

天弘中证 500 交易型开放式指数证券投资基金

2023 年年度报告

2023 年 12 月 31 日

基金管理人:天弘基金管理有限公司

基金托管人:国泰君安证券股份有限公司

送出日期:2024 年 03 月 29 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人国泰君安证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年03月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自2023年01月01日起至2023年12月31日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、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的真实、准确和完整发表意见	16
§6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
§7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	20
7.3 净资产变动表	22
7.4 报表附注	24
§8 投资组合报告	100
8.1 期末基金资产组合情况	100
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	101
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	103
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	122
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	124
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	125
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	125
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	125
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	125
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	125

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	126
8.12 投资组合报告附注	126
§9 基金份额持有人信息	127
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	127
9.2 期末上市基金前十名持有人	128
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	129
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	129
§10 开放式基金份额变动	129
§11 重大事件揭示	129
11.1 基金份额持有人大会决议	129
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	129
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	130
11.4 基金投资策略的改变	130
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	130
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	130
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	130
11.8 其他重大事件	133
§12 影响投资者决策的其他重要信息	136
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	136
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	137
§13 备查文件目录	137
13.1 备查文件目录	137
13.2 存放地点	137
13.3 查阅方式	137

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	天弘中证500ETF
场内简称	中证500ETF天弘
基金主代码	159820
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2020年08月07日
基金管理人	天弘基金管理有限公司
基金托管人	国泰君安证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,481,408,470.00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	2020年08月24日

2.2 基金产品说明

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

	股相关的衍生工具。本基金产品投资策略仍包括债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、参与融资及转融通证券出借业务策略、存托凭证投资策略等。
业绩比较基准	中证500指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		天弘基金管理有限公司	国泰君安证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	童建林	帅芳
	联系电话	022-83310208	021-38031815
	电子邮箱	service@thfund.com.cn	tgrxp@tg.gtja.com
客户服务电话		95046	021-38917599-5
传真		022-83865564	021-38677819
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	中国（上海）自由贸易试验区商城路618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	上海市静安区新闻路669号博华广场19楼
邮政编码		300203	200041
法定代表人		韩歆毅	朱健

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	普华永道中天会计师事务所 (特殊普通合伙)	中国上海市浦东新区东育路588号前滩中心42楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2023年	2022年	2021年
本期已实现收益	-74,694,463.11	-26,024,855.91	265,476,041.52
本期利润	-116,721,018.08	-439,857,950.03	398,195,984.01
加权平均基金份额本期利润	-0.0490	-0.1886	0.1790
本期加权平均净值利润率	-5.08%	-19.04%	16.90%
本期基金份额净值增长率	-5.74%	-18.38%	18.40%
3.1.2 期末数据和指标	2023年末	2022年末	2021年末
期末可供分配利润	-276,892,037.56	-142,437,349.55	221,084,103.98
期末可供分配基金份额利润	-0.1116	-0.0575	0.1075
期末基金资产净值	2,204,516,432.44	2,333,971,120.45	2,374,667,017.17
期末基金份额净值	0.8884	0.9425	1.1548
3.1.3 累计期末指标	2023年末	2022年末	2021年末

基金份额累计净值增长率	-11.16%	-5.75%	15.48%
-------------	---------	--------	--------

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	-4.67%	0.86%	-4.60%	0.86%	-0.07%	0.00%
过去六个月	-9.07%	0.85%	-9.49%	0.86%	0.42%	-0.01%
过去一年	-5.74%	0.82%	-7.42%	0.82%	1.68%	0.00%
过去三年	-8.91%	1.08%	-14.73%	1.08%	5.82%	0.00%
自基金合同生效日起至 今	-11.16%	1.08%	-19.81%	1.09%	8.65%	-0.01%

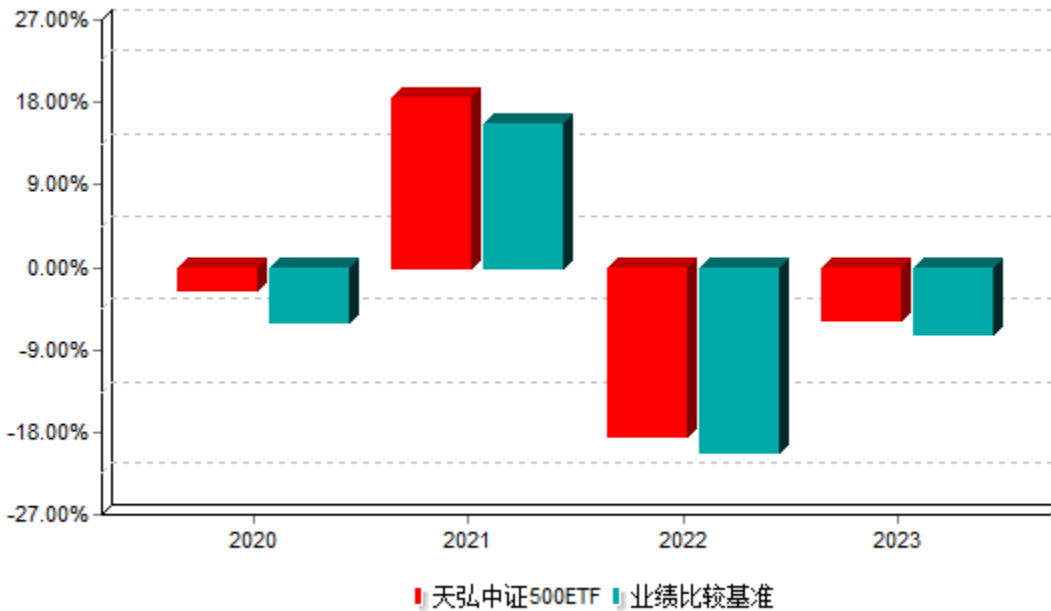
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2020年08月07日-2023年12月31日)



- 注：1、本基金合同于2020年08月07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2020年08月07日生效。基金合同生效当年2020年的净值增长率按照基金合同生效后当年的实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

天弘基金管理有限公司（以下简称“公司”或“本基金管理人”）经中国证监会证监基金字[2004]164号文批准，于2004年11月8日正式成立，注册资本金为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2023年12月31日，公司共管理运作189只公募基金，公司业务范围涵盖二级市场股票投资、债券投资、现金管理、衍生品投资等。公司始终秉承“稳健理财，值得信赖”的理念，坚持为投资者带来优质的基金产品和理财服务。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈瑶	本基金基金经理	2020年08月	-	12年	女，金融学硕士。2011年7月加盟本公司，历任交易员、交易主管，从事交易管理、程序化交易策略、基差

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

注：1、上述任职日期/离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

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

本报告期内，本基金运作合法合规，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

基金管理人一直坚持公平对待旗下所有基金的原则，严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，在研究分析、投资决策和交易执行等各个环节落实公平交易原则。公平交易范围包括各类投资组合、所有投资交易品种、以及一级市场申购、二级市场交易等所有投资交易管理活动及授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

针对公司旗下所有投资组合的交易所公开竞价交易，通过交易系统内的公平交易程序，对于不同投资组合同日同向买卖同一证券的指令自动进行比例分配。针对场外网下交易业务，依照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部场外、网下交易业务的相关规定，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。对于以公司名义进行的交易严格按照发行分配的原则或价格优先、比例分配的原则在各投资组合间进行分配。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

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

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

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

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

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

报告期内，本基金整体运行平稳。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2023年12月31日，本基金份额净值为0.8884元，本报告期份额净值增长率-5.74%，同期业绩比较基准增长率-7.42%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前股票市场已回调到较低位。从中长期看当前股票市场的底部区域特征还是较为明确的，一来政策底的信号已经明确，此次7月政治局会议以来的政策频出可以说是政

策底的再确认。当前各种政策仍在不断接续。政策实施效果上，随着量变逐渐积累到质变，我们认为后续大概率能够看到政策实施的效果。另一方面，近几年来，股票市场多轮下探已经对底部进行了多次试探。虽然经济底还尚未确认，宏观经济层面仍然存在一些不确定因素，包括宏观经济增长压力、外需可能回落、地缘政治风险等等，但无疑当前的指数点位也处于较低位置。

展望2024年的宏观经济和股票市场，我们认为有以下几个方面值得期待：

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

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

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

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

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

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

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

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

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

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

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

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

报告期内，本基金管理人未与任何第三方签订与估值相关的定价服务协议。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内本基金管理人无应说明预警信息。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，国泰君安证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在天弘中证500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以及基金费用开支等方面进行了复核，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

本托管人复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况（如有）、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、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	普华永道中天审字(2024)第24991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500交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	(一)我们审计的内容 我们审计了天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“天弘中证500ETF”)的财务报表,包括2023年12月31日的资产负债表,2023年度的利润表和净资产变动表以及财务报表附注。(二)我们的意见 我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了天弘中证500ETF2023年12月31日的财务状况以及2023年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于

	天弘中证500ETF, 并履行了职业道德方面的其他责任。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	无
管理层和治理层对财务报表的责任	天弘中证500ETF的基金管理人天弘基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表, 使其实现公允反映, 并设计、执行和维护必要的内部控制, 以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时, 基金管理人管理层负责评估天弘中证500ETF的持续经营能力, 披露与持续经营相关的事项(如适用), 并运用持续经营假设, 除非基金管理人管理层计划清算天弘中证500ETF、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督天弘中证500ETF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: (一)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险; 设计和实施审计程序以应对这些风险, 并获取充分、适当的审计证据, 作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上, 未能发现由于舞弊导致的重大错报的风

	<p>险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。(二)了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。(三)评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。(四)对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对天弘中证500ETF持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致天弘中证500ETF不能持续经营。(五)评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	张振波 林佳璐
会计师事务所的地址	中国上海市浦东新区东育路588号前滩中心42楼
审计报告日期	2024-03-27

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2023年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
----	-----	--------------------	---------------------

资产：			
货币资金	7.4.7.1	18,144,345.68	30,541,972.80
结算备付金		64,244,903.92	61,232,998.93
存出保证金		10,640,785.13	13,900,231.01
交易性金融资产	7.4.7.2	2,113,302,063.13	2,233,326,609.28
其中：股票投资		2,113,138,158.10	2,232,596,024.84
基金投资		-	-
债券投资		163,905.03	730,584.44
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		9,105,378.05	-
应收股利		-	4,144.50
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	132,673.59	140,915.40
资产总计		2,215,570,149.50	2,339,146,871.92
负债和净资产	附注号	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		9,242,508.41	3,223,994.11
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		923,303.65	1,008,793.41
应付托管费		184,660.74	201,758.69

应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		12,049.76	5,202.43
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	691,194.50	736,002.83
负债合计		11,053,717.06	5,175,751.47
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	2,481,408,470.00	2,476,408,470.00
未分配利润	7.4.7.8	-276,892,037.56	-142,437,349.55
净资产合计		2,204,516,432.44	2,333,971,120.45
负债和净资产总计		2,215,570,149.50	2,339,146,871.92

注：报告截止日2023年12月31日，基金份额净值0.8884元，基金份额总额2,481,408,470.00份。

7.2 利润表

会计主体：天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年01月01日至2 023年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2 022年12月31日
一、营业总收入		-101,732,211.89	-424,880,653.35
1.利息收入		342,337.55	763,207.81
其中：存款利息收入	7.4.7.9	342,337.55	763,207.81
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		-60,272,222.65	-12,437,172.53

列)			
其中：股票投资收益	7.4.7.10	-97,968,854.30	-43,921,655.59
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	459,935.94	1,380,831.15
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	-4,738,379.78	-13,437,098.07
股利收益	7.4.7.15	35,920,059.60	38,966,568.57
其他投资收益		6,055,015.89	4,574,181.41
3.公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	7.4.7.16	-42,026,554.97	-413,833,094.12
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	224,228.18	626,405.49
减：二、营业总支出		14,988,806.19	14,977,296.68
1.管理人报酬		11,505,758.08	11,515,948.09
2.托管费		2,301,151.65	2,303,189.71
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		40,248.40	16,473.06
8.其他费用	7.4.7.19	1,141,648.06	1,141,685.82
三、利润总额（亏损总额以 “-”号填列）		-116,721,018.08	-439,857,950.03
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”		-116,721,018.08	-439,857,950.03

号填列)			
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-116,721,018.08	-439,857,950.03

7.3 净资产变动表

会计主体：天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	2,476,408,470.00	-142,437,349.55	2,333,971,120.45
二、本期期初净资产	2,476,408,470.00	-142,437,349.55	2,333,971,120.45
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	5,000,000.00	-134,454,688.01	-129,454,688.01
（一）、综合收益总额	-	-116,721,018.08	-116,721,018.08
（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）	5,000,000.00	-17,733,669.93	-12,733,669.93
其中：1.基金申购款	242,500,000.00	-16,923,363.32	225,576,636.68
2.基金赎回款	-237,500,000.00	-810,306.61	-238,310,306.61
（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	2,481,408,470.00	-276,892,037.56	2,204,516,432.44
项目	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	2,056,408,470.00	318,258,547.17	2,374,667,017.17
二、本期期初净资产	2,056,408,470.00	318,258,547.17	2,374,667,017.17
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	420,000,000.00	-460,695,896.72	-40,695,896.72
（一）、综合收益总额	-	-439,857,950.03	-439,857,950.03
（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）	420,000,000.00	-20,837,946.69	399,162,053.31
其中：1.基金申购款	627,500,000.00	-10,970,319.49	616,529,680.51
2.基金赎回款	-207,500,000.00	-9,867,627.20	-217,367,627.20
（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	2,476,408,470.00	-142,437,349.55	2,333,971,120.45

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500交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2020]1285号《关于准予天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》准予注册,由天弘基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币333,867,000.00元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2020)第0673号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于2020年8月7日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为333,908,470.00份基金份额,其中认购资金利息折合41,470.00份基金份额。本基金的基金管理人为天弘基金管理有限公司,基金托管人为国泰君安证券股份有限公司。

根据《天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《天弘中证500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[2020]735号文审核同意,本基金333,908,470.00份基金份额于2020年8月24日在深交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金力争将日均跟踪偏离度控制在0.2%以内,年化跟踪误差控制在2%以内。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。此外,为更好地实现基金的投资目标,本基金还可以投资于国内依法发行上市的非成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票)、存托凭证、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、货币市场工具、同业存单、债券回购、资产支持证券、银行存款、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金可以根据相关法律法规的规定参与融资和转融通证券出借业务。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:本基金投资于标的指数的成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%,且不低于非现金基金资产的80%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金。股指期货及其他金融工具的投资比例依

照法律法规或监管机构的规定执行。如法律法规或监管机构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。本基金的业绩比较基准为：中证500指数收益率。

本基金的基金管理人天弘基金管理有限公司以本基金为目标ETF，将原天弘中证500指数型发起式证券投资基金转型为天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“天弘中证500ETF联接”)。天弘中证500ETF联接为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

本财务报表由本基金的基金管理人天弘基金管理有限公司于2024年3月27日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2023年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2023年12月31日的财务状况以及2023年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

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

(1) 金融资产

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

债务工具

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

以摊余成本计量：

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

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产主要为债券投资和资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融负债和以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的以摊余成本计量的金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，确认为应计利息，

包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映

公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2)交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。本基金发行的份额作为可回售工具具备以下特征：(1) 赋予基金份额持有人在基金清算时按比例份额获得该基金净资产的权利，这里所指基金净资产是扣除所有优先于该基金份额对基金资产要求权之后的剩余资产；这里所指按比例份额是清算时将基金的净资产分拆为金额相等的单位，并且将单位金额乘以基金份额持有人所持有的单位数量；(2) 该工具所属的类别次于其他所有工具类别，即本基金份额在归属于该类别前无须转换为另一种工具，且在清算时对基金资产没有优先于其他工具的要求权；(3) 该工具所属的类别中(该类别次于其他所有工具类别)，所有工具具有相同的特征(例如它们必须都具有可回售特征，并且用于计算回购或赎回价格的公式或其他方法都相同)；(4) 除了发行方应当以现金或其他金融资产回购或赎回该基金份额的合同义务外，该工具不满足金融负债定义中的任何其他特征；(5) 该工具在存续期内的预计现金流量总额，应当实质上基于该基金存续期内基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括本基金的任何影响)。

可回售工具，是指根据合同约定，持有方有权将该工具回售给发行方以获取现金或其他金融资产的权利，或者在未来某一不确定事项发生或者持有方死亡或退休时，自动回售给发行方的金融工具。

本基金没有同时具备下列特征的其他金融工具或合同：(1) 现金流量总额实质上基于基金的损益、已确认净资产的变动、已确认和未确认净资产的公允价值变动(不包括该基金或合同的任何影响)；(2) 实质上限制或固定了上述工具持有方所获得的剩余回报。

本基金将实收基金分类为权益工具，列报于净资产。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动扣除按票面利率(对于贴现债为按发行价计算的利率)或合同利率计算的利息的净额确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除相关交易费用及在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

本基金参与的转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司(以下简称“证金公司”)出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息，以及出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为当期损益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到1%以上时，可进行收益分配。本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从净资产转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

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

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和可交换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种,根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及中国基金业协会中基协字[2022]566号《关于发布<关于固定收益品种的估值处理标准>的通知》之附件《关于固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和可交换债券除外),按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

根据中国证监会于2024年颁布的修订后的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》,本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露,这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

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

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

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

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。根据财政部、国家税务总局公告2023年第39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
活期存款	18,144,345.68	30,541,972.80
等于：本金	18,135,538.61	30,527,958.74
加：应计利息	8,807.07	14,014.06
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	18,144,345.68	30,541,972.80

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	2,468,287,067.1 2	-	2,113,138,158.1 0	-355,148,909.02	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	163,900.00	5.03	163,905.03	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	163,900.00	5.03	163,905.03	-
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	2,468,450,967.1 2	5.03	2,113,302,063.1 3	-355,148,909.02	
项目	上年度末 2022年12月31日				

		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		2,543,623,431.09	-	2,232,596,024.84	-311,027,406.25
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	743,000.00	52.24	730,584.44	-12,467.80
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	743,000.00	52.24	730,584.44	-12,467.80
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		2,544,366,431.09	52.24	2,233,326,609.28	-311,039,874.05

注：1、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。

2、股票投资的成本、公允价值及公允价值变动均包含中国存托凭证的成本、公允价值及公允价值变动。

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 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	88,818,240.00	-	-	-
--股指期货	88,818,240.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	88,818,240.00	-	-	-
项目	上年度末 2022年12月31日			

	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	101,617,880.00	-	-	-
--股指期货	101,617,880.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	101,617,880.00	-	-	-

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
IC2401	IC2401	37.00	40,232,320.00	-672,400.00
IC2403	IC2403	43.00	46,565,560.00	-1,347,960.00
合计				-2,020,360.00
减：可抵销 期货暂收 款				-2,020,360.00
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 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
应收利息	-	-
其他应收款	132,673.59	140,915.40
待摊费用	-	-
合计	132,673.59	140,915.40

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	224,644.83	258,080.77
其中：交易所市场	224,644.83	258,080.77
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	300,000.00	300,000.00
其他应付款	166,549.67	177,922.06
合计	691,194.50	736,002.83

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	2,476,408,470.00	2,476,408,470.00
本期申购	242,500,000.00	242,500,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-237,500,000.00	-237,500,000.00
本期末	2,481,408,470.00	2,481,408,470.00

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	238,885,476.23	-381,322,825.78	-142,437,349.55
本期期初	238,885,476.23	-381,322,825.78	-142,437,349.55
本期利润	-74,694,463.11	-42,026,554.97	-116,721,018.08
本期基金份额交易产生的变动数	-1,894,840.09	-15,838,829.84	-17,733,669.93
其中：基金申购款	19,738,494.62	-36,661,857.94	-16,923,363.32
基金赎回款	-21,633,334.71	20,823,028.10	-810,306.61
本期已分配利润	-	-	-
本期末	162,296,173.03	-439,188,210.59	-276,892,037.56

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日
活期存款利息收入	313,970.43	460,833.62
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	23,734.66	296,799.14
其他	4,632.46	5,575.05
合计	342,337.55	763,207.81

7.4.7.10 股票投资收益**7.4.7.10.1 股票投资收益项目构成**

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至202 3年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至202 2年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-88,428,065.90	-36,807,048.10

股票投资收益——赎回差价收入	-9,540,788.40	-7,114,607.49
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	-97,968,854.30	-43,921,655.59

7.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日
卖出股票成交总额	768,550,519.89	949,754,302.24
减：卖出股票成本总额	855,615,164.20	984,454,955.94
减：交易费用	1,363,421.59	2,106,394.40
买卖股票差价收入	-88,428,065.90	-36,807,048.10

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 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日
赎回基金份额对价总额	238,310,306.61	217,367,627.20
减：现金支付赎回款总额	122,838,505.61	112,119,912.20
减：赎回股票成本总额	125,012,589.40	112,362,322.49
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	-9,540,788.40	-7,114,607.49

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日
----	-----------------------------------	--

债券投资收益——利息收入	413.87	1,384.55
债券投资收益——买卖债券 (债转股及债券到期兑付) 差价收入	459,522.07	1,379,446.60
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	459,935.94	1,380,831.15

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年12月 31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月 31日
卖出债券（债转股 及债券到期兑付） 成交总额	2,624,099.11	7,669,327.38
减：卖出债券（债 转股及债券到期兑 付）成本总额	2,164,000.00	6,288,200.00
减：应计利息总额	472.08	1,389.77
减：交易费用	104.96	291.01
买卖债券差价收入	459,522.07	1,379,446.60

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间未取得资产支持证券投资收益。

7.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间未取得贵金属投资收益。

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间未取得买卖权证差价收入。

7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日
期货投资	-4,738,379.78	-13,437,098.07

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023 年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022 年12月31日
股票投资产生的股利收益	35,920,059.60	38,966,568.57
其中：证券出借权益补偿收入	3,614,761.84	4,359,381.50
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	35,920,059.60	38,966,568.57

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2023年01月01日至2023年12 月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12 月31日
1.交易性金融资产	-44,109,034.97	-407,806,374.12
——股票投资	-44,121,502.77	-407,793,610.22
——债券投资	12,467.80	-12,763.90
——资产支持证券投资	-	-
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2.衍生工具	2,082,480.00	-6,026,720.00
——权证投资	-	-

——期货投资	2,082,480.00	-6,026,720.00
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	-42,026,554.97	-413,833,094.12

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日
基金赎回费收入	-	-
基金转换费收入	-	-
ETF基金替代损益	224,228.18	626,405.49
延期合约递延费收入	-	-
合计	224,228.18	626,405.49

7.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生信用减值损失。

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年 12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年 12月31日
审计费用	80,000.00	80,000.00
信息披露费	120,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
指数使用费	690,345.44	690,956.95
IOPV计算发布费	100,000.00	100,000.00
ETF登记结算费	150,000.00	150,000.00

存托服务费	1,302.62	728.87
合计	1,141,648.06	1,141,685.82

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
国泰君安证券股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
蚂蚁科技集团股份有限公司	基金管理人的股东
天津信托有限责任公司	基金管理人的股东
内蒙古君正能源化工集团股份有限公司	基金管理人的股东
芜湖高新投资有限公司	基金管理人的股东
新疆天瑞博丰股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
新疆天惠新盟股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
新疆天阜恒基股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
新疆天聚宸兴股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
天弘创新资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司
天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金	本基金的联接基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日
-------	-------------------------------	------------------------------------

	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国泰君安证券股份有限公司	226,090,567.96	14.72%	388,157,548.49	17.93%

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国泰君安证券股份有限公司	55,396.37	8.84%	50,182.32	22.34%
关联方名称	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国泰君安证券股份有限公司	89,791.68	10.49%	89,791.68	34.79%

注: 1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至20 23年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至20 22年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	11,505,758.08	11,515,948.09
其中：应支付销售机构的客户维护费	60,400.41	1,192.62
应支付基金管理人的净管理费	11,445,357.67	11,514,755.47

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

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023 年12月31日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022 年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,301,151.65	2,303,189.71

注:支付基金托管人国泰君安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**

单位：人民币元

本期 2023年01月01日至2023年12月31日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
国泰君安证券股份有限公司	440,928,905.00	286,722.23	-	-
上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
国泰君安证券股份有限公司	1,073,079,753.00	685,895.42	52,696,082.00	21,550.61

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

单位：人民币元

本期 2023年01月01日至2023年12月31日						
关联方名称	交易金额	费率区间(%)	加权平均费率(%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
国泰君安证券股份有限公司	2,368,466,245.00	1.60~9.50	2.02	1,769,300.47	261,410,490.00	93,580.88
上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日						
关联方名称	交易金额	费率区间(%)	加权平均费率(%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
国泰君安证券股份有限公司	116,182,418.00	3.20~3.40	3.20	138,117.18	4,343,279.00	3,039.93

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

本基金本报告期及上年度可比期间无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2023年12月31日		上年度末 2022年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金	2,361,606,069.00	95.17%	2,375,424,569.00	95.92%

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

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年12月31日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
国泰君安证券股份有限公司	18,144,345.68	313,970.43	30,541,972.80	460,833.62

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

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2023年01月01日至2023年12月31日

关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:张/股)	总金额
国泰君安证券股份有限公司	001314	亿道信息	网下申购	508	17,780.00
国泰君安证券股份有限公司	001311	多利科技	网下申购	499	30,873.13
国泰君安证券股份有限公司	603065	宿迁联盛	网下申购	581	7,465.85
国泰君安证券股份有限公司	603135	中重科技	网下申购	6,273	111,659.40
国泰君安证券股份有限公司	688479	友车科技	网下申购	3,318	112,778.82
国泰君安证券股份有限公司	688361	中科飞测	网下申购	8,303	195,950.80
国泰君安证券股份有限公司	688543	国科军工	网下申购	4,094	178,784.98
国泰君安证券股份有限公司	301499	维科精密	网下申购	3,709	72,325.50
国泰君安证券股份有限公司	688651	盛邦安全	网下申购	1,778	70,942.20
国泰君安证券股份有限公司	300904	威力传动	网下申购	3,037	107,540.17

国泰君安证券股份有限公司	301500	飞南资源	网下申购	4,550	109,063.50
国泰君安证券股份有限公司	603276	恒兴新材	网下申购	1,336	34,375.28
国泰君安证券股份有限公司	603273	天元智能	网下申购	1,772	16,834.00
国泰君安证券股份有限公司	688652	京仪装备	网下申购	4,157	132,816.15
国泰君安证券股份有限公司	601083	锦江航运	网下申购	12,630	142,087.50
国泰君安证券股份有限公司	001239	永达股份	网下申购	1,887	22,738.35
上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量(单位:张/股)	总金额
国泰君安证券股份有限公司	688234	天岳先进	网下申购	6,759	559,577.61
国泰君安证券股份有限公司	301217	铜冠铜箔	网下申购	42,831	739,691.37
国泰君安证券股份有限公司	603070	万控智造	网下申购	775	7,300.50
国泰君安	688238	和元生物	网下申购	12,836	169,820.28

证券股份 有限公司					
国泰君安 证券股份 有限公司	301258	富士莱	网下申购	2,942	142,098.60
国泰君安 证券股份 有限公司	301263	泰恩康	网下申购	6,813	135,783.09
国泰君安 证券股份 有限公司	301097	天益医疗	网下申购	2,486	130,191.82
国泰君安 证券股份 有限公司	301268	铭利达	网下申购	6,407	182,599.50
国泰君安 证券股份 有限公司	301279	金道科技	网下申购	2,956	92,227.20
国泰君安 证券股份 有限公司	688120	华海清科	网下申购	4,822	658,974.52
国泰君安 证券股份 有限公司	603170	宝立食品	网下申购	542	5,447.10
国泰君安 证券股份 有限公司	301283	聚胶股份	网下申购	2,344	123,505.36
国泰君安 证券股份 有限公司	603182	嘉华股份	网下申购	546	5,760.30
国泰君安 证券股份 有限公司	688455	科捷智能	网下申购	5,277	115,460.76
国泰君安	301309	万得凯	网下申购	2,271	88,569.00

证券股份有限公司					
国泰君安证券股份有限公司	001238	浙江正特	网下申购	374	6,002.70
国泰君安证券股份有限公司	301388	欣灵电气	网下申购	2,920	75,569.60
国泰君安证券股份有限公司	688489	三未信安	网下申购	1,995	157,385.55
国泰君安证券股份有限公司	301368	丰立智能	网下申购	3,368	75,207.44
国泰君安证券股份有限公司	688498	源杰科技	网下申购	1,582	159,244.12

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本报告期末，本基金（因追踪指数成份股而被动）持有君正集团的股票1,116,600股（上年度末：0股），估值总额为人民币4,176,084.00元（上年度末：0.00元），占基金净资产的比例为0.19%（上年度末：0.00%）。

7.4.11 利润分配情况--固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期无利润分配事项。

7.4.12 期末（2023年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
6885	航材	2023	6个月	科创	78.99	60.49	1,501	118,5	90,79	-

63	股份	-07-1 2		板打 新限售				63.99	5.49	
6885 48	广钢 气体	2023 -08-0 8	6个月	科创 板打 新限售	9.87	12.75	4,048	39,95 3.76	51,61 2.00	-
6032 96	华勤 技术	2023 -08-0 1	6个月	新股 锁定	80.80	77.75	593	47,91 4.40	46,10 5.75	-
3015 26	C国 际复	2023 -12-1 9	6个月	创业 板打 新限售	2.66	4.45	9,723	25,86 3.18	43,26 7.35	-
3014 87	盟固 利	2023 -08-0 1	6个月	创业 板打 新限售	5.32	40.96	867	4,61 2.44	35,51 2.32	-
6885 49	中巨 芯	2023 -08-3 0	6个月	科创 板打 新限售	5.18	8.09	4,294	22,24 2.92	34,73 8.46	-
3013 48	蓝箭 电子	2023 -08-0 1	6个月	创业 板打 新限售	18.08	44.57	613	11,08 3.04	27,32 1.41	-
6887 02	盛科 通信	2023 -09-0 6	6个月	科创 板打 新限售	42.66	48.18	549	23,42 0.34	26,45 0.82	-
6885 82	芯动 联科	2023 -06-2 1	6个月	科创 板打 新限售	26.74	38.67	648	17,32 7.52	25,05 8.16	-

301559	中集环科	2023-09-26	6个月	创业板打新限售	24.22	18.24	1,315	31,849.30	23,985.60	-
301486	致尚科技	2023-06-30	6个月	创业板打新限售	57.66	47.25	482	27,792.12	22,774.50	-
688652	京仪装备	2023-11-22	6个月	科创板打新限售	31.95	52.25	416	13,291.20	21,736.00	-
301525	儒竞科技	2023-08-23	6个月	创业板打新限售	99.57	81.46	266	26,485.62	21,668.36	-
301498	乖宝宠物	2023-08-09	6个月	创业板打新限售	39.99	38.81	554	22,154.46	21,500.74	-
301371	敷尔佳	2023-07-24	6个月	创业板打新限售	55.68	37.58	564	31,403.52	21,195.12	-
301370	国科恒泰	2023-07-03	6个月	创业板打新限售	13.39	16.01	1,240	16,603.60	19,852.40	-
301421	波长光电	2023-08-16	6个月	创业板打新限售	29.38	59.37	332	9,754.16	19,710.84	-
301558	三态	2023-09-2	6个月	创业	7.33	13.40	1,458	10,687.14	19,537.20	-

	股份	1		板打 新限售							
6886 27	精智 达	2023 -07-1 1	6个月	科创 板打 新限售	46.77	87.72	222	10,38 2.94	19,47 3.84	-	
6885 91	泰凌 微	2023 -08-1 8	6个月	科创 板打 新限售	24.98	28.02	681	17,01 1.38	19,08 1.62	-	
3009 04	威力 传动	2023 -08-0 2	6个月	创业 板打 新限售	35.41	61.53	304	10,76 4.64	18,70 5.12	-	
3014 88	豪恩 汽电	2023 -06-2 6	6个月	创业 板打 新限售	39.78	69.09	262	10,42 2.36	18,10 1.58	-	
3013 81	赛维 时代	2023 -07-0 5	6个月	创业 板打 新限售	20.45	29.69	571	11,67 6.95	16,95 2.99	-	
3011 72	君逸 数码	2023 -07-1 9	6个月	创业 板打 新限售	31.33	38.16	438	13,72 2.54	16,71 4.08	-	
3015 09	金凯 生科	2023 -07-2 6	6个月	创业 板打 新限售	56.56	62.23	266	15,04 4.96	16,55 3.18	-	
6886 12	威迈 斯	2023 -07-1 9	6个月	科创 板打 新限售	47.29	37.97	422	19,95 6.38	16,02 3.34	-	

				售							
601096	宏盛华源	2023-12-15	6个月	新股锁定	1.70	4.06	3,918	6,660.60	15,907.08	-	
301393	昊帆生物	2023-07-05	6个月	创业板打新限售	67.68	59.37	260	17,596.80	15,436.20	-	
601083	锦江航运	2023-11-28	6个月	新股锁定	11.25	11.07	1,263	14,208.75	13,981.41	-	
301510	固高科技	2023-08-04	6个月	创业板打新限售	12.00	35.01	396	4,752.00	13,863.96	-	
301507	民生健康	2023-08-24	6个月	创业板打新限售	10.00	15.85	851	8,510.00	13,488.35	-	
301210	金杨股份	2023-06-21	6个月	创业板打新限售	57.88	45.48	281	16,264.28	12,779.88	-	
301566	N达利	2023-12-22	6个月	创业板打新限售	8.90	22.14	576	5,126.40	12,752.64	-	
301456	盘古智能	2023-07-06	6个月	创业板打新限售	37.96	30.39	407	15,449.72	12,368.73	-	
688602	康鹏科技	2023-07-13	6个月	科创板打新限售	8.66	11.06	1,066	9,231.56	11,789.96	-	

				售							
688719	爱科赛博	2023-09-20	6个月	科创板打新限售	69.98	60.10	194	13,576.12	11,659.40	-	
301550	斯菱股份	2023-09-06	6个月	创业板打新限售	37.56	43.57	260	9,765.60	11,328.20	-	
301292	海科新源	2023-06-29	6个月	创业板打新限售	19.99	19.35	583	11,654.17	11,281.05	-	
301508	中机认检	2023-11-23	6个月	创业板打新限售	16.82	26.68	419	7,047.58	11,178.92	-	
301251	威尔高	2023-08-30	6个月	创业板打新限售	28.88	34.59	321	9,270.48	11,103.39	-	
688592	司南导航	2023-08-07	6个月	科创板打新限售	50.50	50.53	216	10,908.00	10,914.48	-	
301499	维科精密	2023-07-13	6个月	创业板打新限售	19.50	28.93	371	7,234.50	10,733.03	-	
688603	天承科技	2023-06-30	6个月	科创板打新限售	55.00	74.14	140	7,700.00	10,379.60	-	

688653	康希通信	2023-11-10	6个月	科创板打新限售	10.50	15.99	648	6,804.00	10,361.52	-
301528	多浦乐	2023-08-17	6个月	创业板打新限售	71.80	68.91	148	10,626.40	10,198.68	-
301329	信音电子	2023-07-05	6个月	创业板打新限售	21.00	22.23	458	9,618.00	10,181.34	-
301261	恒工精密	2023-06-29	6个月	创业板打新限售	36.90	50.85	198	7,306.20	10,068.30	-
301202	朗威股份	2023-06-28	6个月	创业板打新限售	25.82	31.80	306	7,900.92	9,730.80	-
301395	仁信新材	2023-06-21	6个月	创业板打新限售	26.68	18.69	520	13,873.60	9,718.80	-
688716	中研股份	2023-09-13	6个月	科创板打新限售	29.66	36.39	267	7,919.22	9,716.13	-
301413	安培龙	2023-12-11	6个月	创业板打新限售	33.25	58.19	164	5,453.00	9,543.16	-
301500	飞南	2023-09-1	6个月	创业	23.97	20.89	455	10,906.35	9,504.95	-

	资源	3		板打 新限售							
3014 18	协昌 科技	2023 -08-1 0	6个月	创业 板打 新限售	51.88	50.20	189	9,80 5.32	9,48 7.80	-	
3015 16	中远 通	2023 -12-0 1	6个月	创业 板打 新限售	6.87	15.51	604	4,14 9.48	9,36 8.04	-	
3012 72	英华 特	2023 -07-0 6	6个月	创业 板打 新限售	51.39	53.38	173	8,89 0.47	9,23 4.74	-	
3014 69	恒达 新材	2023 -08-1 0	6个月	创业 板打 新限售	36.58	33.09	275	10,05 9.50	9,09 9.75	-	
3015 19	舜禹 股份	2023 -07-1 9	6个月	创业 板打 新限售	20.93	20.21	442	9,25 1.06	8,93 2.82	-	
3015 18	长华 化学	2023 -07-2 6	6个月	创业 板打 新限售	25.75	23.01	385	9,91 3.75	8,85 8.85	-	
3015 68	思泰 克	2023 -11-2 1	6个月	创业 板打 新限售	23.23	35.58	246	5,71 4.58	8,75 2.68	-	
3015 20	万邦 医药	2023 -09-1 8	6个月	创业 板打 新限售	67.88	52.74	160	10,86 0.80	8,43 8.40	-	

				售							
301459	丰茂股份	2023-12-06	6个月	创业板打新限售	31.90	39.84	208	6,635.20	8,286.72	-	
688720	艾森股份	2023-11-29	6个月	科创板打新限售	28.03	49.84	165	4,624.95	8,223.60	-	
688573	信宇人	2023-08-09	6个月	科创板打新限售	23.68	28.80	285	6,748.80	8,208.00	-	
301489	思泉新材	2023-10-16	6个月	创业板打新限售	41.66	64.11	128	5,332.48	8,206.08	-	
688651	盛邦安全	2023-07-19	6个月	科创板打新限售	39.90	46.05	178	7,102.20	8,196.90	-	
301517	陕西华达	2023-10-09	6个月	创业板打新限售	26.87	43.69	185	4,970.95	8,082.65	-	
301578	C辰奕	2023-12-21	6个月	创业板打新限售	48.94	68.32	118	5,774.92	8,061.76	-	
301548	崇德科技	2023-09-11	6个月	创业板打新限售	66.80	58.99	136	9,084.80	8,022.64	-	

688657	浩辰软件	2023-09-25	6个月	科创板打新限售	103.40	78.23	101	10,443.40	7,901.23	-
688646	逸飞激光	2023-07-21	6个月	科创板打新限售	46.80	36.07	219	10,249.20	7,899.33	-
688671	碧兴物联	2023-08-02	6个月	科创板打新限售	36.12	34.30	226	8,163.12	7,751.80	-
688693	锆威特	2023-08-10	6个月	科创板打新限售	40.83	43.41	178	7,267.74	7,726.98	-
603275	众辰科技	2023-08-16	6个月	新股锁定	49.97	39.70	193	9,644.21	7,662.10	-
301533	威马农机	2023-08-07	6个月	创业板打新限售	29.50	33.16	225	6,637.50	7,461.00	-
603062	麦加芯彩	2023-10-31	6个月	新股锁定	58.08	57.81	126	7,318.08	7,284.06	-
301555	惠柏新材	2023-10-24	6个月	创业板打新限售	22.88	32.44	224	5,125.12	7,266.56	-
301505	苏州规划	2023-07-12	6个月	创业板打新限售	26.35	35.81	194	5,111.90	6,947.14	-

301529	福赛科技	2023-08-31	6个月	创业板打新限售	36.60	37.88	182	6,661.20	6,894.16	-
301515	港通医疗	2023-07-13	6个月	创业板打新限售	31.16	28.27	230	7,166.80	6,502.10	-
688648	中邮科技	2023-11-06	6个月	科创板打新限售	15.18	21.43	303	4,599.54	6,493.29	-
688450	光格科技	2023-07-17	6个月	科创板打新限售	53.09	36.42	167	8,866.03	6,082.14	-
603004	C鼎龙	2023-12-20	6个月	新股锁定	16.80	31.19	195	3,276.00	6,082.05	-
603270	金帝股份	2023-08-25	6个月	新股锁定	21.77	29.58	195	4,245.15	5,768.10	-
603119	浙江荣泰	2023-07-21	6个月	新股锁定	15.32	23.87	226	3,462.32	5,394.62	-
603107	上海汽配	2023-10-25	6个月	新股锁定	14.23	18.19	292	4,155.16	5,311.48	-
603193	润本股份	2023-10-09	6个月	新股锁定	17.38	16.66	303	5,266.14	5,047.98	-
001306	夏厦精密	2023-11-09	6个月	新股锁定	53.63	75.36	64	3,432.32	4,823.04	-
0013	联域	2023	6个月	新股	41.18	48.64	99	4,07	4,81	-

26	股份	-11-01		锁定				6.82	5.36	
603075	热威股份	2023-09-01	6个月	新股锁定	23.10	23.31	182	4,204.20	4,242.42	-
001358	兴欣新材	2023-12-14	6个月	新股锁定	41.00	44.16	87	3,567.00	3,841.92	-
001239	永达股份	2023-12-04	6个月	新股锁定	12.05	19.92	189	2,277.45	3,764.88	-
603231	索宝蛋白	2023-12-06	6个月	新股锁定	21.29	21.53	161	3,427.69	3,466.33	-
603273	天元智能	2023-10-16	6个月	新股锁定	9.50	18.97	178	1,691.00	3,376.66	-
603276	恒兴新材	2023-09-18	6个月	新股锁定	25.73	24.88	134	3,447.82	3,333.92	-
603373	安邦护卫	2023-12-13	6个月	新股锁定	19.10	34.75	88	1,680.80	3,058.00	-

7.4.12.1.2 受限证券类别：债券

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：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
127102	浙建转债	2023-12-25	1个月内（含）	新债未上市	100.00	100.00	1,639	163,900.00	163,905.03	-

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

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2023年12月31日，本基金未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2023年12月31日，本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值 单价	数量（单 位：股）	期末估值 总额
1	000009	中国宝安	2024年01月04日- 2024年01月10日	11.74	146,000	1,714,040.0 0
2	000021	深科技	2024年01月04日- 2024年01月10日	16.21	70,000	1,134,700.0 0
3	000027	深圳能源	2024年01月04日- 2024年01月10日	6.45	98,200	633,390.00
4	000031	大悦城	2024年01月02日- 2024年01月10日	2.97	96,400	286,308.00
5	000039	中集集团	2024年01月04日- 2024年01月10日	7.65	130,300	996,795.00
6	000050	深天马 A	2024年01月04日- 2024年01月10日	10.65	86,800	924,420.00
7	000060	中金岭南	2024年01月04日- 2024年01月10日	4.32	185,000	799,200.00
8	000066	中国长城	2024年01月02日- 2024年01月10日	10.12	145,300	1,470,436.0 0
9	000089	深圳机场	2024年01月04日- 2024年01月10日	6.43	71,700	461,031.00

10	000155	川能动力	2024年01月02日- 2024年01月10日	13.29	55,300	734,937.00
11	000156	华数传媒	2024年01月05日- 2024年01月10日	7.37	60,300	444,411.00
12	000400	许继电气	2024年01月04日- 2024年01月10日	21.96	50,400	1,106,784.0 0
13	000401	冀东水泥	2024年01月04日- 2024年01月10日	6.39	75,200	480,528.00
14	000402	金融街	2024年01月05日- 2024年01月10日	3.63	77,800	282,414.00
15	000423	东阿阿胶	2024年01月04日- 2024年01月10日	49.32	31,100	1,533,852.0 0
16	000513	丽珠集团	2024年01月05日- 2024年01月10日	35.01	23,800	833,238.00
17	000519	中兵红箭	2024年01月04日- 2024年01月10日	14.04	58,300	818,532.00
18	000537	中绿电	2024年01月04日- 2024年01月10日	9.63	38,300	368,829.00
19	000539	粤电力A	2024年01月02日- 2024年01月10日	4.89	62,400	305,136.00
20	000553	安道麦A	2024年01月04日- 2024年01月10日	6.94	26,100	181,134.00
21	000559	万向钱潮	2024年01月04日- 2024年01月10日	5.19	89,700	465,543.00
22	000563	陕国投A	2024年01月04日- 2024年01月10日	3.04	206,900	628,976.00
23	000591	太阳能	2024年01月04日- 2024年01月10日	5.58	193,200	1,078,056.0 0
24	000598	兴蓉环境	2024年01月04日- 2024年01月10日	5.69	126,700	720,923.00
25	000623	吉林敖东	2024年01月02日- 2024年01月10日	15.14	69,300	1,049,202.0 0

26	000629	钒钛股份	2024年01月04日- 2024年01月10日	3.28	320,600	1,051,568.0 0
27	000630	铜陵有色	2024年01月04日- 2024年01月10日	3.28	532,800	1,747,584.0 0
28	000636	风华高科	2024年01月03日- 2024年01月10日	13.66	70,000	956,200.00
29	000683	远兴能源	2024年01月04日- 2024年01月10日	5.87	198,000	1,162,260.0 0
30	000703	恒逸石化	2024年01月02日- 2024年01月10日	6.72	162,700	1,093,344.0 0
31	000709	河钢股份	2024年01月04日- 2024年01月10日	2.13	292,600	623,238.00
32	000723	美锦能源	2024年01月05日- 2024年01月10日	6.66	197,400	1,314,684.0 0
33	000728	国元证券	2024年01月04日- 2024年01月10日	6.83	185,300	1,265,599.0 0
34	000729	燕京啤酒	2024年01月04日- 2024年01月10日	8.63	99,600	859,548.00
35	000738	航发控制	2024年01月04日- 2024年01月10日	19.90	46,300	921,370.00
36	000739	普洛药业	2024年01月04日- 2024年01月10日	15.39	41,600	640,224.00
37	000750	国海证券	2024年01月04日- 2024年01月10日	3.54	263,800	933,852.00
38	000778	新兴铸管	2024年01月04日- 2024年01月10日	3.82	164,100	626,862.00
39	000783	长江证券	2024年01月04日- 2024年01月10日	5.38	273,800	1,473,044.0 0
40	000825	太钢不锈	2024年01月05日- 2024年01月10日	3.73	148,900	555,397.00
41	000830	鲁西化工	2024年01月04日- 2024年01月10日	10.03	81,200	814,436.00

42	000831	中国稀土	2024年01月05日- 2024年01月10日	27.67	41,300	1,142,771.0 0
43	000878	云南铜业	2024年01月04日- 2024年01月10日	10.89	97,800	1,065,042.0 0
44	000883	湖北能源	2024年01月05日- 2024年01月10日	4.23	127,300	538,479.00
45	000887	中鼎股份	2024年01月02日- 2024年01月10日	12.37	55,300	684,061.00
46	000893	亚钾国际	2024年01月04日- 2024年01月10日	26.24	44,600	1,170,304.0 0
47	000898	鞍钢股份	2024年01月05日- 2024年01月10日	2.49	156,100	388,689.00
48	000930	中粮科技	2024年01月04日- 2024年01月10日	6.64	64,900	430,936.00
49	000932	华菱钢铁	2024年01月04日- 2024年01月10日	5.15	293,400	1,511,010.0 0
50	000933	神火股份	2024年01月04日- 2024年01月10日	16.80	110,100	1,849,680.0 0
51	000937	冀中能源	2024年01月04日- 2024年01月10日	7.14	74,900	534,786.00
52	000958	电投产融	2024年01月02日- 2024年01月10日	3.94	120,700	475,558.00
53	000959	首钢股份	2024年01月05日- 2024年01月10日	3.46	101,400	350,844.00
54	000960	锡业股份	2024年01月04日- 2024年01月10日	14.32	67,600	968,032.00
55	000967	盈峰环境	2024年01月05日- 2024年01月10日	4.75	82,800	393,300.00
56	000970	中科三环	2024年01月04日- 2024年01月10日	10.35	73,600	761,760.00
57	000975	银泰黄金	2024年01月02日- 2024年01月10日	15.00	145,700	2,185,500.0 0

58	000987	越秀资本	2024年01月04日- 2024年01月10日	6.02	106,500	641,130.00
59	000988	华工科技	2024年01月02日- 2024年01月10日	29.76	74,000	2,202,240.0 0
60	000997	新大陆	2024年01月02日- 2024年01月10日	19.61	60,500	1,186,405.0 0
61	000998	隆平高科	2024年01月04日- 2024年01月10日	14.10	73,900	1,041,990.0 0
62	001286	陕西能源	2024年01月02日- 2024年01月10日	8.55	52,500	448,875.00
63	001872	招商港口	2024年01月04日- 2024年01月10日	15.96	15,700	250,572.00
64	001914	招商积余	2024年01月04日- 2024年01月10日	11.96	28,500	340,860.00
65	002008	大族激光	2024年01月02日- 2024年01月10日	20.72	62,800	1,301,216.0 0
66	002010	传化智联	2024年01月04日- 2024年01月10日	4.62	97,800	451,836.00
67	002019	亿帆医药	2024年01月04日- 2024年01月10日	14.78	51,900	767,082.00
68	002025	航天电器	2024年01月04日- 2024年01月10日	48.02	19,100	917,182.00
69	002028	思源电气	2024年01月04日- 2024年01月10日	52.04	43,400	2,258,536.0 0
70	002030	达安基因	2024年01月04日- 2024年01月10日	9.68	68,100	659,208.00
71	002044	美年健康	2024年01月05日- 2024年01月10日	6.01	204,000	1,226,040.0 0
72	002056	横店东磁	2024年01月04日- 2024年01月10日	13.54	57,400	777,196.00
73	002064	华峰化学	2024年01月05日- 2024年01月10日	6.71	129,300	867,603.00

74	002065	东华软件	2024年01月04日- 2024年01月10日	6.17	158,800	979,796.00
75	002078	太阳纸业	2024年01月04日- 2024年01月10日	12.17	118,600	1,443,362.0 0
76	002080	中材科技	2024年01月04日- 2024年01月10日	15.92	47,300	753,016.00
77	002092	中泰化学	2024年01月04日- 2024年01月10日	6.10	146,500	893,650.00
78	002120	韵达股份	2024年01月05日- 2024年01月10日	7.46	94,300	703,478.00
79	002128	电投能源	2024年01月05日- 2024年01月10日	14.27	58,400	833,368.00
80	002131	利欧股份	2024年01月02日- 2024年01月10日	2.28	507,200	1,156,416.0 0
81	002138	顺络电子	2024年01月04日- 2024年01月10日	27.01	56,900	1,536,869.0 0
82	002152	广电运通	2024年01月04日- 2024年01月10日	12.26	87,700	1,075,202.0 0
83	002153	石基信息	2024年01月04日- 2024年01月10日	9.74	57,800	562,972.00
84	002155	湖南黄金	2024年01月04日- 2024年01月10日	11.14	59,500	662,830.00
85	002156	通富微电	2024年01月04日- 2024年01月10日	23.12	74,700	1,727,064.0 0
86	002185	华天科技	2024年01月04日- 2024年01月10日	8.52	180,800	1,540,416.0 0
87	002192	融捷股份	2024年01月04日- 2024年01月10日	54.21	8,800	477,048.00
88	002195	岩山科技	2024年01月02日- 2024年01月10日	3.07	422,000	1,295,540.0 0
89	002203	海亮股份	2024年01月04日- 2024年01月10日	11.15	81,900	913,185.00

90	002223	鱼跃医疗	2024年01月04日- 2024年01月10日	34.58	42,300	1,462,734.0 0
91	002240	盛新锂能	2024年01月04日- 2024年01月10日	22.75	48,300	1,098,825.0 0
92	002244	滨江集团	2024年01月05日- 2024年01月10日	7.27	81,000	588,870.00
93	002262	恩华药业	2024年01月05日- 2024年01月10日	27.12	39,300	1,065,816.0 0
94	002266	浙富控股	2024年01月04日- 2024年01月10日	3.40	185,200	629,680.00
95	002273	水晶光电	2024年01月04日- 2024年01月10日	13.54	98,300	1,330,982.0 0
96	002281	光迅科技	2024年01月02日- 2024年01月10日	28.50	28,800	820,800.00
97	002294	信立泰	2024年01月04日- 2024年01月10日	32.66	39,300	1,283,538.0 0
98	002299	圣农发展	2024年01月04日- 2024年01月10日	17.18	52,700	905,386.00
99	002326	永太科技	2024年01月02日- 2024年01月10日	11.62	53,300	619,346.00
10 0	002340	格林美	2024年01月05日- 2024年01月10日	5.46	334,500	1,826,370.0 0
10 1	002353	杰瑞股份	2024年01月04日- 2024年01月10日	28.11	42,000	1,180,620.0 0
10 2	002368	太极股份	2024年01月04日- 2024年01月10日	29.53	26,400	779,592.00
10 3	002372	伟星新材	2024年01月04日- 2024年01月10日	14.47	56,100	811,767.00
10 4	002373	千方科技	2024年01月04日- 2024年01月10日	11.21	78,100	875,501.00
10 5	002384	东山精密	2024年01月04日- 2024年01月10日	18.18	96,700	1,758,006.0 0

10 6	002385	大北农	2024年01月04日- 2024年01月10日	5.96	232,800	1,387,488.0 0
10 7	002399	海普瑞	2024年01月04日- 2024年01月10日	11.73	27,100	317,883.00
10 8	002407	多氟多	2024年01月04日- 2024年01月10日	15.22	64,400	980,168.00
10 9	002408	齐翔腾达	2024年01月02日- 2024年01月10日	5.28	109,300	577,104.00
11 0	002409	雅克科技	2024年01月04日- 2024年01月10日	55.73	19,700	1,097,881.0 0
11 1	002414	高德红外	2024年01月05日- 2024年01月10日	7.30	111,200	811,760.00
11 2	002422	科伦药业	2024年01月02日- 2024年01月10日	29.05	86,800	2,521,540.0 0
11 3	002423	中粮资本	2024年01月05日- 2024年01月10日	6.68	59,900	400,132.00
11 4	002429	兆驰股份	2024年01月02日- 2024年01月10日	5.58	166,600	929,628.00
11 5	002430	杭氧股份	2024年01月04日- 2024年01月10日	29.21	33,300	972,693.00
11 6	002432	九安医疗	2024年01月03日- 2024年01月10日	37.67	28,600	1,077,362.0 0
11 7	002439	启明星辰	2024年01月04日- 2024年01月10日	27.00	52,900	1,428,300.0 0
11 8	002444	巨星科技	2024年01月02日- 2024年01月10日	22.52	54,100	1,218,332.0 0
11 9	002463	沪电股份	2024年01月04日- 2024年01月10日	22.12	90,200	1,995,224.0 0
12 0	002465	海格通信	2024年01月02日- 2024年01月10日	12.85	128,300	1,648,655.0 0
12 1	002468	申通快递	2024年01月02日- 2024年01月10日	7.79	55,700	433,903.00

12 2	002472	双环传动	2024年01月05日- 2024年01月10日	26.02	44,100	1,147,482.0 0
12 3	002487	大金重工	2024年01月02日- 2024年01月10日	26.62	27,500	732,050.00
12 4	002497	雅化集团	2024年01月04日- 2024年01月10日	13.09	81,500	1,066,835.0 0
12 5	002500	山西证券	2024年01月04日- 2024年01月10日	5.39	152,100	819,819.00
12 6	002506	协鑫集成	2024年01月04日- 2024年01月10日	2.74	327,600	897,624.00
12 7	002507	涪陵榨菜	2024年01月04日- 2024年01月10日	14.29	57,500	821,675.00
12 8	002508	老板电器	2024年01月04日- 2024年01月10日	21.78	33,100	720,918.00
12 9	002511	中顺洁柔	2024年01月05日- 2024年01月10日	10.00	52,000	520,000.00
13 0	002517	恺英网络	2024年01月05日- 2024年01月10日	11.17	140,100	1,564,917.0 0
13 1	002518	科士达	2024年01月04日- 2024年01月10日	27.60	16,300	449,880.00
13 2	002531	天顺风能	2024年01月02日- 2024年01月10日	11.60	65,900	764,440.00
13 3	002532	天山铝业	2024年01月03日- 2024年01月10日	6.01	234,100	1,406,941.0 0
13 4	002557	洽洽食品	2024年01月04日- 2024年01月10日	34.82	21,200	738,184.00
13 5	002558	巨人网络	2024年01月04日- 2024年01月10日	11.14	96,800	1,078,352.0 0
13 6	002563	森马服饰	2024年01月02日- 2024年01月10日	5.77	61,200	353,124.00
13 7	002568	百润股份	2024年01月05日- 2024年01月10日	24.61	34,000	836,740.00

138	002572	索菲亚	2024年01月02日- 2024年01月10日	15.95	48,300	770,385.00
139	002595	豪迈科技	2024年01月04日- 2024年01月10日	29.77	26,900	800,813.00
140	002600	领益智造	2024年01月04日- 2024年01月10日	6.76	196,400	1,327,664.00
141	002607	中公教育	2024年01月04日- 2024年01月10日	4.08	303,200	1,237,056.00
142	002608	江苏国信	2024年01月04日- 2024年01月10日	6.57	56,700	372,519.00
143	002624	完美世界	2024年01月05日- 2024年01月10日	11.84	88,300	1,045,472.00
144	002625	光启技术	2024年01月02日- 2024年01月10日	14.78	113,800	1,681,964.00
145	002653	海思科	2024年01月04日- 2024年01月10日	23.15	22,700	525,505.00
146	002673	西部证券	2024年01月05日- 2024年01月10日	6.37	174,700	1,112,839.00
147	002683	广东宏大	2024年01月05日- 2024年01月10日	20.08	29,100	584,328.00
148	002690	美亚光电	2024年01月04日- 2024年01月10日	19.64	24,600	483,144.00
149	002738	中矿资源	2024年01月04日- 2024年01月10日	37.31	39,200	1,462,552.00
150	002739	万达电影	2024年01月02日- 2024年01月10日	13.02	92,400	1,203,048.00
151	002756	永兴材料	2024年01月05日- 2024年01月10日	52.21	24,400	1,273,924.00
152	002791	坚朗五金	2024年01月05日- 2024年01月10日	40.49	8,200	332,018.00
153	002797	第一创业	2024年01月04日- 2024年01月10日	5.81	237,700	1,381,037.00

15 4	002831	裕同科技	2024年01月02日- 2024年01月10日	27.51	27,400	753,774.00
15 5	002867	周大生	2024年01月04日- 2024年01月10日	15.18	27,000	409,860.00
15 6	002925	盈趣科技	2024年01月04日- 2024年01月10日	19.47	23,200	451,704.00
15 7	002926	华西证券	2024年01月04日- 2024年01月10日	7.76	111,300	863,688.00
15 8	002936	郑州银行	2024年01月02日- 2024年01月10日	2.01	406,300	816,663.00
15 9	002939	长城证券	2024年01月04日- 2024年01月10日	8.00	113,700	909,600.00
16 0	002945	华林证券	2024年01月04日- 2024年01月10日	15.10	19,300	291,430.00
16 1	002958	青农商行	2024年01月05日- 2024年01月10日	2.62	253,200	663,384.00
16 2	002966	苏州银行	2024年01月04日- 2024年01月10日	6.46	259,600	1,677,016.0 0
16 3	003022	联泓新科	2024年01月03日- 2024年01月10日	18.31	27,300	499,863.00
16 4	003031	中瓷电子	2024年01月10日- 2024年01月10日	88.23	2,500	220,575.00
16 5	003035	南网能源	2024年01月04日- 2024年01月10日	5.26	106,800	561,768.00
16 6	300001	特锐德	2024年01月04日- 2024年01月10日	20.10	52,100	1,047,210.0 0
16 7	300003	乐普医疗	2024年01月04日- 2024年01月10日	16.16	93,100	1,504,496.0 0
16 8	300009	安科生物	2024年01月04日- 2024年01月10日	10.22	83,000	848,260.00
16 9	300012	华测检测	2024年01月04日- 2024年01月10日	14.20	118,900	1,688,380.0 0

17 0	300017	网宿科技	2024年01月04日- 2024年01月10日	7.85	167,100	1,311,735.0 0
17 1	300024	机器人	2024年01月04日- 2024年01月10日	11.87	91,400	1,084,918.0 0
17 2	300026	红日药业	2024年01月02日- 2024年01月10日	4.24	182,000	771,680.00
17 3	300037	新宙邦	2024年01月04日- 2024年01月10日	47.30	37,100	1,754,830.0 0
17 4	300058	蓝色光标	2024年01月02日- 2024年01月10日	7.18	191,800	1,377,124.0 0
17 5	300070	碧水源	2024年01月02日- 2024年01月10日	4.99	155,500	775,945.00
17 6	300073	当升科技	2024年01月04日- 2024年01月10日	38.20	28,600	1,092,520.0 0
17 7	300088	长信科技	2024年01月04日- 2024年01月10日	6.69	184,200	1,232,298.0 0
17 8	300114	中航电测	2024年01月05日- 2024年01月10日	43.75	19,000	831,250.00
17 9	300118	东方日升	2024年01月04日- 2024年01月10日	17.65	61,800	1,090,770.0 0
18 0	300136	信维通信	2024年01月04日- 2024年01月10日	23.60	67,800	1,600,080.0 0
18 1	300146	汤臣倍健	2024年01月04日- 2024年01月10日	17.03	72,100	1,227,863.0 0
18 2	300207	欣旺达	2024年01月05日- 2024年01月10日	14.76	96,900	1,430,244.0 0
18 3	300212	易华录	2024年01月04日- 2024年01月10日	31.45	25,600	805,120.00
18 4	300244	迪安诊断	2024年01月04日- 2024年01月10日	23.81	35,200	838,112.00
18 5	300251	光线传媒	2024年01月04日- 2024年01月10日	8.15	101,100	823,965.00

18 6	300253	卫宁健康	2024年01月04日- 2024年01月10日	7.19	121,500	873,585.00
18 7	300257	开山股份	2024年01月04日- 2024年01月10日	15.76	28,800	453,888.00
18 8	300285	国瓷材料	2024年01月04日- 2024年01月10日	23.12	56,700	1,310,904.0 0
18 9	300296	利亚德	2024年01月04日- 2024年01月10日	6.00	143,200	859,200.00
19 0	300357	我武生物	2024年01月04日- 2024年01月10日	29.00	22,100	640,900.00
19 1	300363	博腾股份	2024年01月04日- 2024年01月10日	25.15	23,100	580,965.00
19 2	300373	扬杰科技	2024年01月04日- 2024年01月10日	36.70	22,600	829,420.00
19 3	300383	光环新网	2024年01月05日- 2024年01月10日	9.72	93,600	909,792.00
19 4	300390	天华新能	2024年01月04日- 2024年01月10日	25.35	41,100	1,041,885.0 0
19 5	300394	天孚通信	2024年01月02日- 2024年01月10日	91.52	19,200	1,757,184.0 0
19 6	300395	菲利华	2024年01月04日- 2024年01月10日	36.56	35,800	1,308,848.0 0
19 7	300418	昆仑万维	2024年01月03日- 2024年01月10日	37.40	61,600	2,303,840.0 0
19 8	300438	鹏辉能源	2024年01月04日- 2024年01月10日	28.29	25,600	724,224.00
19 9	300474	景嘉微	2024年01月04日- 2024年01月10日	70.71	18,800	1,329,348.0 0
20 0	300487	蓝晓科技	2024年01月05日- 2024年01月10日	53.06	16,300	864,878.00
20 1	300502	新易盛	2024年01月05日- 2024年01月10日	49.32	46,000	2,268,720.0 0

20 2	300529	健帆生物	2024年01月04日- 2024年01月10日	22.23	33,900	753,597.00
20 3	300558	贝达药业	2024年01月04日- 2024年01月10日	51.55	17,700	912,435.00
20 4	300568	星源材质	2024年01月04日- 2024年01月10日	15.42	90,500	1,395,510.0 0
20 5	300595	欧普康视	2024年01月05日- 2024年01月10日	22.58	35,000	790,300.00
20 6	300601	康泰生物	2024年01月05日- 2024年01月10日	27.15	43,600	1,183,740.0 0
20 7	300604	长川科技	2024年01月04日- 2024年01月10日	37.99	26,400	1,002,936.0 0
20 8	300676	华大基因	2024年01月04日- 2024年01月10日	48.00	17,400	835,200.00
20 9	300677	英科医疗	2024年01月04日- 2024年01月10日	23.36	32,400	756,864.00
21 0	300682	朗新集团	2024年01月04日- 2024年01月10日	16.39	45,800	750,662.00
21 1	300699	光威复材	2024年01月04日- 2024年01月10日	26.67	40,800	1,088,136.0 0
21 2	300724	捷佳伟创	2024年01月04日- 2024年01月10日	74.01	19,500	1,443,195.0 0
21 3	300748	金力永磁	2024年01月03日- 2024年01月10日	20.22	45,700	924,054.00
21 4	300866	安克创新	2024年01月04日- 2024年01月10日	88.60	7,400	655,640.00
21 5	300888	稳健医疗	2024年01月04日- 2024年01月10日	37.25	16,500	614,625.00
21 6	301236	软通动力	2024年01月02日- 2024年01月10日	46.20	40,100	1,852,620.0 0
21 7	600004	白云机场	2024年01月05日- 2024年01月10日	9.78	77,400	756,972.00

21 8	600008	首创环保	2024年01月04日- 2024年01月10日	2.69	313,000	841,970.00
21 9	600021	上海电力	2024年01月04日- 2024年01月10日	8.46	99,000	837,540.00
22 0	600022	山东钢铁	2024年01月04日- 2024年01月10日	1.37	407,700	558,549.00
22 1	600032	浙江新能	2024年01月04日- 2024年01月10日	8.06	12,500	100,750.00
22 2	600038	中直股份	2024年01月04日- 2024年01月10日	38.53	20,600	793,718.00
22 3	600056	中国医药	2024年01月02日- 2024年01月10日	11.17	56,400	629,988.00
22 4	600060	海信视像	2024年01月04日- 2024年01月10日	20.90	55,700	1,164,130.0 0
22 5	600062	华润双鹤	2024年01月04日- 2024年01月10日	18.60	27,900	518,940.00
22 6	600066	宇通客车	2024年01月04日- 2024年01月10日	13.25	91,800	1,216,350.0 0
22 7	600079	人福医药	2024年01月04日- 2024年01月10日	24.86	81,100	2,016,146.0 0
22 8	600095	湘财股份	2024年01月02日- 2024年01月10日	7.51	61,600	462,616.00
22 9	600096	云天化	2024年01月04日- 2024年01月10日	15.60	88,300	1,377,480.0 0
23 0	600109	国金证券	2024年01月04日- 2024年01月10日	9.08	184,900	1,678,892.0 0
23 1	600118	中国卫星	2024年01月04日- 2024年01月10日	25.82	40,600	1,048,292.0 0
23 2	600126	杭钢股份	2024年01月04日- 2024年01月10日	5.33	103,200	550,056.00
23 3	600129	太极集团	2024年01月02日- 2024年01月10日	46.46	26,900	1,249,774.0 0

23 4	600131	国网信通	2024年01月04日- 2024年01月10日	15.15	41,600	630,240.00
23 5	600141	兴发集团	2024年01月03日- 2024年01月10日	18.25	57,500	1,049,375.0 0
23 6	600143	金发科技	2024年01月03日- 2024年01月10日	7.99	142,400	1,137,776.0 0
23 7	600153	建发股份	2024年01月04日- 2024年01月10日	9.63	106,700	1,027,521.0 0
23 8	600155	华创云信	2024年01月04日- 2024年01月10日	8.34	158,700	1,323,558.0 0
23 9	600157	永泰能源	2024年01月04日- 2024年01月10日	1.37	1,460,600	2,001,022.0 0
24 0	600160	巨化股份	2024年01月02日- 2024年01月10日	16.49	102,600	1,691,874.0 0
24 1	600161	天坛生物	2024年01月04日- 2024年01月10日	30.94	58,500	1,809,990.0 0
24 2	600166	福田汽车	2024年01月02日- 2024年01月10日	2.73	362,200	988,806.00
24 3	600167	联美控股	2024年01月04日- 2024年01月10日	5.67	62,400	353,808.00
24 4	600170	上海建工	2024年01月04日- 2024年01月10日	2.34	472,500	1,105,650.0 0
24 5	600177	雅戈尔	2024年01月04日- 2024年01月10日	6.55	197,600	1,294,280.0 0
24 6	600208	新潮中宝	2024年01月03日- 2024年01月10日	2.17	303,500	658,595.00
24 7	600258	首旅酒店	2024年01月04日- 2024年01月10日	15.62	50,900	795,058.00
24 8	600271	航天信息	2024年01月04日- 2024年01月10日	10.64	79,000	840,560.00
24 9	600282	南钢股份	2024年01月02日- 2024年01月10日	3.70	234,900	869,130.00

25 0	600298	安琪酵母	2024年01月04日- 2024年01月10日	35.18	43,000	1,512,740.0 0
25 1	600299	安迪苏	2024年01月04日- 2024年01月10日	8.00	27,300	218,400.00
25 2	600315	上海家化	2024年01月04日- 2024年01月10日	21.18	23,500	497,730.00
25 3	600316	洪都航空	2024年01月04日- 2024年01月10日	21.17	24,500	518,665.00
25 4	600325	华发股份	2024年01月04日- 2024年01月10日	7.21	114,000	821,940.00
25 5	600329	达仁堂	2024年01月04日- 2024年01月10日	33.65	21,100	710,015.00
25 6	600339	中油工程	2024年01月04日- 2024年01月10日	3.03	119,100	360,873.00
25 7	600348	华阳股份	2024年01月04日- 2024年01月10日	9.76	129,500	1,263,920.0 0
25 8	600350	山东高速	2024年01月04日- 2024年01月10日	6.94	48,000	333,120.00
25 9	600352	浙江龙盛	2024年01月04日- 2024年01月10日	8.40	184,900	1,553,160.0 0
26 0	600369	西南证券	2024年01月04日- 2024年01月10日	4.09	279,200	1,141,928.0 0
26 1	600373	中文传媒	2024年01月05日- 2024年01月10日	13.18	26,800	353,224.00
26 2	600377	宁沪高速	2024年01月02日- 2024年01月10日	10.25	36,600	375,150.00
26 3	600378	昊华科技	2024年01月04日- 2024年01月10日	30.48	20,500	624,840.00
26 4	600380	健康元	2024年01月04日- 2024年01月10日	12.43	67,200	835,296.00
26 5	600390	五矿资本	2024年01月04日- 2024年01月10日	4.68	159,900	748,332.00

26 6	600392	盛和资源	2024年01月04日- 2024年01月10日	10.18	99,500	1,012,910.0 0
26 7	600398	海澜之家	2024年01月02日- 2024年01月10日	7.42	127,700	947,534.00
26 8	600399	抚顺特钢	2024年01月05日- 2024年01月10日	9.72	103,100	1,002,132.0 0
26 9	600415	小商品城	2024年01月04日- 2024年01月10日	7.32	189,000	1,383,480.0 0
27 0	600416	湘电股份	2024年01月02日- 2024年01月10日	15.88	68,400	1,086,192.0 0
27 1	600418	江淮汽车	2024年01月02日- 2024年01月10日	16.15	129,100	2,084,965.0 0
27 2	600435	北方导航	2024年01月05日- 2024年01月10日	11.74	68,600	805,364.00
27 3	600481	双良节能	2024年01月04日- 2024年01月10日	8.46	78,900	667,494.00
27 4	600482	中国动力	2024年01月02日- 2024年01月10日	18.01	83,100	1,496,631.0 0
27 5	600486	扬农化工	2024年01月05日- 2024年01月10日	63.12	15,900	1,003,608.0 0
27 6	600497	驰宏锌锗	2024年01月04日- 2024年01月10日	5.05	253,300	1,279,165.0 0
27 7	600498	烽火通信	2024年01月04日- 2024年01月10日	16.64	50,000	832,000.00
27 8	600499	科达制造	2024年01月02日- 2024年01月10日	10.55	116,300	1,226,965.0 0
27 9	600500	中化国际	2024年01月03日- 2024年01月10日	4.42	134,400	594,048.00
28 0	600511	国药股份	2024年01月04日- 2024年01月10日	28.62	26,300	752,706.00
28 1	600516	方大炭素	2024年01月02日- 2024年01月10日	5.24	198,800	1,041,712.0 0

28 2	600517	国网英大	2024年01月04日- 2024年01月10日	4.77	121,800	580,986.00
28 3	600521	华海药业	2024年01月04日- 2024年01月10日	14.67	63,100	925,677.00
28 4	600528	中铁工业	2024年01月04日- 2024年01月10日	7.44	80,100	595,944.00
28 5	600529	山东药玻	2024年01月04日- 2024年01月10日	25.60	46,300	1,185,280.0 0
28 6	600535	天士力	2024年01月03日- 2024年01月10日	17.02	68,000	1,157,360.0 0
28 7	600536	中国软件	2024年01月05日- 2024年01月10日	36.26	39,200	1,421,392.0 0
28 8	600546	山煤国际	2024年01月04日- 2024年01月10日	17.51	68,900	1,206,439.0 0
28 9	600549	厦门钨业	2024年01月04日- 2024年01月10日	17.18	60,400	1,037,672.0 0
29 0	600566	济川药业	2024年01月04日- 2024年01月10日	31.43	25,800	810,894.00
29 1	600580	卧龙电驱	2024年01月05日- 2024年01月10日	11.73	60,000	703,800.00
29 2	600582	天地科技	2024年01月04日- 2024年01月10日	5.44	117,700	640,288.00
29 3	600583	海油工程	2024年01月05日- 2024年01月10日	5.94	144,700	859,518.00
29 4	600597	光明乳业	2024年01月04日- 2024年01月10日	8.73	48,700	425,151.00
29 5	600598	北大荒	2024年01月04日- 2024年01月10日	11.97	50,300	602,091.00
29 6	600637	东方明珠	2024年01月03日- 2024年01月10日	7.52	155,900	1,172,368.0 0
29 7	600642	申能股份	2024年01月05日- 2024年01月10日	6.42	160,300	1,029,126.0 0

29 8	600655	豫园股份	2024年01月02日- 2024年01月10日	6.21	148,200	920,322.00
29 9	600663	陆家嘴	2024年01月04日- 2024年01月10日	8.75	50,300	440,125.00
30 0	600673	东阳光	2024年01月02日- 2024年01月10日	7.33	136,000	996,880.00
30 1	600699	均胜电子	2024年01月04日- 2024年01月10日	17.96	68,800	1,235,648.0 0
30 2	600704	物产中大	2024年01月04日- 2024年01月10日	4.43	221,500	981,245.00
30 3	600707	彩虹股份	2024年01月02日- 2024年01月10日	6.75	109,200	737,100.00
30 4	600737	中粮糖业	2024年01月04日- 2024年01月10日	8.24	76,000	626,240.00
30 5	600739	辽宁成大	2024年01月05日- 2024年01月10日	11.78	70,100	825,778.00
30 6	600755	厦门国贸	2024年01月04日- 2024年01月10日	6.97	94,200	656,574.00
30 7	600764	中国海防	2024年01月04日- 2024年01月10日	24.95	20,200	503,990.00
30 8	600765	中航重机	2024年01月04日- 2024年01月10日	19.11	73,100	1,396,941.0 0
30 9	600801	华新水泥	2024年01月04日- 2024年01月10日	12.43	46,200	574,266.00
31 0	600808	马钢股份	2024年01月04日- 2024年01月10日	2.72	171,000	465,120.00
31 1	600820	隧道股份	2024年01月04日- 2024年01月10日	5.76	156,400	900,864.00
31 2	600827	百联股份	2024年01月04日- 2024年01月10日	9.49	56,400	535,236.00
31 3	600839	四川长虹	2024年01月02日- 2024年01月10日	5.29	274,400	1,451,576.0 0

31 4	600848	上海临港	2024年01月04日- 2024年01月10日	10.05	68,000	683,400.00
31 5	600859	王府井	2024年01月02日- 2024年01月10日	15.97	60,400	964,588.00
31 6	600862	中航高科	2024年01月04日- 2024年01月10日	22.15	59,400	1,315,710.0 0
31 7	600863	内蒙华电	2024年01月04日- 2024年01月10日	3.90	224,700	876,330.00
31 8	600867	通化东宝	2024年01月04日- 2024年01月10日	10.83	99,200	1,074,336.0 0
31 9	600871	石化油服	2024年01月04日- 2024年01月10日	1.83	280,400	513,132.00
32 0	600873	梅花生物	2024年01月04日- 2024年01月10日	9.55	146,400	1,398,120.0 0
32 1	600879	航天电子	2024年01月04日- 2024年01月10日	7.71	150,200	1,158,042.0 0
32 2	600884	杉杉股份	2024年01月03日- 2024年01月10日	13.62	77,900	1,060,998.0 0
32 3	600885	宏发股份	2024年01月04日- 2024年01月10日	27.64	59,200	1,636,288.0 0
32 4	600895	张江高科	2024年01月02日- 2024年01月10日	19.30	57,600	1,111,680.0 0
32 5	600901	江苏金租	2024年01月02日- 2024年01月10日	4.84	128,900	623,876.00
32 6	600906	财达证券	2024年01月04日- 2024年01月10日	7.50	92,200	691,500.00
32 7	600909	华安证券	2024年01月04日- 2024年01月10日	4.88	200,400	977,952.00
32 8	600928	西安银行	2024年01月04日- 2024年01月10日	3.33	94,700	315,351.00
32 9	600956	新天绿能	2024年01月02日- 2024年01月10日	8.13	25,400	206,502.00

330	600959	江苏有线	2024年01月02日- 2024年01月10日	3.14	228,500	717,490.00
331	600967	内蒙一机	2024年01月05日- 2024年01月10日	8.26	55,700	460,082.00
332	600968	海油发展	2024年01月04日- 2024年01月10日	2.85	144,500	411,825.00
333	600970	中材国际	2024年01月04日- 2024年01月10日	9.34	74,200	693,028.00
334	600977	中国电影	2024年01月05日- 2024年01月10日	12.24	48,800	597,312.00
335	600985	淮北矿业	2024年01月04日- 2024年01月10日	16.63	69,100	1,149,133.00
336	600988	赤峰黄金	2024年01月04日- 2024年01月10日	14.01	117,900	1,651,779.00
337	600995	南网储能	2024年01月04日- 2024年01月10日	9.86	64,200	633,012.00
338	600998	九州通	2024年01月04日- 2024年01月10日	7.01	138,300	969,483.00
339	601000	唐山港	2024年01月05日- 2024年01月10日	3.50	193,900	678,650.00
340	601016	节能风电	2024年01月04日- 2024年01月10日	3.00	276,300	828,900.00
341	601058	赛轮轮胎	2024年01月02日- 2024年01月10日	11.75	184,400	2,166,700.00
342	601061	中信金属	2024年01月02日- 2024年01月10日	7.71	34,500	265,995.00
343	601077	渝农商行	2024年01月04日- 2024年01月10日	4.08	440,200	1,796,016.00
344	601098	中南传媒	2024年01月04日- 2024年01月10日	10.17	50,600	514,602.00
345	601106	中国一重	2024年01月04日- 2024年01月10日	2.88	194,900	561,312.00

34 6	601108	财通证券	2024年01月05日- 2024年01月10日	7.76	212,700	1,650,552.0 0
34 7	601128	常熟银行	2024年01月04日- 2024年01月10日	6.39	194,800	1,244,772.0 0
34 8	601139	深圳燃气	2024年01月04日- 2024年01月10日	6.89	40,700	280,423.00
34 9	601156	东航物流	2024年01月02日- 2024年01月10日	14.78	35,600	526,168.00
35 0	601158	重庆水务	2024年01月02日- 2024年01月10日	5.67	42,600	241,542.00
35 1	601162	天风证券	2024年01月04日- 2024年01月10日	3.09	492,600	1,522,134.0 0
35 2	601168	西部矿业	2024年01月04日- 2024年01月10日	14.27	131,200	1,872,224.0 0
35 3	601179	中国西电	2024年01月04日- 2024年01月10日	4.93	145,700	718,301.00
35 4	601198	东兴证券	2024年01月04日- 2024年01月10日	8.23	137,800	1,134,094.0 0
35 5	601216	君正集团	2024年01月05日- 2024年01月10日	3.74	221,000	826,540.00
35 6	601228	广州港	2024年01月04日- 2024年01月10日	3.13	106,800	334,284.00
35 7	601231	环旭电子	2024年01月04日- 2024年01月10日	15.11	47,000	710,170.00
35 8	601233	桐昆股份	2024年01月04日- 2024年01月10日	15.13	120,000	1,815,600.0 0
35 9	601298	青岛港	2024年01月05日- 2024年01月10日	6.18	45,700	282,426.00
36 0	601555	东吴证券	2024年01月05日- 2024年01月10日	7.31	262,300	1,917,413.0 0
36 1	601568	北元集团	2024年01月04日- 2024年01月10日	4.74	84,600	401,004.00

36 2	601577	长沙银行	2024年01月04日- 2024年01月10日	6.82	169,100	1,153,262.0 0
36 3	601598	中国外运	2024年01月04日- 2024年01月10日	5.24	112,000	586,880.00
36 4	601608	中信重工	2024年01月04日- 2024年01月10日	3.86	123,200	475,552.00
36 5	601611	中国核建	2024年01月05日- 2024年01月10日	6.93	78,900	546,777.00
36 6	601636	旗滨集团	2024年01月04日- 2024年01月10日	6.84	114,400	782,496.00
36 7	601665	齐鲁银行	2024年01月04日- 2024年01月10日	3.91	162,800	636,548.00
36 8	601666	平煤股份	2024年01月02日- 2024年01月10日	11.56	105,700	1,221,892.0 0
36 9	601696	中银证券	2024年01月04日- 2024年01月10日	10.29	117,300	1,207,017.0 0
37 0	601717	郑煤机	2024年01月05日- 2024年01月10日	12.65	70,300	889,295.00
37 1	601778	晶科科技	2024年01月04日- 2024年01月10日	3.50	196,800	688,800.00
37 2	601828	美凯龙	2024年01月02日- 2024年01月10日	3.87	81,700	316,179.00
37 3	601866	中远海发	2024年01月04日- 2024年01月10日	2.34	273,400	639,756.00
37 4	601880	辽港股份	2024年01月02日- 2024年01月10日	1.45	573,700	831,865.00
37 5	601928	凤凰传媒	2024年01月02日- 2024年01月10日	8.81	56,500	497,765.00
37 6	601933	永辉超市	2024年01月05日- 2024年01月10日	2.82	237,700	670,314.00
37 7	601958	金钼股份	2024年01月04日- 2024年01月10日	9.45	68,600	648,270.00

378	601966	玲珑轮胎	2024年01月03日- 2024年01月10日	19.23	57,200	1,099,956.0 0
379	601990	南京证券	2024年01月04日- 2024年01月10日	7.98	157,300	1,255,254.0 0
380	601991	大唐发电	2024年01月05日- 2024年01月10日	2.42	243,500	589,270.00
381	601992	金隅集团	2024年01月03日- 2024年01月10日	1.91	308,400	589,044.00
382	601997	贵阳银行	2024年01月04日- 2024年01月10日	5.14	207,800	1,068,092.0 0
383	603000	人民网	2024年01月02日- 2024年01月10日	27.98	40,700	1,138,786.0 0
384	603056	德邦股份	2024年01月02日- 2024年01月10日	14.47	23,000	332,810.00
385	603077	和邦生物	2024年01月04日- 2024年01月10日	2.36	470,300	1,109,908.0 0
386	603127	昭衍新药	2024年01月04日- 2024年01月10日	23.71	26,600	630,686.00
387	603156	养元饮品	2024年01月04日- 2024年01月10日	21.26	35,900	763,234.00
388	603160	汇顶科技	2024年01月04日- 2024年01月10日	69.10	19,100	1,319,810.0 0
389	603185	弘元绿能	2024年01月05日- 2024年01月10日	33.28	18,800	625,664.00
390	603218	日月股份	2024年01月02日- 2024年01月10日	12.37	38,100	471,297.00
391	603225	新凤鸣	2024年01月04日- 2024年01月10日	14.20	52,800	749,760.00
392	603228	景旺电子	2024年01月04日- 2024年01月10日	22.56	23,500	530,160.00
393	603233	大参林	2024年01月04日- 2024年01月10日	24.90	32,000	796,800.00

39 4	603305	旭升集团	2024年01月03日- 2024年01月10日	19.73	26,000	512,980.00
39 5	603317	天味食品	2024年01月04日- 2024年01月10日	13.29	22,100	293,709.00
39 6	603338	浙江鼎力	2024年01月03日- 2024年01月10日	51.17	17,700	905,709.00
39 7	603355	莱克电气	2024年01月05日- 2024年01月10日	22.30	7,400	165,020.00
39 8	603379	三美股份	2024年01月02日- 2024年01月10日	34.00	17,200	584,800.00
39 9	603444	吉比特	2024年01月04日- 2024年01月04日	245.12	1,100	269,632.00
40 0	603456	九洲药业	2024年01月04日- 2024年01月10日	24.21	37,800	915,138.00
40 1	603517	绝味食品	2024年01月04日- 2024年01月10日	26.86	26,500	711,790.00
40 2	603529	爱玛科技	2024年01月04日- 2024年01月10日	25.04	14,000	350,560.00
40 3	603568	伟明环保	2024年01月04日- 2024年01月10日	16.00	36,200	579,200.00
40 4	603589	口子窖	2024年01月04日- 2024年01月10日	45.30	25,200	1,141,560.0 0
40 5	603596	伯特利	2024年01月04日- 2024年01月10日	69.30	20,400	1,413,720.0 0
40 6	603606	东方电缆	2024年01月03日- 2024年01月10日	42.75	29,000	1,239,750.0 0
40 7	603650	彤程新材	2024年01月03日- 2024年01月10日	33.30	17,100	569,430.00
40 8	603658	安图生物	2024年01月04日- 2024年01月10日	57.01	16,300	929,263.00
40 9	603707	健友股份	2024年01月05日- 2024年01月10日	15.00	31,600	474,000.00

410	603712	七一二	2024年01月04日- 2024年01月10日	31.51	32,500	1,024,075.0 0
411	603737	三棵树	2024年01月04日- 2024年01月10日	47.61	10,800	514,188.00
412	603786	科博达	2024年01月04日- 2024年01月04日	71.36	3,500	249,760.00
413	603816	顾家家居	2024年01月04日- 2024年01月10日	35.00	28,000	980,000.00
414	603858	步长制药	2024年01月04日- 2024年01月10日	17.01	39,300	668,493.00
415	603866	桃李面包	2024年01月04日- 2024年01月10日	7.66	56,600	433,556.00
416	603868	飞科电器	2024年01月04日- 2024年01月04日	50.50	1,200	60,600.00
417	603882	金域医学	2024年01月04日- 2024年01月10日	62.57	19,700	1,232,629.0 0
418	603883	老百姓	2024年01月04日- 2024年01月10日	29.89	21,300	636,657.00
419	603885	吉祥航空	2024年01月04日- 2024年01月10日	12.00	62,100	745,200.00
420	603927	中科软	2024年01月04日- 2024年01月10日	29.98	25,900	776,482.00
421	603939	益丰药房	2024年01月04日- 2024年01月10日	40.04	35,500	1,421,420.0 0
422	605358	立昂微	2024年01月02日- 2024年01月10日	27.39	39,400	1,079,166.0 0
423	688029	南微医学	2024年01月04日- 2024年01月10日	96.80	5,100	493,680.00
424	688032	禾迈股份	2024年01月05日- 2024年01月05日	270.00	2,000	540,000.00
425	688052	纳芯微	2024年01月04日- 2024年01月10日	166.85	3,900	650,715.00

42 6	688063	派能科技	2024年01月05日- 2024年01月10日	106.00	6,600	699,600.00
42 7	688072	拓荆科技	2024年01月04日- 2024年01月10日	231.30	4,400	1,017,720.0 0
42 8	688082	盛美上海	2024年01月04日- 2024年01月10日	104.41	4,200	438,522.00
42 9	688105	诺唯赞	2024年01月04日- 2024年01月10日	32.02	8,300	265,766.00
43 0	688107	安路科技	2024年01月04日- 2024年01月10日	36.78	10,800	397,224.00
43 1	688120	华海清科	2024年01月05日- 2024年01月10日	187.70	6,000	1,126,200.0 0
43 2	688122	西部超导	2024年01月05日- 2024年01月10日	53.23	29,800	1,586,254.0 0
43 3	688153	唯捷创芯	2024年01月10日- 2024年01月10日	65.50	2,500	163,750.00
43 4	688169	石头科技	2024年01月04日- 2024年01月10日	282.95	3,200	905,440.00
43 5	688180	君实生物	2024年01月05日- 2024年01月10日	41.83	30,000	1,254,900.0 0
43 6	688188	柏楚电子	2024年01月04日- 2024年01月10日	253.11	2,100	531,531.00
43 7	688200	华峰测控	2024年01月04日- 2024年01月10日	122.80	4,300	528,040.00
43 8	688234	天岳先进	2024年01月04日- 2024年01月10日	66.07	11,400	753,198.00
43 9	688248	南网科技	2024年01月04日- 2024年01月10日	24.97	4,400	109,868.00
44 0	688276	百克生物	2024年01月04日- 2024年01月10日	54.81	8,300	454,923.00
44 1	688281	华秦科技	2024年01月04日- 2024年01月04日	135.66	1,000	135,660.00

44 2	688295	中复神鹰	2024年01月04日- 2024年01月10日	30.31	8,300	251,573.00
44 3	688297	中无人机	2024年01月05日- 2024年01月10日	38.33	8,600	329,638.00
44 4	688301	奕瑞科技	2024年01月04日- 2024年01月04日	325.26	1,300	422,838.00
44 5	688331	荣昌生物	2024年01月05日- 2024年01月10日	62.06	11,400	707,484.00
44 6	688348	昱能科技	2024年01月10日- 2024年01月10日	122.38	1,000	122,380.00
44 7	688387	信科移动	2024年01月04日- 2024年01月10日	7.21	48,100	346,801.00
44 8	688390	固德威	2024年01月04日- 2024年01月10日	130.58	8,300	1,083,814.0 0
44 9	688425	铁建重工	2024年01月05日- 2024年01月10日	3.97	104,900	416,453.00
45 0	688516	奥特维	2024年01月05日- 2024年01月10日	90.50	7,100	642,550.00
45 1	688536	思瑞浦	2024年01月04日- 2024年01月10日	146.30	3,800	555,940.00
45 2	688538	和辉光电	2024年01月04日- 2024年01月10日	2.43	282,900	687,447.00
45 3	688567	孚能科技	2024年01月05日- 2024年01月10日	16.31	47,900	781,249.00
45 4	688690	纳微科技	2024年01月04日- 2024年01月10日	27.42	14,400	394,848.00
45 5	688728	格科微	2024年01月05日- 2024年01月10日	20.47	50,900	1,041,923.0 0
45 6	688772	珠海冠宇	2024年01月02日- 2024年01月10日	22.01	49,200	1,082,892.0 0
45 7	688778	厦钨新能	2024年01月04日- 2024年01月10日	39.64	11,300	447,932.00

458	688779	长远锂科	2024年01月04日- 2024年01月10日	7.30	68,200	497,860.00
459	688819	天能股份	2024年01月04日- 2024年01月10日	27.92	9,300	259,656.00
460	689009	九号公司	2024年01月04日- 2024年01月10日	29.66	24,900	738,534.00
合计	-	-	-	-	44,584,300	413,312,111.00

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是被动式投资的股票型指数基金，紧密跟踪标的指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似，本基金预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。本基金采用完全复制法，跟踪标的指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但因特殊情况(比如流动性不足等)导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可使用其他合理方法进行适当的替代，力求与标的指数的跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。本基金的基金管理人奉行全面风险管理理念，建立了以风险委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、内控合规部、风险管理部、内审部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。在全面风险管理体系的框架下，董事会负责监督检查公司的合法合规运营、内部控制、风险管理，从而控制公司的整体运营风险。在董事会下设立风险委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理委员会，主要负责拟定公司风险管理战略，经董事会批准后组织实施；组织实施经董事会批准的年度风险预算、风险可容忍度限额及其他量化风险管理工具；根据公司总体风险控制目标，制定各业务和各环节风险控制目标和要求；落实公司就重大风险管理作出的决定或决议；听取并讨论会议议题，就重大风险管理事项形成决议；拟定或批准公司风险管理制度、流程。在业务操作层面风险管理职责主要由内控合规部和风险管理部负责，内控合规部负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理提供合规控制标准，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标；内控合规部对公司总经理负责，并由督察长分管。风险管理部通过投资交易系统的风控参数设置，保证各投资组合的投资比例合规；参与各投资组合新股申购、一级债申购、银行间交易等场外交易的风险识别与评估，保证各投资组合场外交易的事中合规控制；负责各投资

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

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，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国泰君安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

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
AAA	-	310,578.92
AAA以下	163,905.03	420,005.52
未评级	-	-
合计	163,905.03	730,584.44

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级的资产支持证券。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级的同业存单。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险来自调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

于2023年12月31日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注7.4.12。此外，本基金可通过卖出

回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。本期末，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合法律法规的相关要求。

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

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的管理人定期对组合中债券投资和资产支持证券投资部分面临的利率风险进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2023年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	18,144,345.68	-	-	-	18,144,345.68
结算备付金	130,819.57	-	-	64,114,084.35	64,244,903.92
存出保证金	225,039.53	-	-	10,415,745.60	10,640,785.13

交易性金融资产	-	-	163,905.03	2,113,138,158.10	2,113,302,063.13
应收清算款	-	-	-	9,105,378.05	9,105,378.05
其他资产	-	-	-	132,673.59	132,673.59
资产总计	18,500,204.78	-	163,905.03	2,196,906,039.69	2,215,570,149.50
负债					
应付清算款	-	-	-	9,242,508.41	9,242,508.41
应付管理人报酬	-	-	-	923,303.65	923,303.65
应付托管费	-	-	-	184,660.74	184,660.74
应交税费	-	-	-	12,049.76	12,049.76
其他负债	-	-	-	691,194.50	691,194.50
负债总计	-	-	-	11,053,717.06	11,053,717.06
利率敏感度缺口	18,500,204.78	-	163,905.03	2,185,852,322.63	2,204,516,432.44
上年度末 2022年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	30,541,972.80	-	-	-	30,541,972.80
结算备付金	40,615,283.86	-	-	20,617,715.07	61,232,998.93
存出保证金	248,125.41	-	-	13,652,105.60	13,900,231.01
交易性金融资产	-	-	730,584.44	2,232,596,024.84	2,233,326,609.28
应收股利	-	-	-	4,144.50	4,144.50
其他资产	-	-	-	140,915.40	140,915.40
资产总计	71,405,382.07	-	730,584.44	2,267,010,905.41	2,339,146,871.92
负债					
应付清算款	-	-	-	3,223,994.11	3,223,994.11
应付管理人报酬	-	-	-	1,008,793.41	1,008,793.41
应付托管费	-	-	-	201,758.69	201,758.69
应交税费	-	-	-	5,202.43	5,202.43
其他负债	-	-	-	736,002.83	736,002.83
负债总计	-	-	-	5,175,751.47	5,175,751.47

利率敏感度缺口	71,405,382.0 7	-	730,584.44	2,261,835,153.9 4	2,333,971,120.4 5
---------	-------------------	---	------------	----------------------	----------------------

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2023年12月31日，本基金持有的交易性债券投资占基金净资产的比例为0.01%(2022年12月31日：0.03%)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响(2022年12月31日：同)。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金原则上采用完全复制法，跟踪中证500指数，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金投资组合，并根据标的指数组成及其权重的变动而进行相应调整。但因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年12月31日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	2,113,138,158.10	95.85	2,232,596,024.84	95.66
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	2,113,138,158.10	95.85	2,232,596,024.84	95.66

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

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位：人民币元)	
		本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日
	业绩比较基准上升5%	111,303,423.82	115,088,115.95
	业绩比较基准下降5%	-111,303,423.82	-115,088,115.95

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年12月31日	上年度末 2022年12月31日

第一层次	2,111,830,099.79	2,222,673,415.48
第二层次	163,905.03	8,889,959.52
第三层次	1,308,058.31	1,763,234.28
合计	2,113,302,063.13	2,233,326,609.28

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	1,763,234.28	1,763,234.28
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	4,167,283.20	4,167,283.20
转出第三层次	-	4,083,432.51	4,083,432.51
当期利得或损失总额	-	-539,026.66	-539,026.66
其中：计入损益的利得或损失	-	-539,026.66	-539,026.66
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,308,058.31	1,308,058.31
期末仍持有的第三层	-	-294,168.95	-294,168.95

项目	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
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			
期初余额	-	1,170,374.17	1,170,374.17
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	3,484,669.59	3,484,669.59
转出第三层次	-	4,549,492.08	4,549,492.08
当期利得或损失总额	-	1,657,682.60	1,657,682.60
其中：计入损益的利得或损失	-	1,657,682.60	1,657,682.60
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	1,763,234.28	1,763,234.28
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	-	-305,720.84	-305,720.84

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

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

单位：人民币元

项目	本期末公允	采用的估值技	不可观察输入值
----	-------	--------	---------

	价值	术	名称	范围/加权 平均值	与公允价值之 间的关系
股票 投资	1,308,058.31	平均价格亚式 期权模型	预期年化 波动率	0.1962~2.19 88	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	1,763,234.28	平均价格亚式 期权模型	预期年化 波动率	0.1891~2.47 56	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	2,113,138,158.10	95.38
	其中：股票	2,113,138,158.10	95.38
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	163,905.03	0.01
	其中：债券	163,905.03	0.01
	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	82,389,249.60	3.72
8	其他各项资产	19,878,836.77	0.90
9	合计	2,215,570,149.50	100.00

注：1、上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而下一节按行业分类股票投资组合的合计项不含可退替代款估值增值。

2、本报告期末，本基金参与转融通证券出借业务出借证券的公允价值为413,312,111.00元，占基金资产净值的比例为18.75%。

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	14,359,019.00	0.65
B	采矿业	81,740,643.00	3.71
C	制造业	1,332,534,596.96	60.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	68,853,535.50	3.12
E	建筑业	16,873,325.00	0.77
F	批发和零售业	63,862,999.70	2.90
G	交通运输、仓储和邮政业	39,137,307.00	1.78
H	住宿和餐饮业	3,448,896.00	0.16
I	信息传输、软件和信息技术服务业	159,567,127.43	7.24
J	金融业	191,209,715.28	8.67
K	房地产业	26,388,044.14	1.20
L	租赁和商务服务业	18,814,123.00	0.85
M	科学研究和技术服务业	19,392,598.36	0.88

N	水利、环境和公共设施管理业	11,239,934.00	0.51
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	5,822,568.00	0.26
Q	卫生和社会工作	15,994,396.42	0.73
R	文化、体育和娱乐业	30,208,587.00	1.37
S	综合	12,382,541.00	0.56
	合计	2,111,829,956.79	95.80

8.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,139,916.00	0.05
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	56,342.59	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	13,981.41	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	59,263.03	0.00
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	3,058.00	0.00
M	科学研究和技术服务业	26,564.46	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	8,932.82	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,308,058.31	0.06

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	300502	新易盛	235,000	11,590,200.00	0.53
2	002422	科伦药业	389,900	11,326,595.00	0.51
3	002028	思源电气	203,900	10,610,956.00	0.48
4	300418	昆仑万维	281,300	10,520,620.00	0.48
5	600157	永泰能源	7,344,900	10,062,513.00	0.46
6	000988	华工科技	332,700	9,901,152.00	0.45
7	002463	沪电股份	441,300	9,761,556.00	0.44
8	601058	赛轮轮胎	825,800	9,703,150.00	0.44
9	601555	东吴证券	1,324,570	9,682,606.70	0.44
10	000975	银泰黄金	643,020	9,645,300.00	0.44
11	600079	人福医药	377,800	9,392,108.00	0.43
12	600418	江淮汽车	577,400	9,325,010.00	0.42
13	002340	格林美	1,697,900	9,270,534.00	0.42
14	601168	西部矿业	630,900	9,002,943.00	0.41
15	000933	神火股份	521,400	8,759,520.00	0.40
16	301236	软通动力	189,000	8,731,800.00	0.40
17	601233	桐昆股份	558,200	8,445,566.00	0.38
18	600161	天坛生物	272,600	8,434,244.00	0.38
19	300394	天孚通信	91,500	8,374,080.00	0.38

20	601077	渝农商行	2,047,500	8,353,800.00	0.38
21	601108	财通证券	1,074,000	8,334,240.00	0.38
22	000630	铜陵有色	2,511,600	8,238,048.00	0.37
23	002384	东山精密	452,717	8,230,395.06	0.37
24	300037	新宙邦	173,660	8,214,118.00	0.37
25	002156	通富微电	350,600	8,105,872.00	0.37
26	688122	西部超导	150,600	8,016,438.00	0.36
27	000009	中国宝安	681,800	8,004,332.00	0.36
28	002517	恺英网络	710,700	7,938,519.00	0.36
29	300012	华测检测	556,660	7,904,572.00	0.36
30	002966	苏州银行	1,212,789	7,834,616.94	0.36
31	600109	国金证券	861,800	7,825,144.00	0.35
32	600988	赤峰黄金	550,500	7,712,505.00	0.35
33	600885	宏发股份	275,960	7,627,534.40	0.35
34	300136	信维通信	320,200	7,556,720.00	0.34
35	688169	石头科技	26,080	7,379,336.00	0.33
36	002465	海格通信	574,255	7,379,176.75	0.33
37	600160	巨化股份	446,800	7,367,732.00	0.33
38	002625	光启技术	498,100	7,361,918.00	0.33
39	000423	东阿阿胶	149,200	7,358,544.00	0.33
40	300207	欣旺达	492,100	7,263,396.00	0.33
41	600352	浙江龙盛	860,200	7,225,680.00	0.33
42	002185	华天科技	847,590	7,221,466.80	0.33
43	002138	顺络电子	266,900	7,208,969.00	0.33
44	600536	中国软件	198,798	7,208,415.48	0.33
45	688072	拓荆科技	31,048	7,181,402.40	0.33
46	002738	中矿资源	191,440	7,142,626.40	0.32
47	601162	天风证券	2,291,600	7,081,044.00	0.32
48	600298	安琪酵母	200,800	7,064,144.00	0.32
49	000932	华菱钢铁	1,369,400	7,052,410.00	0.32
50	300003	乐普医疗	435,700	7,040,912.00	0.32

51	603596	伯特利	100,300	6,950,790.00	0.32
52	688099	晶晨股份	110,329	6,909,905.27	0.31
53	000783	长江证券	1,278,600	6,878,868.00	0.31
54	002223	鱼跃医疗	198,709	6,871,357.22	0.31
55	300144	宋城演艺	692,400	6,833,988.00	0.31
56	300724	捷佳伟创	92,200	6,823,722.00	0.31
57	002078	太阳纸业	554,600	6,749,482.00	0.31
58	002439	启明星辰	249,900	6,747,300.00	0.31
59	603939	益丰药房	167,280	6,697,891.20	0.30
60	000723	美锦能源	1,002,100	6,673,986.00	0.30
61	600415	小商品城	907,400	6,642,168.00	0.30
62	600096	云天化	423,601	6,608,175.60	0.30
63	002739	万达电影	503,700	6,558,174.00	0.30
64	002385	大北农	1,094,800	6,525,008.00	0.30
65	300568	星源材质	422,900	6,521,118.00	0.30
66	002756	永兴材料	124,900	6,521,029.00	0.30
67	600765	中航重机	341,040	6,517,274.40	0.30
68	600482	中国动力	361,800	6,516,018.00	0.30
69	600873	梅花生物	680,900	6,502,595.00	0.29
70	000066	中国长城	640,400	6,480,848.00	0.29
71	002532	天山铝业	1,075,700	6,464,957.00	0.29
72	600839	四川长虹	1,221,400	6,461,206.00	0.29
73	002797	第一创业	1,111,900	6,460,139.00	0.29
74	300474	景嘉微	90,360	6,389,355.60	0.29
75	688180	君实生物	152,200	6,366,526.00	0.29
76	300017	网宿科技	804,800	6,317,680.00	0.29
77	300395	菲利华	172,000	6,288,320.00	0.29
78	603160	汇顶科技	90,900	6,281,190.00	0.28
79	002600	领益智造	927,400	6,269,224.00	0.28
80	600155	华创云信	747,800	6,236,652.00	0.28
81	002273	水晶光电	460,100	6,229,754.00	0.28

82	002044	美年健康	1,035,500	6,223,355.00	0.28
83	300285	国瓷材料	265,808	6,145,480.96	0.28
84	600862	中航高科	276,500	6,124,475.00	0.28
85	002294	信立泰	184,400	6,022,504.00	0.27
86	300601	康泰生物	221,800	6,021,870.00	0.27
87	600177	雅戈尔	918,900	6,018,795.00	0.27
88	600129	太极集团	129,000	5,993,340.00	0.27
89	300866	安克创新	67,200	5,953,920.00	0.27
90	600497	驰宏锌锗	1,177,500	5,946,375.00	0.27
91	688120	华海清科	31,550	5,921,935.00	0.27
92	688114	华大智造	68,832	5,920,928.64	0.27
93	000728	国元证券	865,400	5,910,682.00	0.27
94	300058	蓝色光标	823,000	5,909,140.00	0.27
95	002472	双环传动	225,100	5,857,102.00	0.27
96	601990	南京证券	732,000	5,841,360.00	0.26
97	600699	均胜电子	325,100	5,838,796.00	0.26
98	603606	东方电缆	136,500	5,835,375.00	0.26
99	600066	宇通客车	439,600	5,824,700.00	0.26
100	002607	中公教育	1,427,100	5,822,568.00	0.26
101	603882	金域医学	93,000	5,819,010.00	0.26
102	600348	华阳股份	595,800	5,815,008.00	0.26
103	002195	岩山科技	1,893,000	5,811,510.00	0.26
104	000831	中国稀土	210,011	5,811,004.37	0.26
105	601128	常熟银行	907,100	5,796,369.00	0.26
106	002008	大族激光	278,400	5,768,448.00	0.26
107	300146	汤臣倍健	337,600	5,749,328.00	0.26
108	600546	山煤国际	326,800	5,722,268.00	0.26
109	603816	顾家家居	163,200	5,712,000.00	0.26
110	002353	杰瑞股份	202,800	5,700,708.00	0.26
111	601696	中银证券	551,400	5,673,906.00	0.26
112	002673	西部证券	885,800	5,642,546.00	0.26

113	000893	亚钾国际	214,500	5,628,480.00	0.26
114	600529	山东药玻	218,800	5,601,280.00	0.25
115	688301	奕瑞科技	16,960	5,516,409.60	0.25
116	300604	长川科技	144,400	5,485,756.00	0.25
117	600985	淮北矿业	327,100	5,439,673.00	0.25
118	601577	长沙银行	796,900	5,434,858.00	0.25
119	300088	长信科技	812,300	5,434,287.00	0.25
120	600499	科达制造	514,500	5,427,975.00	0.25
121	600060	海信视像	259,700	5,427,730.00	0.25
122	002262	恩华药业	199,700	5,415,864.00	0.25
123	603589	口子窖	119,200	5,399,760.00	0.24
124	600369	西南证券	1,318,300	5,391,847.00	0.24
125	002444	巨星科技	238,758	5,376,830.16	0.24
126	000997	新大陆	273,200	5,357,452.00	0.24
127	002624	完美世界	449,500	5,322,080.00	0.24
128	300118	东方日升	301,200	5,316,180.00	0.24
129	601666	平煤股份	459,400	5,310,664.00	0.24
130	688728	格科微	258,273	5,286,848.31	0.24
131	601198	东兴证券	641,800	5,282,014.00	0.24
132	002409	雅克科技	94,400	5,260,912.00	0.24
133	688002	睿创微纳	118,504	5,240,246.88	0.24
134	688390	固德威	40,088	5,234,691.04	0.24
135	600642	申能股份	809,900	5,199,558.00	0.24
136	603688	石英股份	59,800	5,195,424.00	0.24
137	000400	许继电气	236,100	5,184,756.00	0.24
138	300699	光威复材	192,340	5,129,707.80	0.23
139	300073	当升科技	134,100	5,122,620.00	0.23
140	603000	人民网	182,900	5,117,542.00	0.23
141	002558	巨人网络	457,100	5,092,094.00	0.23
142	600637	东方明珠	677,100	5,091,792.00	0.23
143	600486	扬农化工	80,640	5,089,996.80	0.23

144	600884	杉杉股份	373,600	5,088,432.00	0.23
145	002131	利欧股份	2,231,700	5,088,276.00	0.23
146	000683	远兴能源	865,300	5,079,311.00	0.23
147	600535	天士力	297,300	5,060,046.00	0.23
148	600399	抚顺特钢	520,500	5,059,260.00	0.23
149	000591	太阳能	905,500	5,052,690.00	0.23
150	000878	云南铜业	463,900	5,051,871.00	0.23
151	600879	航天电子	654,700	5,047,737.00	0.23
152	600118	中国卫星	195,400	5,045,228.00	0.23
153	000629	钒钛股份	1,536,200	5,038,736.00	0.23
154	002152	广电运通	409,750	5,023,535.00	0.23
155	000021	深科技	309,000	5,008,890.00	0.23
156	600867	通化东宝	461,700	5,000,211.00	0.23
157	002497	雅化集团	381,000	4,987,290.00	0.23
158	601997	贵阳银行	966,700	4,968,838.00	0.23
159	688521	芯原股份	99,300	4,961,028.00	0.23
160	600895	张江高科	256,300	4,946,590.00	0.22
161	600143	金发科技	619,000	4,945,810.00	0.22
162	300001	特锐德	244,600	4,916,460.00	0.22
163	000998	隆平高科	348,600	4,915,260.00	0.22
164	300390	天华新能	193,730	4,911,055.50	0.22
165	605358	立昂微	179,200	4,908,288.00	0.22
166	000703	恒逸石化	728,000	4,892,160.00	0.22
167	688772	珠海冠宇	222,000	4,886,220.00	0.22
168	600516	方大炭素	931,900	4,883,156.00	0.22
169	688188	柏楚电子	19,290	4,882,491.90	0.22
170	688220	翱捷科技	69,200	4,874,448.00	0.22
171	600416	湘电股份	306,200	4,862,456.00	0.22
172	300024	机器人	409,310	4,858,509.70	0.22
173	002240	盛新锂能	212,800	4,841,200.00	0.22
174	600549	厦门钨业	281,500	4,836,170.00	0.22

175	002432	九安医疗	128,300	4,833,061.00	0.22
176	603712	七一二	153,300	4,830,483.00	0.22
177	603077	和邦生物	2,043,600	4,822,896.00	0.22
178	600170	上海建工	2,057,000	4,813,380.00	0.22
179	002407	多氟多	315,020	4,794,604.40	0.22
180	600153	建发股份	496,200	4,778,406.00	0.22
181	002430	杭氧股份	162,900	4,758,309.00	0.22
182	688052	纳芯微	28,400	4,738,540.00	0.21
183	600392	盛和资源	463,700	4,720,466.00	0.21
184	600141	兴发集团	257,500	4,699,375.00	0.21
185	601966	玲珑轮胎	243,800	4,688,274.00	0.21
186	000960	锡业股份	325,600	4,662,592.00	0.21
187	000623	吉林敖东	307,700	4,658,578.00	0.21
188	000039	中集集团	608,050	4,651,582.50	0.21
189	300383	光环新网	475,500	4,621,860.00	0.21
190	300748	金力永磁	226,720	4,584,278.40	0.21
191	002065	东华软件	742,300	4,579,991.00	0.21
192	600704	物产中大	1,030,600	4,565,558.00	0.21
193	600909	华安证券	932,010	4,548,208.80	0.21
194	600998	九州通	646,567	4,532,434.67	0.21
195	300212	易华录	143,580	4,515,591.00	0.20
196	601717	郑煤机	356,100	4,504,665.00	0.20
197	000750	国海证券	1,266,300	4,482,702.00	0.20
198	300487	蓝晓科技	83,500	4,430,510.00	0.20
199	603658	安图生物	77,600	4,423,976.00	0.20
200	002064	华峰化学	656,400	4,404,444.00	0.20
201	002203	海亮股份	394,900	4,403,135.00	0.20
202	002268	电科网安	195,600	4,393,176.00	0.20
203	600673	东阳光	597,300	4,378,209.00	0.20
204	002025	航天电器	90,700	4,355,414.00	0.20
205	600583	海油工程	731,600	4,345,704.00	0.20

206	600166	福田汽车	1,588,400	4,336,332.00	0.20
207	603456	九洲药业	178,600	4,323,906.00	0.20
208	000050	深天马 A	405,700	4,320,705.00	0.20
209	000738	航发控制	216,800	4,314,320.00	0.20
210	600521	华海药业	293,900	4,311,513.00	0.20
211	603338	浙江鼎力	83,800	4,288,046.00	0.19
212	300558	贝达药业	83,100	4,283,805.00	0.19
213	601456	国联证券	394,600	4,277,464.00	0.19
214	002568	百润股份	173,700	4,274,757.00	0.19
215	002939	长城证券	534,000	4,272,000.00	0.19
216	300114	中航电测	97,600	4,270,000.00	0.19
217	000513	丽珠集团	121,932	4,268,839.32	0.19
218	002368	太极股份	144,420	4,264,722.60	0.19
219	689009	九号公司	143,100	4,244,346.00	0.19
220	002299	圣农发展	246,900	4,241,742.00	0.19
221	002506	协鑫集成	1,547,000	4,238,780.00	0.19
222	600398	海澜之家	571,100	4,237,562.00	0.19
223	002128	电投能源	296,100	4,225,347.00	0.19
224	600863	内蒙华电	1,078,300	4,205,370.00	0.19
225	600859	王府井	262,900	4,198,513.00	0.19
226	600820	隧道股份	728,100	4,193,856.00	0.19
227	002092	中泰化学	684,705	4,176,700.50	0.19
228	002429	兆驰股份	748,500	4,176,630.00	0.19
229	601216	君正集团	1,116,600	4,176,084.00	0.19
230	600739	辽宁成大	354,500	4,176,010.00	0.19
231	000636	风华高科	305,600	4,174,496.00	0.19
232	600563	法拉电子	44,700	4,139,220.00	0.19
233	002414	高德红外	564,900	4,123,770.00	0.19
234	002373	千方科技	366,000	4,102,860.00	0.19
235	300253	卫宁健康	568,180	4,085,214.20	0.19
236	600435	北方导航	347,200	4,076,128.00	0.18

237	002926	华西证券	519,700	4,032,872.00	0.18
238	000729	燕京啤酒	466,200	4,023,306.00	0.18
239	300595	欧普康视	178,100	4,021,498.00	0.18
240	300296	利亚德	668,700	4,012,200.00	0.18
241	600655	豫园股份	644,300	4,001,103.00	0.18
242	300009	安科生物	387,960	3,964,951.20	0.18
243	300244	迪安诊断	165,982	3,952,031.42	0.18
244	300251	光线传媒	484,700	3,950,305.00	0.18
245	688567	孚能科技	242,004	3,947,085.24	0.18
246	300676	华大基因	82,200	3,945,600.00	0.18
247	002595	豪迈科技	132,400	3,941,548.00	0.18
248	600021	上海电力	465,800	3,940,668.00	0.18
249	600325	华发股份	546,400	3,939,544.00	0.18
250	300373	扬杰科技	107,100	3,930,570.00	0.18
251	600008	首创环保	1,455,650	3,915,698.50	0.18
252	600271	航天信息	367,700	3,912,328.00	0.18
253	600498	烽火通信	234,300	3,898,752.00	0.18
254	000519	中兵红箭	276,400	3,880,656.00	0.18
255	601016	节能风电	1,285,370	3,856,110.00	0.17
256	600566	济川药业	122,100	3,837,603.00	0.17
257	002500	山西证券	710,936	3,831,945.04	0.17
258	688536	思瑞浦	26,185	3,830,865.50	0.17
259	688005	容百科技	96,200	3,828,760.00	0.17
260	600004	白云机场	391,000	3,823,980.00	0.17
261	600380	健康元	307,500	3,822,225.00	0.17
262	002507	涪陵榨菜	267,314	3,819,917.06	0.17
263	000830	鲁西化工	380,200	3,813,406.00	0.17
264	002372	伟星新材	263,476	3,812,497.72	0.17
265	600282	南钢股份	1,019,900	3,773,630.00	0.17
266	002936	郑州银行	1,870,920	3,760,549.20	0.17
267	002850	科达利	44,500	3,758,470.00	0.17

268	603233	大参林	150,800	3,754,920.00	0.17
269	600038	中直股份	97,400	3,752,822.00	0.17
270	688234	天岳先进	56,800	3,752,776.00	0.17
271	002281	光迅科技	131,500	3,747,750.00	0.17
272	000060	中金岭南	864,500	3,734,640.00	0.17
273	002192	融捷股份	68,800	3,729,648.00	0.17
274	688032	禾迈股份	13,800	3,726,000.00	0.17
275	688063	派能科技	34,800	3,688,800.00	0.17
276	601636	旗滨集团	533,000	3,645,720.00	0.17
277	002056	横店东磁	269,200	3,644,968.00	0.17
278	688331	荣昌生物	58,600	3,636,716.00	0.16
279	601880	辽港股份	2,489,600	3,609,920.00	0.16
280	002019	亿帆医药	243,400	3,597,452.00	0.16
281	603225	新凤鸣	253,100	3,594,020.00	0.16
282	300070	碧水源	719,600	3,590,804.00	0.16
283	002670	国盛金控	383,900	3,577,948.00	0.16
284	002120	韵达股份	479,200	3,574,832.00	0.16
285	300529	健帆生物	160,300	3,563,469.00	0.16
286	603156	养元饮品	167,500	3,561,050.00	0.16
287	600580	卧龙电驱	303,100	3,555,363.00	0.16
288	300682	朗新科技	216,900	3,554,991.00	0.16
289	600511	国药股份	124,100	3,551,742.00	0.16
290	300677	英科医疗	152,000	3,550,720.00	0.16
291	000547	航天发展	421,900	3,531,303.00	0.16
292	002080	中材科技	221,300	3,523,096.00	0.16
293	603927	中科软	117,240	3,514,855.20	0.16
294	603885	吉祥航空	292,600	3,511,200.00	0.16
295	603893	瑞芯微	55,300	3,506,020.00	0.16
296	603444	吉比特	14,300	3,505,216.00	0.16
297	002557	洽洽食品	100,440	3,497,320.80	0.16
298	600390	五矿资本	744,100	3,482,388.00	0.16

299	002865	钧达股份	44,900	3,478,852.00	0.16
300	600258	首旅酒店	220,800	3,448,896.00	0.16
301	002531	天顺风能	296,700	3,441,720.00	0.16
302	601000	唐山港	978,700	3,425,450.00	0.16
303	002508	老板电器	157,000	3,419,460.00	0.16
304	688385	复旦微电	88,200	3,407,166.00	0.15
305	601933	永辉超市	1,200,700	3,385,974.00	0.15
306	688516	奥特维	37,297	3,375,378.50	0.15
307	002958	青农商行	1,286,400	3,370,368.00	0.15
308	002487	大金重工	126,600	3,370,092.00	0.15
309	002831	裕同科技	122,500	3,369,975.00	0.15
310	603517	绝味食品	125,410	3,368,512.60	0.15
311	000598	兴蓉环境	591,900	3,367,911.00	0.15
312	300026	红日药业	794,000	3,366,560.00	0.15
313	002572	索菲亚	210,700	3,360,665.00	0.15
314	601179	中国西电	677,600	3,340,568.00	0.15
315	688538	和辉光电	1,373,400	3,337,362.00	0.15
316	603737	三棵树	69,740	3,320,321.40	0.15
317	000970	中科三环	320,707	3,319,317.45	0.15
318	601778	晶科科技	944,500	3,305,750.00	0.15
319	688200	华峰测控	26,903	3,303,688.40	0.15
320	601231	环旭电子	218,500	3,301,535.00	0.15
321	300438	鹏辉能源	116,000	3,281,640.00	0.15
322	600970	中材国际	349,700	3,266,198.00	0.15
323	000155	川能动力	244,200	3,245,418.00	0.15
324	000887	中鼎股份	261,400	3,233,518.00	0.15
325	600906	财达证券	429,500	3,221,250.00	0.15
326	600707	彩虹股份	474,500	3,202,875.00	0.15
327	603185	弘元绿能	95,500	3,178,240.00	0.14
328	600848	上海临港	315,900	3,174,795.00	0.14
329	600329	达仁堂	94,300	3,173,195.00	0.14

330	600481	双良节能	371,200	3,140,352.00	0.14
331	002030	达安基因	323,820	3,134,577.60	0.14
332	600995	南网储能	316,300	3,118,718.00	0.14
333	603858	步长制药	183,000	3,112,830.00	0.14
334	600959	江苏有线	991,300	3,112,682.00	0.14
335	002155	湖南黄金	278,300	3,100,262.00	0.14
336	000563	陕国投 A	1,014,800	3,084,992.00	0.14
337	601866	中远海发	1,309,900	3,065,166.00	0.14
338	600208	新潮中宝	1,407,200	3,053,624.00	0.14
339	600755	厦门国贸	437,800	3,051,466.00	0.14
340	000027	深圳能源	472,000	3,044,400.00	0.14
341	600977	中国电影	247,200	3,025,728.00	0.14
342	000778	新兴铸管	790,600	3,020,092.00	0.14
343	601958	金钼股份	319,300	3,017,385.00	0.14
344	600316	洪都航空	142,400	3,014,608.00	0.14
345	600131	国网信通	198,600	3,008,790.00	0.14
346	688029	南微医学	31,065	3,007,092.00	0.14
347	688082	盛美上海	28,800	3,007,008.00	0.14
348	300357	我武生物	103,600	3,004,400.00	0.14
349	000739	普洛药业	194,700	2,996,433.00	0.14
350	000987	越秀资本	497,230	2,993,324.60	0.14
351	002244	滨江集团	410,700	2,985,789.00	0.14
352	002683	广东宏大	148,600	2,983,888.00	0.14
353	600582	天地科技	547,700	2,979,488.00	0.14
354	601991	大唐发电	1,229,300	2,974,906.00	0.13
355	601665	齐鲁银行	757,200	2,960,652.00	0.13
356	603127	昭衍新药	124,516	2,952,274.36	0.13
357	002266	浙富控股	866,600	2,946,440.00	0.13
358	600373	中文传媒	223,300	2,943,094.00	0.13
359	300888	稳健医疗	78,660	2,930,085.00	0.13
360	600737	中粮糖业	353,900	2,916,136.00	0.13

361	000709	河钢股份	1,366,000	2,909,580.00	0.13
362	603883	老百姓	96,674	2,889,585.86	0.13
363	002032	苏泊尔	53,400	2,830,734.00	0.13
364	000825	太钢不锈	756,300	2,820,999.00	0.13
365	002326	永太科技	242,000	2,812,040.00	0.13
366	600598	北大荒	234,100	2,802,177.00	0.13
367	600056	中国医药	247,541	2,765,032.97	0.13
368	601611	中国核建	398,900	2,764,377.00	0.13
369	600378	昊华科技	90,500	2,758,440.00	0.13
370	600801	华新水泥	221,600	2,754,488.00	0.12
371	603379	三美股份	80,840	2,748,560.00	0.12
372	000785	居然之家	832,000	2,745,600.00	0.12
373	603826	坤彩科技	46,500	2,744,895.00	0.12
374	000883	湖北能源	647,000	2,736,810.00	0.12
375	600528	中铁工业	367,600	2,734,944.00	0.12
376	601598	中国外运	520,500	2,727,420.00	0.12
377	300776	帝尔激光	45,180	2,722,546.80	0.12
378	300363	博腾股份	108,100	2,718,715.00	0.12
379	600901	江苏金租	561,700	2,718,628.00	0.12
380	603568	伟明环保	169,290	2,708,640.00	0.12
381	600517	国网英大	567,300	2,706,021.00	0.12
382	603267	鸿远电子	53,800	2,700,760.00	0.12
383	002511	中顺洁柔	264,900	2,649,000.00	0.12
384	603650	彤程新材	79,400	2,644,020.00	0.12
385	002153	石基信息	270,972	2,639,267.28	0.12
386	601992	金隅集团	1,379,200	2,634,272.00	0.12
387	003035	南网能源	500,300	2,631,578.00	0.12
388	600500	中化国际	592,800	2,620,176.00	0.12
389	601106	中国一重	907,500	2,613,600.00	0.12
390	002653	海思科	110,206	2,551,268.90	0.12
391	600062	华润双鹤	136,600	2,540,760.00	0.12

392	600827	百联股份	265,600	2,520,544.00	0.11
393	000937	冀中能源	350,900	2,505,426.00	0.11
394	603228	景旺电子	110,900	2,501,904.00	0.11
395	000581	威孚高科	164,900	2,485,043.00	0.11
396	002408	齐翔腾达	469,980	2,481,494.40	0.11
397	603026	胜华新材	53,700	2,462,682.00	0.11
398	600871	石化油服	1,345,500	2,462,265.00	0.11
399	001227	兰州银行	941,600	2,448,160.00	0.11
400	600022	山东钢铁	1,769,100	2,423,667.00	0.11
401	603305	旭升集团	122,800	2,422,844.00	0.11
402	601098	中南传媒	237,700	2,417,409.00	0.11
403	003022	联泓新科	131,600	2,409,596.00	0.11
404	603707	健友股份	160,491	2,407,365.00	0.11
405	601118	海南橡胶	566,000	2,399,840.00	0.11
406	600126	杭钢股份	447,000	2,382,510.00	0.11
407	688520	神州细胞	44,138	2,377,714.06	0.11
408	600315	上海家化	111,400	2,359,452.00	0.11
409	600764	中国海防	94,000	2,345,300.00	0.11
410	601156	东航物流	157,700	2,330,806.00	0.11
411	600967	内蒙一机	281,600	2,326,016.00	0.11
412	688779	长远锂科	318,200	2,322,860.00	0.11
413	688349	三一重能	79,818	2,284,391.16	0.10
414	002690	美亚光电	116,290	2,283,935.60	0.10
415	000559	万向钱潮	437,460	2,270,417.40	0.10
416	000156	华数传媒	305,900	2,254,483.00	0.10
417	688276	百克生物	41,064	2,250,717.84	0.10
418	000401	冀东水泥	351,800	2,248,002.00	0.10
419	601928	凤凰传媒	252,600	2,225,406.00	0.10
420	601187	厦门银行	436,900	2,215,083.00	0.10
421	601608	中信重工	573,600	2,214,096.00	0.10
422	688778	厦钨新能	55,800	2,211,912.00	0.10

423	002867	周大生	145,150	2,203,377.00	0.10
424	000089	深圳机场	339,200	2,181,056.00	0.10
425	600808	马钢股份	794,400	2,160,768.00	0.10
426	600663	陆家嘴	245,600	2,149,000.00	0.10
427	002518	科士达	77,700	2,144,520.00	0.10
428	603529	爱玛科技	85,500	2,140,920.00	0.10
429	688208	道通科技	89,692	2,130,185.00	0.10
430	600095	湘财股份	283,600	2,129,836.00	0.10
431	002010	传化智联	461,000	2,129,820.00	0.10
432	001286	陕西能源	248,200	2,122,110.00	0.10
433	300861	美畅股份	63,600	2,117,244.00	0.10
434	603218	日月股份	170,500	2,109,085.00	0.10
435	000958	电投产融	534,300	2,105,142.00	0.10
436	688425	铁建重工	529,800	2,103,306.00	0.10
437	300257	开山股份	130,700	2,059,832.00	0.09
438	000930	中粮科技	307,800	2,043,792.00	0.09
439	002423	中粮资本	304,200	2,032,056.00	0.09
440	603866	桃李面包	264,827	2,028,574.82	0.09
441	002505	鹏都农牧	1,263,600	2,021,760.00	0.09
442	002925	盈趣科技	102,990	2,005,215.30	0.09
443	000967	盈峰环境	419,800	1,994,050.00	0.09
444	600597	光明乳业	227,000	1,981,710.00	0.09
445	002468	申通快递	253,400	1,973,986.00	0.09
446	000898	鞍钢股份	791,800	1,971,582.00	0.09
447	688107	安路科技	53,000	1,949,340.00	0.09
448	600968	海油发展	671,900	1,914,915.00	0.09
449	603786	科博达	26,700	1,905,312.00	0.09
450	300850	新强联	59,400	1,890,702.00	0.09
451	688006	杭可科技	80,101	1,880,771.48	0.09
452	003031	中瓷电子	21,300	1,879,299.00	0.09
453	688281	华秦科技	13,800	1,872,108.00	0.08

454	601568	北元集团	393,550	1,865,427.00	0.08
455	002761	浙江建投	178,900	1,835,514.00	0.08
456	688690	纳微科技	66,800	1,831,656.00	0.08
457	688348	昱能科技	14,800	1,811,224.00	0.08
458	000959	首钢股份	514,500	1,780,170.00	0.08
459	000537	中绿电	184,800	1,779,624.00	0.08
460	002791	坚朗五金	42,600	1,724,874.00	0.08
461	600167	联美控股	302,300	1,714,041.00	0.08
462	688297	中无人机	44,600	1,709,518.00	0.08
463	600377	宁沪高速	164,200	1,683,050.00	0.08
464	600339	中油工程	554,300	1,679,529.00	0.08
465	001914	招商积余	139,300	1,666,028.00	0.08
466	002608	江苏国信	250,000	1,642,500.00	0.07
467	688387	信科移动	225,400	1,625,134.00	0.07
468	601228	广州港	498,000	1,558,740.00	0.07
469	600350	山东高速	223,200	1,549,008.00	0.07
470	002563	森马服饰	267,400	1,542,898.00	0.07
471	001203	大中矿业	149,700	1,522,449.00	0.07
472	600927	永安期货	96,200	1,511,302.00	0.07
473	301029	怡合达	57,400	1,479,772.00	0.07
474	603056	德邦股份	101,700	1,471,599.00	0.07
475	600928	西安银行	441,100	1,468,863.00	0.07
476	002399	海普瑞	123,100	1,443,963.00	0.07
477	000539	粤电力A	294,100	1,438,149.00	0.07
478	000402	金融街	394,978	1,433,770.14	0.07
479	601298	青岛港	230,900	1,426,962.00	0.06
480	603317	天味食品	105,468	1,401,669.72	0.06
481	601828	美凯龙	358,500	1,387,395.00	0.06
482	600925	苏能股份	250,700	1,381,357.00	0.06
483	688153	唯捷创芯	20,800	1,362,400.00	0.06
484	002945	华林证券	89,300	1,348,430.00	0.06

485	601139	深圳燃气	190,200	1,310,478.00	0.06
486	688105	诺唯赞	39,800	1,274,396.00	0.06
487	688295	中复神鹰	41,800	1,266,958.00	0.06
488	000031	大悦城	424,000	1,259,280.00	0.06
489	688819	天能股份	45,000	1,256,400.00	0.06
490	601061	中信金属	162,100	1,249,791.00	0.06
491	001872	招商港口	76,700	1,224,132.00	0.06
492	601158	重庆水务	190,400	1,079,568.00	0.05
493	600299	安迪苏	132,100	1,056,800.00	0.05
494	000553	安道麦A	144,000	999,360.00	0.05
495	688375	国博电子	12,000	954,360.00	0.04
496	600956	新天绿能	115,900	942,267.00	0.04
497	603355	莱克电气	37,120	827,776.00	0.04
498	603868	飞科电器	15,500	782,750.00	0.04
499	688248	南网科技	27,400	684,178.00	0.03
500	600032	浙江新能	71,700	577,902.00	0.03

8.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	688563	航材股份	1,501	90,795.49	0.00
2	688548	广钢气体	4,048	51,612.00	0.00
3	603296	华勤技术	593	46,105.75	0.00
4	301526	C国际复	9,723	43,267.35	0.00
5	301487	盟固利	867	35,512.32	0.00
6	688549	中巨芯	4,294	34,738.46	0.00
7	301348	蓝箭电子	613	27,321.41	0.00
8	688702	盛科通信	549	26,450.82	0.00
9	688582	芯动联科	648	25,058.16	0.00

10	301559	中集环科	1,315	23,985.60	0.00
11	301486	致尚科技	482	22,774.50	0.00
12	688652	京仪装备	416	21,736.00	0.00
13	301525	儒竞科技	266	21,668.36	0.00
14	301498	乖宝宠物	554	21,500.74	0.00
15	301371	敷尔佳	564	21,195.12	0.00
16	301370	国科恒泰	1,240	19,852.40	0.00
17	301421	波长光电	332	19,710.84	0.00
18	301558	三态股份	1,458	19,537.20	0.00
19	688627	精智达	222	19,473.84	0.00
20	688591	泰凌微	681	19,081.62	0.00
21	300904	威力传动	304	18,705.12	0.00
22	301488	豪恩汽电	262	18,101.58	0.00
23	301381	赛维时代	571	16,952.99	0.00
24	301172	君逸数码	438	16,714.08	0.00
25	301509	金凯生科	266	16,553.18	0.00
26	688612	威迈斯	422	16,023.34	0.00
27	601096	宏盛华源	3,918	15,907.08	0.00
28	301393	昊帆生物	260	15,436.20	0.00
29	601083	锦江航运	1,263	13,981.41	0.00
30	301510	固高科技	396	13,863.96	0.00
31	301507	民生健康	851	13,488.35	0.00
32	301210	金杨股份	281	12,779.88	0.00
33	301566	N达利	576	12,752.64	0.00
34	301456	盘古智能	407	12,368.73	0.00
35	688602	康鹏科技	1,066	11,789.96	0.00
36	688719	爱科赛博	194	11,659.40	0.00
37	301550	斯菱股份	260	11,328.20	0.00
38	301292	海科新源	583	11,281.05	0.00
39	301508	中机认检	419	11,178.92	0.00
40	301251	威尔高	321	11,103.39	0.00

41	688592	司南导航	216	10,914.48	0.00
42	301499	维科精密	371	10,733.03	0.00
43	688603	天承科技	140	10,379.60	0.00
44	688653	康希通信	648	10,361.52	0.00
45	301528	多浦乐	148	10,198.68	0.00
46	301329	信音电子	458	10,181.34	0.00
47	301261	恒工精密	198	10,068.30	0.00
48	301202	朗威股份	306	9,730.80	0.00
49	301395	仁信新材	520	9,718.80	0.00
50	688716	中研股份	267	9,716.13	0.00
51	301413	安培龙	164	9,543.16	0.00
52	301500	飞南资源	455	9,504.95	0.00
53	301418	协昌科技	189	9,487.80	0.00
54	301516	中远通	604	9,368.04	0.00
55	301272	英华特	173	9,234.74	0.00
56	301469	恒达新材	275	9,099.75	0.00
57	301519	舜禹股份	442	8,932.82	0.00
58	301518	长华化学	385	8,858.85	0.00
59	301568	思泰克	246	8,752.68	0.00
60	301520	万邦医药	160	8,438.40	0.00
61	301459	丰茂股份	208	8,286.72	0.00
62	688720	艾森股份	165	8,223.60	0.00
63	688573	信宇人	285	8,208.00	0.00
64	301489	思泉新材	128	8,206.08	0.00
65	688651	盛邦安全	178	8,196.90	0.00
66	301517	陕西华达	185	8,082.65	0.00
67	301578	C辰奕	118	8,061.76	0.00
68	301548	崇德科技	136	8,022.64	0.00
69	688657	浩辰软件	101	7,901.23	0.00
70	688646	逸飞激光	219	7,899.33	0.00
71	688671	碧兴物联	226	7,751.80	0.00

72	688693	锆威特	178	7,726.98	0.00
73	603275	众辰科技	193	7,662.10	0.00
74	301533	威马农机	225	7,461.00	0.00
75	603062	麦加芯彩	126	7,284.06	0.00
76	301555	惠柏新材	224	7,266.56	0.00
77	301505	苏州规划	194	6,947.14	0.00
78	301529	福赛科技	182	6,894.16	0.00
79	301515	港通医疗	230	6,502.10	0.00
80	688648	中邮科技	303	6,493.29	0.00
81	688450	光格科技	167	6,082.14	0.00
82	603004	C鼎龙	195	6,082.05	0.00
83	603270	金帝股份	195	5,768.10	0.00
84	603119	浙江荣泰	226	5,394.62	0.00
85	603107	上海汽配	292	5,311.48	0.00
86	603193	润本股份	303	5,047.98	0.00
87	001306	夏厦精密	64	4,823.04	0.00
88	001326	联域股份	99	4,815.36	0.00
89	603075	热威股份	182	4,242.42	0.00
90	001358	兴欣新材	87	3,841.92	0.00
91	001239	永达股份	189	3,764.88	0.00
92	603231	索宝蛋白	161	3,466.33	0.00
93	603273	天元智能	178	3,376.66	0.00
94	603276	恒兴新材	134	3,333.92	0.00
95	603373	安邦护卫	88	3,058.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
----	------	------	----------	----------------

1	300502	新易盛	12,318,587.17	0.53
2	688122	西部超导	8,878,001.85	0.38
3	000066	中国长城	8,793,005.00	0.38
4	002463	沪电股份	8,775,714.63	0.38
5	600372	中航机载	8,739,235.03	0.37
6	002517	恺英网络	8,494,264.00	0.36
7	688072	拓荆科技	8,484,499.85	0.36
8	300394	天孚通信	7,866,100.00	0.34
9	000423	东阿阿胶	7,661,654.00	0.33
10	301236	软通动力	7,349,835.00	0.31
11	300395	菲利华	7,313,174.16	0.31
12	603882	金域医学	7,213,611.00	0.31
13	000933	神火股份	7,181,754.00	0.31
14	300207	欣旺达	7,179,929.00	0.31
15	002240	盛新锂能	7,121,024.00	0.31
16	300601	康泰生物	7,035,497.00	0.30
17	000723	美锦能源	7,021,317.32	0.30
18	688120	华海清科	6,878,665.67	0.29
19	688114	华大智造	6,844,744.59	0.29
20	688180	君实生物	6,776,757.87	0.29

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	300308	中际旭创	24,322,768.88	1.04
2	688256	寒武纪	12,423,886.21	0.53
3	600489	中金黄金	12,289,719.00	0.53

4	600372	中航机载	11,164,462.78	0.48
5	603345	安井食品	10,363,853.96	0.44
6	688122	西部超导	10,146,012.46	0.43
7	688777	中控技术	9,850,688.67	0.42
8	600487	亨通光电	9,770,924.00	0.42
9	601607	上海医药	9,240,196.00	0.40
10	603605	珀莱雅	9,039,039.20	0.39
11	000807	云铝股份	8,891,715.00	0.38
12	000999	华润三九	8,558,571.00	0.37
13	300832	新产业	8,053,533.89	0.35
14	002603	以岭药业	7,719,042.80	0.33
15	603606	东方电缆	7,608,643.90	0.33
16	601699	潞安环能	7,563,676.00	0.32
17	603613	国联股份	7,228,076.71	0.31
18	600705	中航产融	7,198,092.00	0.31
19	601872	招商轮船	7,190,825.00	0.31
20	600027	华电国际	6,944,784.00	0.30

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	794,854,292.21
卖出股票收入（成交）总额	768,550,519.89

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	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)	163,905.03	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	163,905.03	0.01

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	127102	浙建转债	1,639	163,905.03	0.01

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

在实际进行投资运作时，由于ETF基金一般需要满仓操作，同时基金需要备出一定的现金头存应对申赎及费用等支付，因此仓位无法达到100%，这时基金仓位就存在裸露风险，通过套期保值方式买入期货合约，可以使基金仓位达到100%，避免仓位暴露的风险。股指期货在买入时总持仓量采用双限制策略，一是限制基金组合中总的股指期货持仓量不能超过向中金所申请并获批的套保总量；二是限制基金组合持有的股指期货合约价值加上基金组合中其他有价证券市值占基金净资产的比例不能超过法规规定的上限，并在股指期货的交易过程中严格遵守基金合同的约束和中金所的规定。根据本基金的基金合同、投资范围、投资目标、投资策略以及对市场走势研判的基础上，结合基金日常

的申购赎回情况，制定套期保值交易的合理期限。套期保值的期限一般不超过股指期货当前的最远到期日合约，即次季合约。按照交易月份相近的原则，综合考虑并动态跟踪不同到期日的期货合约的流动性、价差状况和展期风险等因素，选择合适月份的期货合约进行开仓和展期交易来实现远期套保的目的。另外对于交割月的股指期货，通常情况下，最晚在合约交割日进行平仓，尽量避免进行交割。在未来的股指期货交易过程中，本基金将严格遵守《证券投资基金参与股指期货交易指引》，以及中国金融期货交易所颁布的《中国金融期货交易所交易规则》、《中国金融期货交易所套期保值与套利交易管理办法》等相关规定，以套期保值为主要目的参与股指期货，严格控制交易中的各种风险。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本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	10,640,785.13
2	应收清算款	9,105,378.05
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	132,673.59
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	19,878,836.77

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**

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	002422	科伦药业	2,521,540.00	0.11	转融通证券出借
2	300418	昆仑万维	2,303,840.00	0.10	转融通证券出借
3	300502	新易盛	2,268,720.00	0.10	转融通证券出借
4	002028	思源电气	2,258,536.00	0.10	转融通证券出借
5	000988	华工科技	2,202,240.00	0.10	转融通证券出借
6	000975	银泰黄金	2,185,500.00	0.10	转融通证券出借
7	601058	赛轮轮胎	2,166,700.00	0.10	转融通证券出借
8	600157	永泰能源	2,001,022.00	0.09	转融通证券出借
9	002463	沪电股份	1,995,224.00	0.09	转融通证券出借
10	601555	东吴证券	1,917,413.00	0.09	转融通证券出借

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	688563	航材股份	90,795.49	0.00	科创板打新限售
2	688548	广钢气体	51,612.00	0.00	科创板打新限售
3	603296	华勤技术	46,105.75	0.00	新股锁定
4	301526	C国际复	43,267.35	0.00	创业板打新限售
5	301487	盟固利	35,512.32	0.00	创业板打新限售

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息**9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

持有人户数(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		联接基金	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
4,961	500,183.12	24,922,065.00	1.00%	94,880,336.00	3.82%	2,361,606,069.00	95.17%

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	中国国际金融股份有限公司	15,531,358.00	0.63%
2	赵梦野	3,700,000.00	0.15%
3	广发证券股份有限公司	2,739,638.00	0.11%
4	中信建投证券股份有限公司	2,602,466.00	0.10%
5	方正证券股份有限公司	2,117,603.00	0.09%
6	张如依	2,045,100.00	0.08%
7	刘国胜	1,981,700.00	0.08%
8	赵中相	1,500,000.00	0.06%
9	张殿勋	1,476,800.00	0.06%
10	李艳东	1,400,000.00	0.06%

		0	
-	国泰君安证券股份有限公司-天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金	2,361,606,069.00	95.17%

注：持有人为场内持有人。前十名持有人为除天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金之外的前十名持有人。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	2,000.00	0.00%

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2020年08月07日)基金份额总额	333,908,470.00
本报告期期初基金份额总额	2,476,408,470.00
本报告期基金总申购份额	242,500,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	237,500,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,481,408,470.00

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，童建林先生任职公司风控负责人，刘荣逵先生任职公司首席信息官，马文辉先生任职公司财务负责人，朱海扬先生不再担任公司副总经理，具体信息请参见基金管理人在规定媒介披露的《天弘基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。

本报告期内，韩歆毅先生代任公司总经理，郭树强先生不再担任公司总经理，具体信息请参见基金管理人在规定媒介披露的《天弘基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。

本报告期内，高阳先生担任公司总经理，韩歆毅先生不再代任公司总经理，具体信息请参见基金管理人在规定媒介披露的《天弘基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。

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

本报告期内本基金应向普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）支付服务费80,000.00元。截至本报告期末，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）已为本基金提供审计服务3年5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，本基金托管人及其高级管理人员未发生受稽查或处罚的情况。

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	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	

	量					
东方财富证券	2	512,926,044.97	33.40%	221,231.90	35.31%	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	5	295,152,808.19	19.22%	128,519.12	20.51%	-
光大证券	2	186,430,552.82	12.14%	83,120.12	13.27%	-
广发证券	3	6,649,240.75	0.43%	2,965.17	0.47%	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国泰君安证券	8	226,090,567.96	14.72%	55,396.37	8.84%	-
国投证券	3	6,953,453.58	0.45%	3,101.32	0.49%	-
海通证券	3	-	-	-	-	-
恒泰证券	2	56,488,572.84	3.68%	24,368.64	3.89%	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	1	65,252,557.98	4.25%	29,097.23	4.64%	-
首创证券	2	8,494,387.13	0.55%	3,663.73	0.58%	-
西部证券	1	6,889,586.03	0.45%	2,971.50	0.47%	-

信达证券	1	123,873,748.90	8.07%	54,624.41	8.72%	-
银河证券	2	4,984,589.99	0.32%	2,149.85	0.34%	-
中金财富	1	-	-	-	-	-
中泰证券	2	34,499,190.50	2.25%	14,883.67	2.38%	-
中信建投证券	2	1,133,188.00	0.07%	488.93	0.08%	-

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

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

3、本基金报告期内新租用交易单元：东方证券上海交易单元、广发证券上海交易单元、国盛证券北交所交易单元、中泰证券上海交易单元。

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

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
东方财富证券	197,209.51	4.69%	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-

广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安证 券	1,373,924.3 8	32.64%	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	1,267,816.3 7	30.12%	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	784,048.85	18.63%	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	586,000.00	13.92%	-	-	-	-	-	-
中信建投证 券	-	-	-	-	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金新增申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会规定媒介	2023-01-11
2	天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金2022年第四季度报告	中国证监会规定媒介	2023-01-28
3	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会规定媒介	2023-02-04
4	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会规定媒介	2023-02-18
5	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金新增申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会规定媒介	2023-03-15
6	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会规定媒介	2023-03-16
7	天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金招募说明	中国证监会规定媒介	2023-03-18

	书（更新）		
8	天弘基金管理有限公司关于防范不法分子冒用公司名义进行诈骗活动的风险提示	中国证监会规定媒介	2023-03-24
9	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金新增申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会规定媒介	2023-03-29
10	天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金2022年年度报告	中国证监会规定媒介	2023-03-31
11	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会规定媒介	2023-03-31
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	2023-04-01
13	天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金2023年第1季度报告	中国证监会规定媒介	2023-04-22
14	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会规定媒介	2023-05-06
15	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会规定媒介	2023-05-15
16	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会规定媒介	2023-06-16
17	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金新增申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会规定媒介	2023-07-03
18	天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要（更新）	中国证监会规定媒介	2023-07-05
19	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会规定媒介	2023-07-15
20	天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金2023年第2季度报告	中国证监会规定媒介	2023-07-21
21	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会规定媒介	2023-07-21
22	天弘基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定媒介	2023-07-24

23	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会规定媒介	2023-08-04
24	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金新增申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会规定媒介	2023-08-11
25	天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金2023年中期报告	中国证监会规定媒介	2023-08-31
26	天弘基金管理有限公司关于终止凤凰金信（海口）基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会规定媒介	2023-09-01
27	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金新增申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会规定媒介	2023-09-04
28	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金新增申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会规定媒介	2023-09-06
29	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会规定媒介	2023-09-15
30	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会规定媒介	2023-09-20
31	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会规定媒介	2023-10-18
32	天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金2023年第3季度报告	中国证监会规定媒介	2023-10-25
33	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金新增申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会规定媒介	2023-10-26
34	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金新增申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会规定媒介	2023-11-20
35	天弘基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告	中国证监会规定媒介	2023-11-24
36	天弘基金管理有限公司关于	中国证监会规定媒介	2023-11-30

	旗下基金关联交易事项的公告		
37	天弘基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告	中国证监会规定媒介	2023-12-06
38	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金新增申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会规定媒介	2023-12-06
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	2023-12-30

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
联接基金	1	20230101-20231231	2,375,424,569.00	2,473,317,669.00	2,487,136,169.00	2,361,606,069.00	95.17%
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>							

(3) 持有基金份额占比较高的投资者大额赎回可能引发基金净值大幅波动的风险；

(4) 持有基金份额占比较高的投资者在召开基金份额持有人大会并对重大事项进行投票表决时，可能拥有较大话语权；

(5) 极端情况下，持有基金份额占比较高的投资者大量赎回后，可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平，面临转换基金运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等风险。

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

2、份额占比精度处理方式四舍五入。

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500交易型开放式指数证券投资基金募集的文件
- 2、天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金基金合同
- 3、天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金托管协议
- 4、天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金招募说明书
- 5、报告期内在指定报刊上披露的各项公告
- 6、中国证监会规定的其他文件

13.2 存放地点

天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层

13.3 查阅方式

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

公司网站：www.thfund.com.cn

天弘基金管理有限公司
二〇二四年三月二十九日