92	306	6,842.16	13,745.52	-
301608	博实结	2024-07-25	6个月	创业板打新限售	44.50	65.38	184	8,188.00	12,029.92	-
301613	新铝时代	2024-10-18	6个月	创业板打新限售	27.70	41.77	276	7,645.20	11,528.52	-
301586	佳力奇	2024-08-21	6个月	创业板打新限售	18.09	53.14	215	3,889.35	11,425.10	-
688710	益诺思	2024-08-27	6个月	科创板打新限售	19.06	33.58	332	6,327.92	11,148.56	-
301617	博苑股份	2024-12-03	6个月	创业板打新限售	27.76	39.79	253	7,023.28	10,066.87	-
301603	乔锋智能	2024-07-03	6个月	创业板打新限售	26.50	41.98	233	6,174.50	9,781.34	-

301607	富特科技	2024-08-28	6个月	创业板打新限售	14.00	36.14	257	3,598.00	9,287.98	-
603194	C中力	2024-12-17	6个月	新股锁定	20.32	28.13	291	5,913.12	8,185.83	-
301552	科力装备	2024-07-15	6个月	创业板打新限售	30.00	56.87	143	4,290.00	8,132.41	-
301585	蓝宇股份	2024-12-10	6个月	创业板打新限售	23.95	35.85	210	5,029.50	7,528.50	-
001279	强邦新材	2024-09-27	6个月	新股锁定	9.68	27.91	265	2,565.20	7,396.15	-
603395	红四方	2024-11-19	6个月	新股锁定	7.98	35.77	154	1,228.92	5,508.58	-
603207	小方制药	2024-08-19	6个月	新股锁定	12.47	26.65	185	2,306.95	4,930.25	-
603310	巍华新材	2024-08-07	6个月	新股锁定	17.39	17.95	254	4,417.06	4,559.30	-
603091	众鑫股份	2024-09-10	6个月	新股锁定	26.50	44.43	94	2,491.00	4,176.42	-
603391	力聚热能	2024-07-24	6个月	新股锁定	40.00	41.35	100	4,000.00	4,135.00	-
603350	安乃达	2024-06-26	6个月	新股锁定	20.56	36.17	106	2,179.36	3,834.02	-

603205	健尔康	2024-10-29	6个月	新股锁定	14.65	27.35	128	1,875.20	3,500.80	-
603285	键邦股份	2024-06-28	6个月	新股锁定	18.65	22.61	129	2,405.85	2,916.69	-
603072	天和磁材	2024-12-24	6个月	新股锁定	12.30	12.30	226	2,779.80	2,779.80	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股中需要限售的部分或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末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，将风险控制可在可承受的范围内。

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，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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年12月31日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	1,217,751.67	2,010,465.75
合计	1,217,751.67	2,010,465.75

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2024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 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	56,302,887.50	-	-	-	56,302,887.50
结算备付金	2,267,170.48	-	-	-	2,267,170.48
存出保证金	130,329.50	-	-	-	130,329.50
交易性金融资产	1,217,751.67	-	-	872,487,270.37	873,705,022.04

应收申购款	-	-	-	10,280,957.27	10,280,957.27
资产总计	59,918,139.15	-	-	882,768,227.64	942,686,366.79
负债					
应付清算款	-	-	-	10,678,129.88	10,678,129.88
应付赎回款	-	-	-	8,756,113.78	8,756,113.78
应付管理人报酬	-	-	-	491,403.81	491,403.81
应付托管费	-	-	-	81,900.63	81,900.63
应付销售服务费	-	-	-	145,103.19	145,103.19
其他负债	-	-	-	614,994.22	614,994.22
负债总计	-	-	-	20,767,645.51	20,767,645.51
利率敏感度缺口	59,918,139.15	-	-	862,000,582.13	921,918,721.28
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	43,917,846.74	-	-	-	43,917,846.74
结算备付金	2,847,810.79	-	-	-	2,847,810.79
存出保证金	355,355.36	-	-	-	355,355.36
交易性金融资产	2,010,465.75	-	-	849,063,204.42	851,073,670.17
应收清算款	-	-	-	329,413.33	329,413.33
应收申购款	-	-	-	1,915,659.85	1,915,659.85
资产总计	49,131,478.64	-	-	851,308,277.60	900,439,756.24
负债					
应付清算款	-	-	-	1,143,355.80	1,143,355.80
应付赎回款	-	-	-	3,484,276.51	3,484,276.51
应付管理人报酬	-	-	-	461,187.50	461,187.50
应付托管费	-	-	-	76,864.60	76,864.60
应付销售服务费	-	-	-	137,299.32	137,299.32
其他负债	-	-	-	787,798.32	787,798.32
负债总计	-	-	-	6,090,782.05	6,090,782.05
利率敏感度缺口	49,131,478.64	-	-	845,217,495.55	894,348,974.19

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，本基金持有的交易性债券投资占基金净资产的比例为0.13%(2023年12月31日：0.22%)，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 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	872,487,270.37	94.64	849,063,204.42	94.94

产—股票投资				
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	872,487,270.37	94.64	849,063,204.42	94.94

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%	48,326,518.41	44,785,336.61
	业绩比较基准下降5%	-48,326,518.41	-44,785,336.61

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	871,815,568.01	847,825,079.30
第二层次	1,245,488.17	2,010,465.75
第三层次	643,965.86	1,238,125.12
合计	873,705,022.04	851,073,670.17

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的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。

7.4.14.2.3 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 2024年01月01日至2024年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	1,238,125.12	1,238,125.12
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	527,131.88	527,131.88
转出第三层次	-	1,547,977.53	1,547,977.53
当期利得或损失总额	-	426,686.39	426,686.39
其中：计入损益的利得或损失	-	426,686.39	426,686.39
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	643,965.86	643,965.86
期末仍持有的第三层	-	383,244.77	383,244.77

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			
项目	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	1,102,795.46	1,102,795.46
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	4,003,959.95	4,003,959.95
转出第三层次	-	3,492,094.78	3,492,094.78
当期利得或损失总额	-	-376,535.51	-376,535.51
其中：计入损益的利得或损失	-	-376,535.51	-376,535.51
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,238,125.12	1,238,125.12
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	-	-291,519.60	-291,519.60

注：于2024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2024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	与公允价值之

				平均值	间的关系
股票投资	643,965.86	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	0.2665~5.7444	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股票投资	1,238,125.12	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	0.1962~2.1988	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于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	872,487,270.37	92.55
	其中：股票	872,487,270.37	92.55
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,217,751.67	0.13
	其中：债券	1,217,751.67	0.13
	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	58,570,057.98	6.21
8	其他各项资产	10,411,286.77	1.10
9	合计	942,686,366.79	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	13,222,125.00	1.43
B	采矿业	18,640,450.00	2.02
C	制造业	522,946,184.50	56.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	30,052,962.50	3.26
E	建筑业	20,574,406.00	2.23
F	批发和零售业	40,913,462.00	4.44
G	交通运输、仓储和邮政业	35,272,433.79	3.83
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	113,024,400.62	12.26
J	金融业	32,584,667.00	3.53
K	房地产业	19,135,884.00	2.08
L	租赁和商务服务业	685,763.00	0.07
M	科学研究和技术服务业	16,912,285.44	1.83
N	水利、环境和公共设施管理业	613,322.00	0.07
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	7,251,556.00	0.79
S	综合	-	-
	合计	871,829,901.85	94.57

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	481,099.79	0.05
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	31,864.80	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	133,255.37	0.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	11,148.56	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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	657,368.52	0.07

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	556,375	12,601,893.75	1.37
2	603005	晶方科技	392,700	11,093,775.00	1.20
3	002249	大洋电机	1,831,400	10,750,318.00	1.17
4	600621	华鑫股份	629,000	10,365,920.00	1.12
5	605111	新洁能	302,720	10,265,235.20	1.11
6	600210	紫江企业	1,547,400	10,228,314.00	1.11
7	300618	寒锐钴业	300,000	10,131,000.00	1.10
8	002698	博实股份	591,800	10,060,600.00	1.09
9	002456	欧菲光	838,827	10,049,147.46	1.09
10	002023	海特高新	989,600	10,044,440.00	1.09
11	300083	创世纪	1,542,700	10,042,977.00	1.09
12	600649	城投控股	2,246,300	9,996,035.00	1.08
13	300641	正丹股份	400,300	9,943,452.00	1.08
14	300685	艾德生物	433,200	9,876,960.00	1.07
15	688321	微芯生物	530,344	9,853,791.52	1.07
16	300770	新媒股份	242,900	9,815,589.00	1.06
17	002928	华夏航空	1,251,900	9,714,744.00	1.05
18	688183	生益电子	247,412	9,713,395.12	1.05
19	605333	沪光股份	294,800	9,619,324.00	1.04
20	301078	孩子王	843,700	9,601,306.00	1.04
21	688088	虹软科技	247,425	9,540,708.00	1.03
22	600428	中远海特	1,302,800	9,510,440.00	1.03
23	301511	德福科技	756,000	9,495,360.00	1.03
24	603888	新华网	424,200	9,476,628.00	1.03

25	000969	安泰科技	843,400	9,403,910.00	1.02
26	000600	建投能源	1,649,600	9,336,736.00	1.01
27	600216	浙江医药	586,200	9,297,132.00	1.01
28	603093	南华期货	779,300	9,273,670.00	1.01
29	605296	神农集团	334,610	9,268,697.00	1.01
30	603118	共进股份	1,038,800	9,245,320.00	1.00
31	600320	振华重工	2,352,600	9,222,192.00	1.00
32	600618	氯碱化工	929,900	9,168,814.00	0.99
33	003039	顺控发展	693,600	9,072,288.00	0.98
34	300768	迪普科技	515,700	9,024,750.00	0.98
35	000550	江铃汽车	383,100	8,983,695.00	0.97
36	000555	神州信息	794,700	8,900,640.00	0.97
37	301180	万祥科技	574,100	8,881,327.00	0.96
38	688522	纳睿雷达	154,603	8,710,333.02	0.94
39	688131	皓元医药	238,577	8,517,198.90	0.92
40	688408	中信博	118,150	8,506,800.00	0.92
41	600710	苏美达	902,400	8,392,320.00	0.91
42	601068	中铝国际	1,863,000	8,215,830.00	0.89
43	603128	华贸物流	1,241,400	7,982,202.00	0.87
44	600667	太极实业	1,144,700	7,921,324.00	0.86
45	002967	广电计量	481,400	7,894,960.00	0.86
46	002043	兔宝宝	662,700	7,872,876.00	0.85
47	300579	数字认证	249,800	7,848,716.00	0.85
48	300151	昌红科技	455,000	7,735,000.00	0.84
49	301090	华润材料	1,088,200	7,552,108.00	0.82
50	001914	招商积余	713,900	7,545,923.00	0.82
51	002948	青岛银行	1,925,600	7,471,328.00	0.81
52	600480	凌云股份	690,700	7,466,467.00	0.81
53	301015	百洋医药	305,600	7,398,576.00	0.80
54	600812	华北制药	1,420,100	7,341,917.00	0.80
55	002901	大博医疗	233,700	7,207,308.00	0.78

56	002773	康弘药业	359,500	7,046,200.00	0.76
57	688083	中望软件	81,740	6,994,491.80	0.76
58	002275	桂林三金	463,500	6,994,215.00	0.76
59	605376	博迁新材	241,400	6,988,530.00	0.76
60	000923	河钢资源	502,200	6,980,580.00	0.76
61	688608	恒玄科技	21,005	6,834,396.85	0.74
62	601126	四方股份	393,300	6,670,368.00	0.72
63	600602	云赛智联	413,500	6,541,570.00	0.71
64	000062	深圳华强	291,400	6,527,360.00	0.71
65	688123	聚辰股份	111,404	6,519,362.08	0.71
66	300303	聚飞光电	927,100	6,322,822.00	0.69
67	002068	黑猫股份	585,300	6,227,592.00	0.68
68	600882	妙可蓝多	345,700	6,188,030.00	0.67
69	002214	大立科技	548,100	6,111,315.00	0.66
70	000688	国城矿业	503,800	5,990,182.00	0.65
71	300327	中颖电子	243,800	5,965,786.00	0.65
72	000875	吉电股份	1,114,800	5,863,848.00	0.64
73	300182	捷成股份	998,800	5,862,956.00	0.64
74	002612	朗姿股份	354,600	5,801,256.00	0.63
75	002428	云南锗业	305,000	5,764,500.00	0.63
76	002036	联创电子	586,100	5,509,340.00	0.60
77	603025	大豪科技	356,200	5,432,050.00	0.59
78	002222	福晶科技	167,460	5,425,704.00	0.59
79	688232	新点软件	183,146	5,309,402.54	0.58
80	300762	上海瀚讯	250,540	5,268,856.20	0.57
81	002626	金达威	341,300	5,153,630.00	0.56
82	600640	国脉文化	425,800	5,084,052.00	0.55
83	002468	申通快递	496,683	5,031,398.79	0.55
84	601187	厦门银行	891,400	5,027,496.00	0.55
85	688336	三生国健	233,129	4,993,623.18	0.54
86	002705	新宝股份	324,900	4,873,500.00	0.53

87	600331	宏达股份	635,600	4,843,272.00	0.53
88	603171	税友股份	149,900	4,571,950.00	0.50
89	688380	中微半导	152,746	4,567,105.40	0.50
90	688347	华虹公司	97,300	4,521,531.00	0.49
91	002550	千红制药	700,300	4,341,860.00	0.47
92	601886	江河集团	802,900	4,335,660.00	0.47
93	300080	易成新能	951,200	4,156,744.00	0.45
94	000791	甘肃能源	664,800	4,008,744.00	0.43
95	301219	腾远钴业	86,100	3,892,581.00	0.42
96	300761	立华股份	199,700	3,886,162.00	0.42
97	300772	运达股份	288,800	3,823,712.00	0.41
98	600572	康恩贝	819,600	3,819,336.00	0.41
99	000025	特力A	222,125	3,669,505.00	0.40
100	300570	太辰光	50,100	3,642,270.00	0.40
101	002978	安宁股份	123,200	3,501,344.00	0.38
102	300315	掌趣科技	611,800	3,364,900.00	0.36
103	601500	通用股份	611,100	3,257,163.00	0.35
104	300451	创业慧康	722,000	3,234,560.00	0.35
105	002991	甘源食品	34,500	3,226,440.00	0.35
106	002534	西子洁能	276,400	3,070,804.00	0.33
107	603766	隆鑫通用	335,700	3,054,870.00	0.33
108	002125	湘潭电化	299,900	3,022,992.00	0.33
109	002837	英维克	74,500	3,009,800.00	0.33
110	605589	圣泉集团	127,400	3,004,092.00	0.33
111	301205	联特科技	39,100	2,959,479.00	0.32
112	300773	拉卡拉	159,400	2,821,380.00	0.31
113	688007	光峰科技	186,944	2,764,901.76	0.30
114	688503	聚和材料	61,467	2,722,373.43	0.30
115	300261	雅本化学	391,300	2,680,405.00	0.29
116	300850	新强联	128,900	2,463,279.00	0.27
117	603083	剑桥科技	59,200	2,403,520.00	0.26

118	600575	淮河能源	600,200	2,382,794.00	0.26
119	300672	国科微	34,300	2,289,525.00	0.25
120	301031	中熔电气	22,000	2,288,440.00	0.25
121	300115	长盈精密	138,600	2,250,864.00	0.24
122	300181	佐力药业	146,300	2,247,168.00	0.24
123	300188	国投智能	161,500	2,227,085.00	0.24
124	600916	中国黄金	258,300	2,226,546.00	0.24
125	688348	昱能科技	44,984	2,195,219.20	0.24
126	300346	南大光电	50,800	1,960,372.00	0.21
127	000603	盛达资源	163,300	1,957,967.00	0.21
128	688568	中科星图	35,851	1,829,476.53	0.20
129	000672	上峰水泥	225,700	1,726,605.00	0.19
130	002097	山河智能	229,000	1,717,500.00	0.19
131	600550	保变电气	207,900	1,632,015.00	0.18
132	600531	豫光金铅	239,400	1,536,948.00	0.17
133	688110	东芯股份	61,483	1,530,926.70	0.17
134	605365	立达信	90,900	1,427,130.00	0.15
135	002245	蔚蓝锂芯	132,800	1,419,632.00	0.15
136	301376	致欧科技	73,900	1,412,968.00	0.15
137	600452	涪陵电力	131,850	1,396,291.50	0.15
138	300027	华谊兄弟	530,000	1,388,600.00	0.15
139	002651	利君股份	188,600	1,382,438.00	0.15
140	000736	中交地产	160,700	1,382,020.00	0.15
141	603915	国茂股份	111,500	1,306,780.00	0.14
142	001696	宗申动力	50,900	1,267,410.00	0.14
143	688208	道通科技	31,060	1,216,309.60	0.13
144	300079	数码视讯	223,700	1,210,217.00	0.13
145	600633	浙数文化	115,100	1,203,946.00	0.13
146	002727	一心堂	92,400	1,203,048.00	0.13
147	300180	华峰超纤	174,900	1,101,870.00	0.12
148	603989	艾华集团	72,700	1,096,316.00	0.12

149	002583	海能达	74,600	1,060,066.00	0.11
150	600559	老白干酒	44,300	929,857.00	0.10
151	002100	天康生物	141,800	928,790.00	0.10
152	002985	北摩高科	38,300	900,050.00	0.10
153	002326	永太科技	94,200	842,148.00	0.09
154	603496	恒为科技	29,600	804,528.00	0.09
155	300623	捷捷微电	23,100	789,096.00	0.09
156	688018	乐鑫科技	3,530	769,540.00	0.08
157	000901	航天科技	67,600	741,572.00	0.08
158	300821	东岳硅材	92,700	719,352.00	0.08
159	000415	渤海租赁	181,900	685,763.00	0.07
160	000795	英洛华	69,300	674,289.00	0.07
161	000035	中国天楹	125,100	609,237.00	0.07
162	300737	科顺股份	118,000	598,260.00	0.06
163	601369	陕鼓动力	66,900	582,030.00	0.06
164	601333	广深铁路	162,900	558,747.00	0.06
165	300085	银之杰	13,100	501,075.00	0.05
166	301155	海力风电	8,800	469,128.00	0.05
167	002585	双星新材	85,600	457,104.00	0.05
168	300455	航天智装	34,000	440,640.00	0.05
169	688019	安集科技	2,998	417,801.28	0.05
170	300857	协创数据	3,700	395,493.00	0.04
171	300663	科蓝软件	22,400	388,864.00	0.04
172	002416	爱施德	23,300	379,091.00	0.04
173	603328	依顿电子	37,319	367,965.34	0.04
174	688372	伟测科技	6,102	357,089.04	0.04
175	601137	博威合金	16,100	326,830.00	0.04
176	002226	江南化工	59,400	321,948.00	0.03
177	600718	东软集团	29,400	316,638.00	0.03
178	300130	新国都	13,900	301,074.00	0.03
179	000966	长源电力	57,600	273,600.00	0.03

180	688798	艾为电子	3,741	261,196.62	0.03
181	688128	中国电研	11,928	250,607.28	0.03
182	002906	华阳集团	8,100	249,075.00	0.03
183	688116	天奈科技	5,997	232,743.57	0.03
184	601279	英利汽车	58,600	224,438.00	0.02
185	600864	哈投股份	29,700	218,295.00	0.02
186	600422	昆药集团	13,200	209,220.00	0.02
187	601528	瑞丰银行	36,400	204,932.00	0.02
188	300674	宇信科技	10,000	195,200.00	0.02
189	002545	东方铁塔	27,100	190,513.00	0.02
190	300123	亚光科技	32,200	186,760.00	0.02
191	688515	裕太微	1,700	168,300.00	0.02
192	688315	诺禾致源	11,443	143,037.50	0.02
193	603236	移远通信	2,000	136,880.00	0.01
194	002668	TCL智家	10,200	133,824.00	0.01
195	002396	星网锐捷	6,800	129,132.00	0.01
196	002190	成飞集成	6,400	123,776.00	0.01
197	600403	大有能源	41,900	123,186.00	0.01
198	600639	浦东金桥	10,900	120,990.00	0.01
199	600623	华谊集团	16,700	116,900.00	0.01
200	600961	株冶集团	14,500	114,115.00	0.01
201	002755	奥赛康	8,400	106,764.00	0.01
202	600478	科力远	25,700	106,141.00	0.01
203	000860	顺鑫农业	5,400	105,138.00	0.01
204	600827	百联股份	9,400	102,742.00	0.01
205	002061	浙江交科	24,900	101,592.00	0.01
206	002378	章源钨业	15,700	101,579.00	0.01
207	603693	江苏新能	10,300	101,455.00	0.01
208	688185	康希诺	1,581	96,520.05	0.01
209	002243	力合科创	11,500	92,690.00	0.01
210	600604	市北高新	19,100	90,916.00	0.01

211	300113	顺网科技	5,300	89,093.00	0.01
212	002063	远光软件	15,300	88,128.00	0.01
213	000099	中信海直	3,300	86,988.00	0.01
214	000821	京山轻机	6,700	83,415.00	0.01
215	002745	木林森	8,900	77,608.00	0.01
216	600993	马应龙	2,900	75,719.00	0.01
217	603920	世运电路	2,400	70,560.00	0.01
218	002176	江特电机	9,300	68,913.00	0.01
219	000735	罗牛山	10,100	67,266.00	0.01
220	603317	天味食品	4,100	54,694.00	0.01
221	300398	飞凯材料	3,400	53,584.00	0.01
222	301050	雷电微力	1,000	51,580.00	0.01
223	002851	麦格米特	800	49,168.00	0.01
224	300738	奥飞数据	2,700	39,150.00	0.00
225	603638	艾迪精密	2,000	33,780.00	0.00
226	688262	国芯科技	1,200	33,240.00	0.00
227	000422	湖北宜化	2,400	30,288.00	0.00
228	603690	至纯科技	1,100	27,621.00	0.00
229	688289	圣湘生物	1,184	26,876.80	0.00
230	688066	航天宏图	1,300	26,520.00	0.00
231	300458	全志科技	680	26,356.80	0.00
232	300747	锐科激光	1,300	24,908.00	0.00
233	000680	山推股份	2,400	23,280.00	0.00
234	000686	东北证券	2,900	23,026.00	0.00
235	600409	三友化工	3,600	19,440.00	0.00
236	000758	中色股份	3,700	18,278.00	0.00
237	600552	凯盛科技	1,600	18,256.00	0.00
238	301171	易点天下	600	16,914.00	0.00
239	000049	德赛电池	700	16,457.00	0.00
240	301606	绿联科技	396	14,450.04	0.00
241	300319	麦捷科技	1,100	13,728.00	0.00

242	603713	密尔克卫	100	5,120.00	0.00
243	002597	金禾实业	200	4,566.00	0.00
244	001309	德明利	50	4,360.00	0.00
245	601200	上海环境	500	4,085.00	0.00
246	300457	赢合科技	100	1,914.00	0.00
247	000761	本钢板材	300	960.00	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	301626	苏州天脉	957	62,951.46	0.01
2	688615	合合信息	289	47,910.42	0.01
3	301611	珂玛科技	804	45,104.40	0.00
4	688449	联芸科技	1,406	41,392.64	0.00
5	688605	先锋精科	744	39,937.92	0.00
6	688708	佳驰科技	780	38,181.00	0.00
7	688726	拉普拉斯	979	32,365.74	0.00
8	001391	N国货航	4,686	31,864.80	0.00
9	301551	无线传媒	652	28,185.96	0.00
10	603072	天和磁材	2,255	27,736.50	0.00
11	688750	金天钛业	1,685	26,016.40	0.00
12	301522	上大股份	816	20,269.44	0.00
13	688721	龙图光罩	279	15,861.15	0.00
14	301556	托普云农	267	15,766.35	0.00
15	301631	壹连科技	153	15,599.88	0.00
16	301571	国科天成	350	14,290.50	0.00
17	301622	英思特	306	13,745.52	0.00
18	301608	博实结	184	12,029.92	0.00
19	301613	新铝时代	276	11,528.52	0.00

20	301586	佳力奇	215	11,425.10	0.00
21	688710	益诺思	332	11,148.56	0.00
22	301617	博苑股份	253	10,066.87	0.00
23	301603	乔锋智能	233	9,781.34	0.00
24	301607	富特科技	257	9,287.98	0.00
25	603194	C中力	291	8,185.83	0.00
26	301552	科力装备	143	8,132.41	0.00
27	301585	蓝宇股份	210	7,528.50	0.00
28	001279	强邦新材	265	7,396.15	0.00
29	603395	红四方	154	5,508.58	0.00
30	603207	小方制药	185	4,930.25	0.00
31	603310	巍华新材	254	4,559.30	0.00
32	603091	众鑫股份	94	4,176.42	0.00
33	603391	力聚热能	100	4,135.00	0.00
34	603350	安乃达	106	3,834.02	0.00
35	603205	健尔康	128	3,500.80	0.00
36	603285	键邦股份	129	2,916.69	0.00
37	301580	爱迪特	2	116.20	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300458	全志科技	28,885,190.20	3.23
2	000550	江铃汽车	24,668,655.75	2.76
3	688608	恒玄科技	24,394,027.49	2.73
4	688408	中信博	22,892,761.44	2.56
5	688578	艾力斯	22,485,095.76	2.51
6	600312	平高电气	21,827,422.00	2.44

7	688018	乐鑫科技	21,508,267.50	2.40
8	002215	诺 普 信	21,478,430.00	2.40
9	300113	顺网科技	20,323,875.36	2.27
10	300123	亚光科技	20,111,221.00	2.25
11	002456	欧菲光	18,842,601.00	2.11
12	003039	顺控发展	18,349,705.00	2.05
13	002212	天融信	18,099,655.59	2.02
14	301080	百普赛斯	17,702,732.00	1.98
15	002351	漫步者	17,471,723.00	1.95
16	002428	云南锗业	17,441,747.12	1.95
17	300457	赢合科技	17,378,543.00	1.94
18	002068	黑猫股份	16,857,260.00	1.88
19	002901	大博医疗	16,770,007.00	1.88
20	002697	红旗连锁	16,265,374.00	1.82

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	36,539,029.02	4.09
2	300458	全志科技	36,102,044.90	4.04
3	000426	兴业银锡	31,127,732.00	3.48
4	600312	平高电气	28,484,520.00	3.18
5	002212	天融信	25,304,371.72	2.83
6	603328	依顿电子	25,224,723.00	2.82
7	688158	优刻得	24,615,750.31	2.75
8	301219	腾远钴业	24,473,125.79	2.74
9	002215	诺 普 信	23,666,691.17	2.65

10	603530	神马电力	23,658,869.70	2.65
11	600285	羚锐制药	23,515,391.66	2.63
12	688578	艾力斯	22,898,294.72	2.56
13	300113	顺网科技	22,627,237.98	2.53
14	300369	绿盟科技	21,993,736.00	2.46
15	000543	皖能电力	21,982,196.90	2.46
16	002053	云南能投	21,974,986.00	2.46
17	688608	恒玄科技	20,984,214.69	2.35
18	002085	万丰奥威	20,370,576.40	2.28
19	600562	国睿科技	19,713,384.08	2.20
20	000990	诚志股份	19,584,946.00	2.19
21	300123	亚光科技	19,499,459.00	2.18
22	300457	赢合科技	18,922,920.00	2.12
23	603212	赛伍技术	18,091,694.31	2.02
24	002891	中宠股份	17,988,020.00	2.01

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	3,159,506,210.59
卖出股票收入（成交）总额	3,219,251,451.68

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	1,217,751.67	0.13
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	1,217,751.67	0.13

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	019740	24国债09	8,000	810,107.18	0.09
2	019733	24国债02	4,000	407,644.49	0.04

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	130,329.50
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	10,280,957.27
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,411,286.77

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	301626	苏州天脉	62,951.46	0.01	创业板打新限售
2	688615	合合信息	47,910.42	0.01	科创板打新限售
3	301611	珂玛科技	45,104.40	0.00	创业板打新限售
4	688449	联芸科技	41,392.64	0.00	科创板打新限售
5	688605	先锋精科	39,937.92	0.00	科创板打新限售

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1 000指 数增 强A	11, 497	28,752.01	13,209,294.66	4.00%	317,352,563.54	96.00%
天弘 中证1 000指 数增 强C	19, 362	29,508.05	93,579,439.30	16.3 8%	477,755,389.24	83.62%
合计	30, 537	29,534.55	106,788,733.96	11.8 4%	795,107,952.78	88.16%

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	97,681.01	0.03%
	天弘中证1000指	172,078.48	0.03%

	数增强C		
	合计	269,759.49	0.03%

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	0
	天弘中证1000指数增强C	0
	合计	0
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	0
	天弘中证1000指数增强C	0
	合计	0

§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
本报告期期初基金份额总额	391,974,313.31	574,730,437.37
本报告期基金总申购份额	231,244,027.38	1,367,914,138.23
减：本报告期基金总赎回份额	292,656,482.49	1,371,309,747.06
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	330,561,858.20	571,334,828.54

§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，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，本基金的基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期内，未发生涉及基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略没有改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，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40,000.00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

本报告期内，本基金托管人的托管业务部门及其相关高级管理人员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	-	-	-	-	-
第一创业证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	2	6,032,201,241.54	94.63%	1,371,997.23	94.22%	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	1	342,100,579.45	5.37%	84,126.68	5.78%	-
华源证券	2	-	-	-	-	-
申万宏源证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	2	-	-	-	-	-
中信建投证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	3	-	-	-	-	-

- 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：华源证券上海交易单元1个，华源证券深圳交易单元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。

11.7.2 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	-	-	-	-	-	-	-	-
第一创业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	4,691,347.34	100.00%	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
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	天弘中证1000指数增强型证券投资基金2023年第4季度报告	中国证监会规定媒介	2024-01-22
2	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
3	天弘中证1000指数增强型证券投资基金2023年年度报告	中国证监会规定媒介	2024-03-29
4	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
5	天弘中证1000指数增强型证券投资基金2024年第1季度报告	中国证监会规定媒介	2024-04-22
6	天弘中证1000指数增强型证券投资基金（A类份额）基金产品资料概要（更新）	中国证监会规定媒介	2024-06-28
7	天弘中证1000指数增强型证券投资基金（C类份额）基金产品资料概要（更新）	中国证监会规定媒介	2024-06-28
8	天弘中证1000指数增强型证券投资基金2024年第2季度报告	中国证监会规定媒介	2024-07-19
9	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
10	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

11	天弘中证1000指数增强型证券投资基金2024年中期报告	中国证监会规定媒介	2024-08-30
12	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
13	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	2024-10-21
14	天弘中证1000指数增强型证券投资基金2024年第3季度报告	中国证监会规定媒介	2024-10-25
15	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
16	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

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

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
二〇二五年三月三十一日