天弘沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人:天弘基金管理有限公司

基金托管人:招商证券股份有限公司

送出日期:2026 年 08 月 31 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年08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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2026年01月01日起至2026年06月30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 主要财务指标和基金净值表现 7
3.1 主要会计数据和财务指标 7
3.2 基金净值表现 8
§4 管理人报告 9
4.1 基金管理人及基金经理情况 9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 10
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 11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 12
4.8 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 12
§5 托管人报告 12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 13
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 13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 13
§6 半年度财务会计报告（未经审计） 13
6.1 资产负债表 13
6.2 利润表 15
6.3 净资产变动表 16
6.4 报表附注 18
§7 投资组合报告 45
7.1 期末基金资产组合情况 45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 46
7.3 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 48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 59
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 61
7.6 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 61
7.7 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 61
7.8 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 61
7.9 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 62
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 62
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 62
7.12 投资组合报告附注 62
§8 基金份额持有人信息 63
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 64
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 64

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 64
§9 开放式基金份额变动 64
§10 重大事件揭示 65
10.1 基金份额持有人大会决议 65
10.2 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 65
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 65
10.4 基金投资策略的改变 65
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 65
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 65
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况 66
10.8 其他重大事件 68
§11 影响投资者决策的其他重要信息 69
11.1 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 70
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 70
§12 备查文件目录 71
12.1 备查文件目录 71
12.2 存放地点 71
12.3 查阅方式 71

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	天弘沪深300ETF
场内简称	沪深300ETF天弘
基金主代码	515330
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019年12月05日
基金管理人	天弘基金管理有限公司
基金托管人	招商证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	5,384,709,496.00份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2019年12月26日

2.2 基金产品说明

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

	股相关的衍生工具。 本基金产品投资策略主要包括：债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、融资及转融通投资策略、存托凭证投资策略等。
业绩比较基准	沪深300指数收益率。
风险收益特征	本基金属股票型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		天弘基金管理有限公司	招商证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	童建林	韩鑫普
	联系电话	022-83310208	0755-82943666
	电子邮箱	service@thfund.com.cn	tgb@cmschina.com.cn
客户服务电话		400-986-8888	95565
传真		022-83865564	0755-82960794
注册地址		天津自贸试验区（中心商务区）新华路3678号宝风大厦（新金融大厦）16层02单元3号房间	深圳市福田区福田街道福华一路111号
办公地址		天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层	深圳市福田区福田街道福华一路111号
邮政编码		300203	518000
法定代表人		黄辰立	朱江涛

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.thfund.com.cn

基金中期报告置备地点	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
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 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期（2026年01月01日- 2026年06月30日）
本期已实现收益	567,108,820.28
本期利润	712,490,370.98
加权平均基金份额本期利润	0.1187
本期加权平均净值利润率	8.72%
本期基金份额净值增长率	8.41%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2026年06月30日）
期末可供分配利润	2,151,533,412.73
期末可供分配基金份额利润	0.3996
期末基金资产净值	7,757,390,564.23
期末基金份额净值	1.4406
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2026年06月30日）
基金份额累计净值增长率	44.06%

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	12.69%	1.25%	11.90%	1.26%	0.79%	-0.01%
过去六个月	8.41%	1.13%	7.55%	1.13%	0.86%	0.00%
过去一年	29.16%	1.02%	26.51%	1.02%	2.65%	0.00%
过去三年	38.61%	1.11%	29.59%	1.11%	9.02%	0.00%
过去五年	6.11%	1.12%	-4.68%	1.12%	10.79%	0.00%
自基金合同生效日起至今	44.06%	1.18%	29.34%	1.18%	14.72%	0.00%

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



注：1、本基金合同于2019年12月05日生效。

2、本报告期内，本基金的各项投资比例达到基金合同约定的各项比例要求。

§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2026年06月30日，公司共管理运作267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	指数投资部总经理助理、本基金基金经理	2019年12月13日	-	15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。
尤聪	本基金基金经理助理	2024年08月02日	-	13年	女，计算金融与风险管理专业硕士。历任华盛顿大学资产管理公司量化研究员、北美信托银行信用风险管理顾问、北美信托资产管理公司股票量化投资经理。2021年10月加盟本公司 。

注：1、上述任职日期/离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2、基金经理助理协助基金经理进行投资、研究、头寸管理等日常工作。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金按照国家法律法规有关规定及基金合同相关约定进行操作，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的有关规定以及基金合同的相关约定，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。

4.3.2 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0次，未发生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，力争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权息事件，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2026年06月30日，本基金份额净值为1.4406元，本报告期份额净值增长率8.41%，同期业绩比较基准增长率7.55%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2026 年上半年，国内宏观经济整体温和修复，呈现外需强、内需弱、结构分化显著的格局，股票市场同步走出结构性分化行情。

外需是本轮经济修复的核心支撑，上半年出口增速大幅超预期，高技术产品出口实现显著增长。展望下半年，我国出口韧性有望维持，增长增量仍集中于技术与资本密集型领域，主要不确定性扰动来自欧盟对华贸易政策调整及中东地缘冲突。内需整体偏弱、复苏节奏温和。消费端受高基数拖累，上半年社零增速逐月走弱、整体小幅增长；伴随基数效应逐步消退，下半年社零同比增速有望回暖。当前居民收入增速高于消费支出增

速，叠加居民储蓄意愿偏高，居民部门资产负债表仍处于修复阶段，消费复苏力度相对有限。投资端结构性分化特征明显。上半年房地产投资持续下行，专项债发行节奏偏慢，拖累基建整体增速表现平淡。下半年随着专项债发行提速，叠加超长期特别国债、政策性金融工具落地见效，基建投资将持续发挥托底经济的作用。制造业投资延续分化格局，传统产能持续出清，高技术产业投资保持高增，成为制造业投资的核心支撑，该结构性趋势预计下半年延续。

2026 年上半年，股票市场映射出宏观经济新旧动能转换的结构性特征，资金在弱复苏环境下对高景气度与确定性形成明显的倾向性。行业景气度成为市场核心定价主线，资金高度聚焦科技赛道，成长风格大幅占优，价值、红利及微盘板块表现相对偏弱。展望下半年，市场定价逻辑或将切换，由前期风险偏好驱动的估值扩张，转向以基本面和业绩兑现为核心的定价体系。高景气赛道将全面进入业绩验证估值的阶段，业绩兑现能力将直接决定行情的持续性；若业绩如期落地兑现，前期偏高估值将得到有效消化，长线资金仍将持续沉淀布局。与此同时，下半年市场极致的风格分化格局有望收敛，处于估值底部的传统行业若出现业绩企稳、边际改善的信号，将在市场风格再平衡的趋势下吸引资金回流，迎来估值修复行情与优质配置机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金管理人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，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。

本基金托管人根据法律法规要求履行基金估值及净值计算的复核责任。基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在0.25%以上的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性等咨询会计师事务所的专业意见。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.7 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。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内本基金管理人无应说明预警信息。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，招商证券股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2026年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	65,056,105.51	65,392,207.57
结算备付金		18,095,305.88	41,667,529.80
存出保证金		11,913,493.73	14,866,911.64
交易性金融资产	6.4.7.2	7,674,948,667.62	8,068,416,595.96
其中：股票投资		7,674,948,667.62	8,068,416,595.96
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-

贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		10,361,176.29	2,333,770.29
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	60,492.63	-
资产总计		7,780,435,241.66	8,192,677,015.26
负债和净资产	**附注号**	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		18,733,830.04	7,473,867.65
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		3,164,095.41	3,572,143.67
应付托管费		632,819.10	714,428.74
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	99,038.44
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	513,932.88	519,962.82
负债合计		23,044,677.43	12,379,441.32
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	5,384,709,496.00	6,155,709,496.00
未分配利润	6.4.7.8	2,372,681,068.23	2,024,588,077.94

净资产合计		7,757,390,564.23	8,180,297,573.94
负债和净资产总计		7,780,435,241.66	8,192,677,015.26

注：报告截止日2026年06月30日，基金份额净值1.4406元，基金份额总额5,384,709,496.00份。

6.2 利润表

会计主体：天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日
一、营业总收入		736,974,447.46	133,982,032.88
1.利息收入		508,812.12	550,870.58
其中：存款利息收入	6.4.7.9	508,812.12	550,870.58
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		587,378,522.15	149,425,047.58
其中：股票投资收益	6.4.7.10	503,443,423.20	18,754,321.61
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	-	227,254.05
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	5,092,842.89	-928,392.37
股利收益	6.4.7.15	78,842,256.06	131,371,864.29
其他投资收益		-	-

3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	145,381,550.70	-19,362,799.64
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	3,705,562.49	3,368,914.36
减：二、营业总支出		24,484,076.48	33,075,921.03
1.管理人报酬		20,243,627.61	26,750,277.58
2.托管费		4,048,725.59	5,350,055.45
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	6.4.7.18	-	-
7.税金及附加		23,119.97	0.53
8.其他费用	6.4.7.19	168,603.31	975,587.47
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		712,490,370.98	100,906,111.85
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		712,490,370.98	100,906,111.85
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		712,490,370.98	100,906,111.85

6.3 净资产变动表

会计主体：天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日

	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	6,155,709,496.00	2,024,588,077.94	8,180,297,573.94
二、本期期初净资产	6,155,709,496.00	2,024,588,077.94	8,180,297,573.94
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-771,000,000.00	348,092,990.29	-422,907,009.71
（一）、综合收益总额	-	712,490,370.98	712,490,370.98
（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）	-771,000,000.00	-364,397,380.69	-1,135,397,380.69
其中：1.基金申购款	1,137,000,000.00	360,516,637.22	1,497,516,637.22
2.基金赎回款	-1,908,000,000.00	-724,914,017.91	-2,632,914,017.91
（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	5,384,709,496.00	2,372,681,068.23	7,757,390,564.23
项 目	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	11,069,709,496.00	1,138,648,155.17	12,208,357,651.17
二、本期期初净资产	11,069,709,496.00	1,138,648,155.17	12,208,357,651.17
三、本期增减变动	-2,067,000,000.00	-99,401,525.16	-2,166,401,525.16

额（减少以“-”号填列）			
（一）、综合收益总额	-	100,906,111.85	100,906,111.85
（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）	-2,067,000,000.00	-200,307,637.01	-2,267,307,637.01
其中：1.基金申购款	1,638,000,000.00	146,368,643.67	1,784,368,643.67
2.基金赎回款	-3,705,000,000.00	-346,676,280.68	-4,051,676,280.68
（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	9,002,709,496.00	1,039,246,630.01	10,041,956,126.01

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

高阳	迟哲	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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2019]1044号《关于准予天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》的准许，由基金管理人天弘基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于2019年12月05日生效，首次设立募集规模为236,709,496.00份基金份额。本基金的运作方式为交易型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为天弘基金管理有限公司，基金托管人为招商证券股份有限公司。

本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。此外，为更好地实现基金的投资目标，本基金还可以投资于国内依法发行上市的非成份股（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、货币市场工具、同业存单、债券回购、资产支持证券、银行存款、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金可根据相关法律法规和基金合同的约定，参与融资和转融通证券出借业务。本基金投资于标的指数的成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%，且不低于非现金基金资产的80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2026年度上半年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2026年06月30日的财务状况以及2026年度上半年的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 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。

6.4.6 税项

根据财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税 [2004] 78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税 [2012] 85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税 [2015] 101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税 [2008] 1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税 [2016] 36号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税 [2016] 140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税 [2017] 2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税 [2017] 56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023] 39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部 税务总局公告2024年第8号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2025] 4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

a）本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照3%的规定征收率计算缴纳增值税。

本基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入, 自2026年1月1日至2027年12月31日，免征增值税；对金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。自2025年8月8日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在2025年8月8日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。本基金管理人运营本基金提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

b）对本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。

对投资者从本基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

c）对本基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股

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

对本基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向本基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

d）本基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日
活期存款	65,056,105.51
等于：本金	65,032,251.97
加：应计利息	23,853.54
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	65,056,105.51

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026年06月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		6,254,849,314.73	-	7,674,948,667.62	1,420,099,352.89
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		6,254,849,314.73	-	7,674,948,667.62	1,420,099,352.89

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款估值增值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30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	74,954,400.00	-	-	-
--股指期货	74,954,400.00	-	-	-

其他衍生工具	-	-	-	-
合计	74,954,400.00	-	-	-

6.4.7.3.2 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
IF2609	IF2609	55.00	80,021,700.00	5,067,300.00
合计				5,067,300.00
减：可抵销期货暂收款				5,067,300.00
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。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日
应收利息	-
其他应收款	-
待摊费用	60,492.63
合计	60,492.63

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30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	404,836.94
其中：交易所市场	404,836.94
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	109,095.94
合计	513,932.88

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	6,155,709,496.00	6,155,709,496.00
本期申购	1,137,000,000.00	1,137,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-1,908,000,000.00	-1,908,000,000.00
本期末	5,384,709,496.00	5,384,709,496.00

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,870,497,183.14	154,090,894.80	2,024,588,077.94
本期期初	1,870,497,183.14	154,090,894.80	2,024,588,077.94
本期利润	567,108,820.28	145,381,550.70	712,490,370.98
本期基金份额交易产生的变动数	-286,072,590.69	-78,324,790.00	-364,397,380.69

其中：基金申购款	375,691,136.85	-15,174,499.63	360,516,637.22
基金赎回款	-661,763,727.54	-63,150,290.37	-724,914,017.91
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,151,533,412.73	221,147,655.50	2,372,681,068.23

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
活期存款利息收入	407,680.33
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	98,083.39
其他	3,048.40
合计	508,812.12

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	320,046,383.03
股票投资收益——赎回差价收入	183,397,040.17
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	503,443,423.20

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
卖出股票成交总额	1,723,575,740.52

减：卖出股票成本总额	1,401,841,016.37
减：交易费用	1,688,341.12
买卖股票差价收入	320,046,383.03

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
赎回基金份额对价总额	2,632,914,017.91
减：现金支付赎回款总额	1,118,756,747.91
减：赎回股票成本总额	1,330,760,229.83
减：交易费用	-
赎回差价收入	183,397,040.17

6.4.7.11 债券投资收益

本基金本报告期未取得债券投资收益。

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期未取得资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期未取得贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期未取得买卖权证差价收入。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
期货投资	5,092,842.89

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
股票投资产生的股利收益	78,842,256.06
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	78,842,256.06

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
1.交易性金融资产	143,325,890.70
——股票投资	143,325,890.70
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	2,055,660.00
——权证投资	-
——期货投资	2,055,660.00
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	145,381,550.70

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
基金赎回费收入	-

基金转换费收入	-
ETF基金替代损益	3,705,562.49
合计	3,705,562.49

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内未发生信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
审计费用	39,671.58
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
IOPV计算发布费	9,916.99
ETF登记结算费	59,507.37
合计	168,603.31

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 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。

6.4.9 关联方、关联关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
天弘基金管理有限公司	基金管理人
招商证券股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金	本基金的联接基金
天弘永裕稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）	纳入基金管理人合并财务报表合并范围内的证券投资基金

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日		上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
招商证券股份有限公司	519,435,169.76	17.09%	586,099,686.01	18.81%

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日		上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日	
	成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例	成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例
招商证券	-	-	1,786,429.97	100.00%

股份有限公司				

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
招商证券股份有限公司	107,992.54	17.10%	100,272.14	24.77%
关联方名称	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
招商证券股份有限公司	121,851.93	18.81%	30,110.91	8.83%

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，以未包含印花税、经手费、证管费和过户费等费用的净额列示。

2、根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	20,243,627.61	26,750,277.58
其中：应支付销售机构的客户维护费	220,858.18	301,573.89
应支付基金管理人的净管理费	20,022,769.43	26,448,703.69

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	4,048,725.59	5,350,055.45

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

6.4.10.3 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。

6.4.10.4 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

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 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。

6.4.10.5.2 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 2026年06月30日		上年度末 2025年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金	5,106,379,400.00	94.83%	5,493,379,400.00	89.24%
招商证券股份有限公司	8,156,597.00	0.15%	2,198,897.00	0.04%
天弘永裕稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（F	202,100.00	0.00%	-	-

OF）				

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。

6.4.10.6 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 2026年01月01日至2026年06月30日		上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商证券股份有限公司	65,056,105.51	407,680.33	72,191,892.21	387,926.71

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

6.4.10.7 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 2026年01月01日至2026年06月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张/股）	总金额
招商证券股份有限公司	920186	中科仪	网下申购	2,280	36,958.80
招商证券股份有限公司	001365	天海电子	网下申购	2,394	65,092.86
上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张/股）	总金额

招商证券股份有限公司	001388	信通电子	网下申购	937	15,385.54

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本报告期末，本基金持有招商证券的股票1,005,631股（上年度末：1,183,431股），估值总额为人民币21,218,814.10元（上年度末：19,692,291.84元），占基金净资产的比例为0.27%（上年度末：0.24%）。

6.4.11 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。

6.4.12 期末（2026年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 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
688783	西安奕材	2025-10-20	9个月	新股流通受限	8.62	57.42	44,370	382,469.40	2,547,725.40	-
001248	华润新能源	2026-06-24	6个月	新股流通受限	10.11	10.11	58,873	595,206.03	595,206.03	-
301666	大普微	2026-04-08	6个月	新股流通受限	46.08	463.33	1,220	56,217.60	565,262.60	-
688820	盛合晶微	2026-04-13	6个月	新股流通受限	19.68	141.49	2,391	47,054.88	338,302.59	-
688781	视涯科技	2026-03-18	9个月	新股流通受限	22.68	42.16	6,335	143,677.80	267,083.60	-

688808	联讯仪器	2026-04-16	6个月	新股流通受限	81.88	1,584.33	163	13,346.44	258,245.79	-
001248	华润新能源	2026-06-24	1个月内（含）	新股未上市	10.11	10.11	25,231	255,085.41	255,085.41	-
001399	C惠科	2026-06-16	6个月	新股流通受限	10.12	27.73	6,488	65,658.56	179,912.24	-
688818	电科蓝天	2026-02-03	6个月	新股流通受限	9.47	70.14	1,717	16,259.99	120,430.38	-
301682	宏明电子	2026-03-18	6个月	新股流通受限	69.66	160.06	714	49,737.24	114,282.84	-
688797	C臻宝	2026-06-16	6个月	新股流通受限	44.56	468.67	207	9,223.92	97,014.69	-
688712	北芯生命	2026-01-28	6个月	新股流通受限	17.52	35.92	1,500	26,280.00	53,880.00	-
688785	恒运昌	2026-01-20	6个月	新股流通受限	92.18	463.15	116	10,692.88	53,725.40	-
688813	泰金新能	2026-03-24	6个月	新股流通受限	26.28	172.09	234	6,149.52	40,269.06	-
688635	长进光子	2026-05-20	6个月	新股流通受限	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	-
001257	盛龙股份	2026-03-24	6个月	新股流通受限	7.82	20.74	1,743	13,630.26	36,149.82	-

603459	红板科技	2026-03-31	6个月	新股流通受限	17.70	84.32	330	5,841.00	27,825.60	-
001365	天海电子	2026-05-11	6个月	新股流通受限	27.19	31.31	719	19,549.61	22,511.89	-
688811	有研复材	2026-04-01	6个月	新股流通受限	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-
301696	三瑞智能	2026-03-31	6个月	新股流通受限	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-
001237	惠康科技	2026-05-15	6个月	新股流通受限	53.26	58.74	285	15,179.10	16,740.90	-
301669	高特电子	2026-06-02	6个月	新股流通受限	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-
301687	新广益	2025-12-24	6个月	新股流通受限	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-
001393	维通利	2026-05-08	6个月	新股流通受限	30.38	38.99	387	11,757.06	15,089.13	-
301531	春光集团	2026-04-28	6个月	新股流通受限	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	-
301599	理奇智能	2026-04-22	6个月	新股流通受限	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	-
601112	振石股份	2026-01-21	6个月	新股流通受限	11.18	17.59	775	8,664.50	13,632.25	-

301680	固德电材	2026-02-27	6个月	新股流通受限	58.00	112.16	117	6,786.00	13,122.72	-
301683	慧谷新材	2026-03-24	6个月	新股流通受限	78.38	121.77	96	7,524.48	11,689.92	-
688816	易思维	2026-02-04	6个月	新股流通受限	55.95	57.10	177	9,903.15	10,106.70	-
603407	长裕集团	2026-04-29	6个月	新股流通受限	13.86	73.46	137	1,898.82	10,064.02	-
301513	尚水智能	2026-04-10	6个月	新股流通受限	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-
920136	永励精密	2026-06-25	1个月内（含）	新股未上市	19.28	19.28	300	5,784.00	5,784.00	-
603435	嘉德利	2026-05-15	6个月	新股流通受限	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603352	至信股份	2026-01-08	6个月	新股流通受限	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-
920193	吉和昌	2026-06-18	1个月内（含）	新股未上市	8.52	8.52	300	2,556.00	2,556.00	-
603293	埃泰克	2026-04-09	6个月	新股流通受限	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-
001312	福恩股份	2026-04-14	6个月	新股流通受限	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	-

603284	林平发展	2026-02-03	6个月	新股流通受限	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	-
001220	世盟股份	2026-01-27	6个月	新股流通受限	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026-06-29	重大事项	832.00	2026-07-13	890.99	54,000	35,143,745.42	44,928,000.00	-

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2026年06月30日，本基金未持有银行间市场债券正回购交易中作为质押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2026年06月30日，本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为质押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 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。

本基金管理人按照“全面管理、专业分工、各司其职”的思路，明确风险管理职责并将其融入组织架构、写入制度、嵌入系统，实施多层次、多角度、全方位的风险管理。一是投资决策实施分层授权管理，投资决策委员会、投资总监、投资部门负责人和基金经理对投资行为及相关风险进行管理、监控，根据不同权限实施风险控制；二是按照部门职能执行分工管理，基金经理、中央交易室、研究相关部门、风险管理部、内控合规部、基金运营部等从不同角度、不同环节对投资全过程实行风险监控和管理；三是投资到结算的全流程，已经形成了一套贯穿“事前风险定位、事中风险管理和事后风险评估”的健全风险监控体系。

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。

6.4.13.2 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招商证券股份有限公司开立于具有基金托管资格的银行的托管账户及其他具有基金托管资格的国有银行和大型股份制银行，并实施不同区间的额度管理，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，本基金以非约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司出借证券，本基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管

理并进行动态调整，且借券证券公司最近1年的分类结果为A类，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

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

6.4.13.2.1 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。

6.4.13.2.2 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。

6.4.13.2.3 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。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级的债券。

6.4.13.2.5 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。

6.4.13.2.6 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。

6.4.13.3 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。

本基金于报告期末的卖出回购金融资产款（若有）计息且利息金额不重大；本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（净资产）无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 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6.4.12。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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

2026年06月30日					
资产					
货币资金	65,056,105.51	-	-	-	65,056,105.51
结算备付金	18,095,305.88	-	-	-	18,095,305.88
存出保证金	2,310,889.73	-	-	9,602,604.00	11,913,493.73
交易性金融资产	-	-	-	7,674,948,667.62	7,674,948,667.62
应收清算款	-	-	-	10,361,176.29	10,361,176.29
其他资产	-	-	-	60,492.63	60,492.63
资产总计	85,462,301.12	-	-	7,694,972,940.54	7,780,435,241.66
负债					
应付清算款	-	-	-	18,733,830.04	18,733,830.04
应付管理人报酬	-	-	-	3,164,095.41	3,164,095.41
应付托管费	-	-	-	632,819.10	632,819.10
其他负债	-	-	-	513,932.88	513,932.88
负债总计	-	-	-	23,044,677.43	23,044,677.43
利率敏感度缺口	85,462,301.12	-	-	7,671,928,263.11	7,757,390,564.23
上年度末 2025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	65,392,207.57	-	-	-	65,392,207.57
结算备付金	41,667,529.80	-	-	-	41,667,529.80
存出保证金	1,638,495.64	-	-	13,228,416.00	14,866,911.64
交易性金融资产	-	-	-	8,068,416,595.96	8,068,416,595.96
应收清算款	-	-	-	2,333,770.29	2,333,770.29
资产总计	108,698,233.01	-	-	8,083,978,782.25	8,192,677,015.26
负债					
应付清算款	-	-	-	7,473,867.65	7,473,867.65
应付管理人报酬	-	-	-	3,572,143.67	3,572,143.67
应付托管费	-	-	-	714,428.74	714,428.74
应交税费	-	-	-	99,038.44	99,038.44

其他负债	-	-	-	519,962.82	519,962.82
负债总计	-	-	-	12,379,441.32	12,379,441.32
利率敏感度缺口	108,698,233.01	-	-	8,071,599,340.93	8,180,297,573.94

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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2026年06月30日，本基金未持有交易性债券投资 (2025年12月31日：同)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响(2025年12月31日：同)。

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金原则上采用完全复制法，跟踪沪深300指数，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金投资组合，并根据标的指数组成及其权重的变动而进行相应调整。但因特殊情况（如流动性不足等）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日		上年度末 2025年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)	公允价值	占基金资产净值比例(%)

交易性金融资产－股票投资	7,674,948,667.62	98.94	8,068,416,595.96	98.63
交易性金融资产－基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产－贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产－权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	7,674,948,667.62	98.94	8,068,416,595.96	98.63

注：1、其他包含在期货交易所交易的期货投资(附注6.4.7.3)。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。

2、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。

6.4.13.4.3.2 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 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
	业绩比较基准上升5%	436,327,837.43	443,708,927.19
	业绩比较基准下降5%	-436,327,837.43	-443,708,927.19

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 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 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
第一层次	7,624,188,334.17	8,006,693,393.40
第二层次	45,786,631.44	56,971,737.56
第三层次	4,973,702.01	4,751,465.00
合计	7,674,948,667.62	8,068,416,595.96

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于公开市场交易的证券投资，若出现重大事项停牌、交易不活跃或非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关投资的公允价值列入第一层次，并根据估值调整中采用的对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次，确定相关投资的公允价值应属第二层次或第三层次。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2026年06月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2025年12月31日：同)。

6.4.14.4 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。

6.4.15 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。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)

1	权益投资	7,674,948,667.62	98.64
	其中：股票	7,674,948,667.62	98.64
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	83,151,411.39	1.07
8	其他各项资产	22,335,162.65	0.29
9	合计	7,780,435,241.66	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	43,688,753.33	0.56
B	采矿业	320,915,771.88	4.14
C	制造业	4,915,192,273.43	63.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	190,459,509.95	2.46
E	建筑业	87,442,560.35	1.13
F	批发和零售业	11,341,820.00	0.15
G	交通运输、仓储和邮政业	185,695,957.75	2.39
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	412,662,739.08	5.32
J	金融业	1,343,298,129.94	17.32

K	房地产业	24,996,444.89	0.32
L	租赁和商务服务业	35,059,135.84	0.45
M	科学研究和技术服务业	83,511,222.69	1.08
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	10,438,195.04	0.13
R	文化、体育和娱乐业	4,413,820.00	0.06
S	综合	-	-
	合计	7,669,116,334.17	98.86

7.2.2 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	36,149.82	0.00
C	制造业	4,944,308.73	0.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	850,291.44	0.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,583.46	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管	-	-

	理业		
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	5,832,333.45	0.08

7.3 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

7.3.1 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	300308	中际旭创	302,340	383,971,800.00	4.95
2	300750	宁德时代	717,440	281,961,094.40	3.63
3	300502	新易盛	378,288	229,620,816.00	2.96
4	600519	贵州茅台	169,554	201,004,571.46	2.59
5	603986	兆易创新	181,124	147,616,060.00	1.90
6	601318	中国平安	2,891,686	138,049,089.64	1.78
7	688256	寒武纪	85,434	136,314,218.70	1.76
8	600036	招商银行	3,357,306	119,184,363.00	1.54
9	601899	紫金矿业	4,470,500	112,388,370.00	1.45
10	002371	北方华创	117,210	103,679,277.60	1.34
11	000333	美的集团	1,319,171	99,636,985.63	1.28
12	002475	立讯精密	1,383,284	97,383,193.60	1.26
13	688008	澜起科技	310,812	96,320,638.80	1.24
14	688012	中微公司	202,728	94,978,068.00	1.22
15	688041	海光信息	251,835	93,254,500.50	1.20
16	002384	东山精密	347,800	91,245,330.00	1.18

17	600900	长江电力	3,318,100	87,830,107.00	1.13
18	688981	中芯国际	552,757	87,788,866.74	1.13
19	000725	京东方A	9,859,400	85,579,592.00	1.10
20	603259	药明康德	670,719	83,511,222.69	1.08
21	601138	工业富联	1,076,600	77,676,690.00	1.00
22	600030	中信证券	2,647,388	76,059,457.24	0.98
23	601166	兴业银行	4,592,318	76,048,786.08	0.98
24	300059	东方财富	3,433,561	69,975,973.18	0.90
25	600183	生益科技	395,300	68,545,020.00	0.88
26	600276	恒瑞医药	1,211,039	63,022,469.56	0.81
27	300274	阳光电源	393,620	62,593,452.40	0.81
28	601398	工商银行	8,775,500	62,042,785.00	0.80
29	300408	三环集团	363,900	60,734,910.00	0.78
30	002594	比亚迪	737,000	58,738,900.00	0.76
31	300476	胜宏科技	165,591	57,365,690.13	0.74
32	002463	沪电股份	365,430	55,837,704.00	0.72
33	601211	国泰海通	3,064,879	55,780,797.80	0.72
34	300394	天孚通信	177,424	53,702,696.32	0.69
35	000988	华工科技	272,500	50,306,225.00	0.65
36	301308	江波龙	69,100	48,632,580.00	0.63
37	600176	中国巨石	651,329	47,468,857.52	0.61
38	601288	农业银行	7,793,800	47,308,366.00	0.61
39	601328	交通银行	7,235,900	46,526,837.00	0.60
40	000651	格力电器	1,215,422	45,578,325.00	0.59
41	600522	中天科技	740,700	44,945,676.00	0.58
42	688072	拓荆科技	54,000	44,928,000.00	0.58
43	600919	江苏银行	3,979,510	42,899,117.80	0.55
44	603019	中科曙光	396,874	42,556,799.02	0.55
45	688521	芯原股份	114,600	42,532,644.00	0.55
46	603993	洛阳钼业	2,366,700	41,535,585.00	0.54
47	600150	中国船舶	1,223,757	41,350,749.03	0.53

48	600887	伊利股份	1,715,600	41,105,776.00	0.53
49	600584	长电科技	388,200	40,198,110.00	0.52
50	000338	潍柴动力	1,457,100	39,705,975.00	0.51
51	000858	五 粮 液	526,428	38,955,672.00	0.50
52	601816	京沪高铁	7,956,400	36,042,492.00	0.46
53	600309	万华化学	508,994	34,820,279.54	0.45
54	300124	汇川技术	513,562	34,064,567.46	0.44
55	002415	海康威视	993,200	33,967,440.00	0.44
56	002916	深南电路	73,570	33,687,703.00	0.43
57	600111	北方稀土	685,800	32,952,690.00	0.42
58	000100	TCL科技	5,637,740	32,811,646.80	0.42
59	601688	华泰证券	1,584,500	32,672,390.00	0.42
60	000063	中兴通讯	873,300	31,604,727.00	0.41
61	600000	浦发银行	3,611,495	31,094,971.95	0.40
62	600089	特变电工	1,369,250	30,808,125.00	0.40
63	601857	中国石油	3,510,785	30,473,613.80	0.39
64	002028	思源电气	168,900	29,219,700.00	0.38
65	601088	中国神华	744,700	29,073,088.00	0.37
66	300433	蓝思科技	539,700	28,960,302.00	0.37
67	600031	三一重工	1,608,000	27,786,240.00	0.36
68	300014	亿纬锂能	412,752	26,841,262.56	0.35
69	002050	三花智控	607,500	26,626,725.00	0.34
70	002142	宁波银行	894,932	26,570,531.08	0.34
71	601601	中国太保	927,900	26,463,708.00	0.34
72	000001	平安银行	2,629,940	26,430,897.00	0.34
73	000792	盐湖股份	860,500	25,978,495.00	0.33
74	002714	牧原股份	740,463	25,908,800.37	0.33
75	600549	厦门钨业	300,900	25,636,680.00	0.33
76	002353	杰瑞股份	166,500	25,391,250.00	0.33
77	600406	XD国电南	1,088,672	24,876,155.20	0.32
78	601668	中国建筑	5,598,600	24,297,924.00	0.31

79	000657	中钨高新	247,400	23,681,128.00	0.31
80	601229	上海银行	2,695,900	23,400,412.00	0.30
81	601919	中远海控	1,701,330	22,559,635.80	0.29
82	002602	世纪华通	1,598,200	22,534,620.00	0.29
83	300760	迈瑞医疗	164,200	22,303,286.00	0.29
84	601988	中国银行	3,880,400	22,195,888.00	0.29
85	601939	建设银行	2,296,600	22,116,258.00	0.29
86	600660	福耀玻璃	435,000	21,941,400.00	0.28
87	601728	中国电信	4,207,400	21,836,406.00	0.28
88	603501	豪威集团	229,966	21,812,275.10	0.28
89	600016	民生银行	6,728,200	21,664,804.00	0.28
90	601012	隆基绿能	1,643,157	21,558,219.84	0.28
91	601225	陕西煤业	1,051,000	21,387,850.00	0.28
92	002230	科大讯飞	520,900	21,273,556.00	0.27
93	600999	招商证券	1,005,631	21,218,814.10	0.27
94	600941	中国移动	245,100	21,110,463.00	0.27
95	600690	海尔智家	1,016,400	20,744,724.00	0.27
96	002352	顺丰控股	650,100	20,322,126.00	0.26
97	601985	中国核电	2,229,200	20,129,676.00	0.26
98	002460	赣锋锂业	305,789	19,998,600.60	0.26
99	002709	天赐材料	386,940	19,900,324.20	0.26
100	603799	华友钴业	411,800	19,873,468.00	0.26
101	600926	杭州银行	1,375,060	19,869,617.00	0.26
102	002938	鹏鼎控股	188,500	19,864,130.00	0.26
103	601169	北京银行	4,010,500	19,651,450.00	0.25
104	300033	同花顺	81,335	19,601,735.00	0.25
105	000977	浪潮信息	278,147	19,470,290.00	0.25
106	600160	巨化股份	365,900	19,396,359.00	0.25
107	000776	广发证券	799,800	18,715,320.00	0.24
108	300442	润泽科技	222,800	18,507,996.00	0.24
109	000425	徐工机械	2,221,500	17,971,935.00	0.23

110	000938	紫光股份	620,540	17,908,784.40	0.23
111	002202	金风科技	748,200	17,881,980.00	0.23
112	688126	沪硅产业	447,768	17,861,465.52	0.23
113	300498	温氏股份	1,443,178	17,779,952.96	0.23
114	601600	中国铝业	2,148,200	17,658,204.00	0.23
115	600028	中国石化	3,949,640	17,615,394.40	0.23
116	600938	中国海油	648,000	17,593,200.00	0.23
117	600460	士兰微	315,500	17,245,230.00	0.22
118	002600	领益智造	989,900	17,164,866.00	0.22
119	002466	天齐锂业	279,800	17,157,336.00	0.22
120	601766	中国中车	3,296,500	17,141,800.00	0.22
121	688082	盛美上海	39,368	17,006,976.00	0.22
122	600050	中国联通	4,235,900	16,943,600.00	0.22
123	300661	圣邦股份	117,663	16,882,287.24	0.22
124	601009	南京银行	1,676,300	16,578,607.00	0.21
125	002837	英维克	207,500	16,508,700.00	0.21
126	002049	紫光国微	184,220	16,349,525.00	0.21
127	601628	中国人寿	451,104	15,946,526.40	0.21
128	002179	中航光电	344,396	15,911,095.20	0.21
129	601100	恒立液压	145,262	15,624,380.72	0.20
130	000568	泸州老窖	199,600	15,472,992.00	0.20
131	601872	招商轮船	875,500	15,382,535.00	0.20
132	002241	歌尔股份	673,300	15,169,449.00	0.20
133	603288	海天味业	451,778	14,980,958.48	0.19
134	601006	大秦铁路	3,230,900	14,894,449.00	0.19
135	000408	藏格矿业	212,900	14,758,228.00	0.19
136	601658	邮储银行	2,988,500	14,733,305.00	0.19
137	605117	德业股份	137,779	14,629,374.22	0.19
138	601818	光大银行	5,032,200	14,543,058.00	0.19
139	600809	山西汾酒	132,021	14,439,136.77	0.19
140	600905	三峡能源	3,874,100	14,372,911.00	0.19

141	600489	中金黄金	788,900	14,239,645.00	0.18
142	601888	中国中免	265,104	14,238,735.84	0.18
143	002625	光启技术	466,900	14,156,408.00	0.18
144	688396	华润微	144,602	14,105,925.10	0.18
145	000630	铜陵有色	2,181,000	13,871,160.00	0.18
146	600893	航发动力	361,400	13,856,076.00	0.18
147	600010	包钢股份	6,128,300	13,666,109.00	0.18
148	688271	联影医疗	134,616	13,627,177.68	0.18
149	601127	赛力斯	221,593	13,572,571.25	0.17
150	601336	新华保险	226,416	13,507,978.56	0.17
151	688111	金山办公	62,962	13,414,054.10	0.17
152	600958	东方证券	1,417,440	13,380,633.60	0.17
153	601689	拓普集团	235,955	13,312,581.10	0.17
154	002027	分众传媒	2,741,000	13,266,440.00	0.17
155	600118	中国卫星	160,100	13,136,205.00	0.17
156	600019	宝钢股份	2,361,432	12,822,575.76	0.17
157	600760	中航沈飞	307,036	12,619,179.60	0.16
158	000807	云铝股份	564,100	12,489,174.00	0.16
159	601838	成都银行	689,300	12,200,610.00	0.16
160	600104	上汽集团	1,246,300	12,163,888.00	0.16
161	600362	江西铜业	280,846	12,160,631.80	0.16
162	600989	宝丰能源	596,900	12,134,977.00	0.16
163	300450	先导智能	296,900	12,089,768.00	0.16
164	688183	生益电子	90,600	11,995,440.00	0.15
165	601727	上海电气	1,709,100	11,963,700.00	0.15
166	600875	东方电气	413,900	11,907,903.00	0.15
167	002001	新 和 成	416,888	11,847,956.96	0.15
168	601825	沪农商行	1,568,700	11,749,563.00	0.15
169	002422	科伦药业	301,500	11,613,780.00	0.15
170	601390	中国中铁	2,775,535	11,573,980.95	0.15
171	000538	云南白药	242,199	11,472,966.63	0.15

172	601995	中金公司	316,700	11,448,705.00	0.15
173	603296	华勤技术	153,980	11,436,094.60	0.15
174	601377	兴业证券	1,872,170	11,307,906.80	0.15
175	600547	山东黄金	489,522	11,303,062.98	0.15
176	600795	国电电力	2,417,000	11,287,390.00	0.15
177	600015	华夏银行	1,725,000	11,022,750.00	0.14
178	600585	海螺水泥	650,000	11,017,500.00	0.14
179	601669	中国电建	2,334,100	10,970,270.00	0.14
180	603893	瑞芯微	57,300	10,793,028.00	0.14
181	000166	申万宏源	2,443,600	10,751,840.00	0.14
182	601916	浙商银行	4,087,200	10,749,336.00	0.14
183	300316	晶盛机电	177,495	10,720,698.00	0.14
184	002648	卫星化学	456,000	10,711,440.00	0.14
185	300015	爱尔眼科	1,263,704	10,438,195.04	0.13
186	601698	中国卫通	343,500	10,390,875.00	0.13
187	601066	中信建投	352,133	10,236,506.31	0.13
188	600346	恒力石化	572,700	10,142,517.00	0.13
189	601868	中国能建	3,793,900	10,129,713.00	0.13
190	600482	中国动力	307,200	10,076,160.00	0.13
191	002311	海大集团	223,243	9,958,870.23	0.13
192	601998	中信银行	1,436,400	9,954,252.00	0.13
193	002558	巨人网络	360,600	9,938,136.00	0.13
194	300418	昆仑万维	244,200	9,855,912.00	0.13
195	600066	宇通客车	360,100	9,654,281.00	0.12
196	000625	长安汽车	1,345,202	9,645,098.34	0.12
197	600426	华鲁恒升	401,700	9,608,664.00	0.12
198	002532	天山铝业	878,400	9,425,232.00	0.12
199	600221	海航控股	6,966,000	9,404,100.00	0.12
200	000157	中联重科	1,346,200	9,383,014.00	0.12
201	688036	传音控股	156,702	9,237,582.90	0.12
202	300803	指南针	98,800	9,056,996.00	0.12

203	600011	华能国际	1,192,500	9,051,075.00	0.12
204	600048	XD保利发	1,945,900	9,009,517.00	0.12
205	605499	东鹏饮料	72,985	9,008,538.55	0.12
206	600436	片仔癀	81,274	8,881,622.72	0.11
207	600438	通威股份	732,000	8,864,520.00	0.11
208	600115	中国东航	2,307,250	8,790,622.50	0.11
209	601077	渝农商行	1,438,400	8,788,624.00	0.11
210	002236	大华股份	531,790	8,769,217.10	0.11
211	002493	荣盛石化	811,950	8,728,462.50	0.11
212	600570	恒生电子	411,118	8,711,590.42	0.11
213	600886	国投电力	650,700	8,660,817.00	0.11
214	600188	兖矿能源	484,640	8,612,052.80	0.11
215	688047	龙芯中科	54,563	8,439,259.21	0.11
216	003816	中国广核	2,131,600	8,334,556.00	0.11
217	002736	国信证券	832,400	8,315,676.00	0.11
218	601360	三六零	948,600	8,243,334.00	0.11
219	601058	赛轮轮胎	713,300	8,224,349.00	0.11
220	000301	东方盛虹	716,800	8,207,360.00	0.11
221	600026	中远海能	451,600	8,101,704.00	0.10
222	002074	国轩高科	293,400	8,071,434.00	0.10
223	601901	方正证券	1,115,600	8,032,320.00	0.10
224	600009	上海机场	337,000	7,784,700.00	0.10
225	600196	复星医药	344,300	7,736,421.00	0.10
226	000768	中航西飞	376,800	7,716,864.00	0.10
227	000975	山金国际	450,300	7,655,100.00	0.10
228	601111	中国国航	1,263,700	7,645,385.00	0.10
229	601788	光大证券	529,400	7,639,242.00	0.10
230	600029	南方航空	1,461,800	7,572,124.00	0.10
231	600415	小商品城	743,500	7,553,960.00	0.10
232	601456	国联民生	851,600	7,528,144.00	0.10
233	600674	川投能源	528,600	7,490,262.00	0.10

234	600219	南山铝业	1,866,400	7,446,936.00	0.10
235	601186	中国铁建	1,246,600	7,417,270.00	0.10
236	601881	中国银河	589,200	7,406,244.00	0.10
237	600233	圆通速递	463,513	7,300,329.75	0.09
238	601117	中国化学	993,000	7,298,550.00	0.09
239	601877	正泰电器	290,800	7,290,356.00	0.09
240	301236	软通动力	168,200	7,140,090.00	0.09
241	600372	中航机载	655,300	7,110,005.00	0.09
242	301269	华大九天	59,400	7,093,548.00	0.09
243	601878	浙商证券	743,718	7,065,321.00	0.09
244	000963	华东医药	238,000	6,692,560.00	0.09
245	600741	华域汽车	427,616	6,636,600.32	0.09
246	688506	百利天恒	22,400	6,586,272.00	0.08
247	002920	德赛西威	80,400	6,552,600.00	0.08
248	000895	双汇发展	281,400	6,303,360.00	0.08
249	001979	招商蛇口	977,511	6,285,395.73	0.08
250	002304	洋河股份	163,145	6,223,981.75	0.08
251	300866	安克创新	58,400	6,102,800.00	0.08
252	601898	中煤能源	495,800	6,038,844.00	0.08
253	601021	春秋航空	132,315	6,030,917.70	0.08
254	601319	中国人保	865,500	5,850,780.00	0.08
255	600023	浙能电力	1,090,500	5,736,030.00	0.07
256	600039	四川路桥	706,920	5,528,114.40	0.07
257	601800	中国交建	964,200	5,505,582.00	0.07
258	000002	万 科Ａ	1,844,321	5,459,190.16	0.07
259	688223	晶科能源	1,113,179	5,287,600.25	0.07
260	601633	长城汽车	338,129	5,102,366.61	0.07
261	600588	用友网络	555,520	5,099,673.60	0.07
262	001965	招商公路	552,800	5,063,648.00	0.07
263	600600	青岛啤酒	95,700	4,998,411.00	0.06
264	603369	今世缘	202,997	4,813,058.87	0.06

265	600027	华电国际	1,072,700	4,773,515.00	0.06
266	601618	中国中冶	1,934,900	4,721,156.00	0.06
267	601607	上海医药	301,900	4,649,260.00	0.06
268	300628	亿联网络	137,175	4,639,258.50	0.06
269	603260	合盛硅业	95,700	4,618,482.00	0.06
270	302132	中航成飞	79,100	4,613,112.00	0.06
271	600918	中泰证券	858,100	4,565,092.00	0.06
272	600061	国投资本	692,988	4,539,071.40	0.06
273	000617	中油资本	684,800	4,512,832.00	0.06
274	600025	华能水电	505,000	4,489,450.00	0.06
275	300832	新产业	106,120	4,457,040.00	0.06
276	300251	光线传媒	398,000	4,413,820.00	0.06
277	600930	华电新能	905,055	4,317,112.35	0.06
278	600085	同仁堂	185,838	4,294,716.18	0.06
279	601059	信达证券	264,400	4,280,636.00	0.06
280	688472	阿特斯	395,192	4,275,977.44	0.06
281	600515	海南机场	1,548,300	4,242,342.00	0.05
282	000999	华润三九	180,333	4,055,689.17	0.05
283	600803	新奥股份	252,317	3,986,608.60	0.05
284	600845	宝信软件	233,140	3,877,118.20	0.05
285	600018	上港集团	819,100	3,866,152.00	0.05
286	300122	智飞生物	324,447	3,792,785.43	0.05
287	300999	金龙鱼	161,500	3,756,490.00	0.05
288	300896	爱美客	41,160	3,589,152.00	0.05
289	000596	古井贡酒	44,478	3,549,344.40	0.05
290	000708	中信特钢	273,100	3,446,522.00	0.04
291	688009	中国通号	700,756	3,335,598.56	0.04
292	601018	宁波港	1,053,600	3,318,840.00	0.04
293	688303	大全能源	175,191	3,053,579.13	0.04
294	601238	广汽集团	600,600	3,051,048.00	0.04
295	001280	中国铀业	44,977	2,999,965.90	0.04

296	301165	锐捷网络	37,100	2,984,695.00	0.04
297	300413	芒果超媒	202,922	2,968,748.86	0.04
298	603392	万泰生物	102,419	2,762,240.43	0.04
299	601136	首创证券	147,900	2,063,205.00	0.03
300	001391	国货航	397,100	1,616,197.00	0.02

7.3.2 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	688783	西安奕材	44,370	2,547,725.40	0.03
2	001248	华润新能源	84,104	850,291.44	0.01
3	301666	大普微	1,220	565,262.60	0.01
4	688820	盛合晶微	2,391	338,302.59	0.00
5	688781	视涯科技	6,335	267,083.60	0.00
6	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.00
7	001399	C惠科	6,488	179,912.24	0.00
8	688818	电科蓝天	1,717	120,430.38	0.00
9	301682	宏明电子	714	114,282.84	0.00
10	688797	C臻宝	207	97,014.69	0.00
11	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.00
12	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.00
13	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.00
14	688635	长进光子	128	39,448.32	0.00
15	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.00
16	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
17	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
18	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
19	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
20	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00

21	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
22	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
23	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
24	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
25	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
26	601112	振石股份	775	13,632.25	0.00
27	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
28	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
29	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
30	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
31	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
32	920136	永励精密	300	5,784.00	0.00
33	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
34	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00
35	920193	吉和昌	300	2,556.00	0.00
36	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
37	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
38	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
39	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	300308	中际旭创	65,106,096.95	0.80
2	300750	宁德时代	61,831,286.50	0.76
3	300502	新易盛	50,998,661.00	0.62
4	000988	华工科技	42,697,860.17	0.52
5	301308	江波龙	36,564,662.00	0.45

6	688072	拓荆科技	35,794,555.52	0.44
7	002371	北方华创	28,436,898.55	0.35
8	688521	芯原股份	27,035,684.48	0.33
9	002353	杰瑞股份	25,603,537.00	0.31
10	000333	美的集团	25,370,632.16	0.31
11	002602	世纪华通	24,261,526.00	0.30
12	600549	厦门钨业	20,831,530.00	0.25
13	300033	同花顺	20,785,361.67	0.25
14	300394	天孚通信	20,499,109.32	0.25
15	000657	中钨高新	19,826,495.43	0.24
16	002916	深南电路	19,806,740.80	0.24
17	300059	东方财富	16,925,405.85	0.21
18	002475	立讯精密	16,790,901.00	0.21
19	002202	金风科技	16,483,191.00	0.20
20	002594	比亚迪	15,912,158.00	0.19

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。

7.4.2 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	123,384,257.00	1.51
2	300750	宁德时代	119,439,740.60	1.46
3	300502	新易盛	80,624,058.07	0.99
4	000333	美的集团	46,344,736.85	0.57
5	002371	北方华创	41,359,263.40	0.51
6	002475	立讯精密	36,470,424.02	0.45
7	688256	寒武纪	31,537,707.42	0.39
8	300059	东方财富	29,218,877.66	0.36

9	300394	天孚通信	29,038,577.60	0.35
10	002594	比亚迪	28,725,551.00	0.35
11	002916	深南电路	24,295,164.10	0.30
12	002384	东山精密	24,290,588.99	0.30
13	300033	同花顺	23,930,002.35	0.29
14	300274	阳光电源	22,879,455.35	0.28
15	300476	胜宏科技	22,733,770.98	0.28
16	000858	五 粮 液	20,406,454.41	0.25
17	000725	京东方 A	19,735,863.43	0.24
18	000651	格力电器	19,141,100.54	0.23
19	000338	潍柴动力	18,748,036.16	0.23
20	002230	科大讯飞	18,687,684.68	0.23

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。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,318,958,245.81
卖出股票收入（成交）总额	1,723,575,740.52

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。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

在实际进行投资运作时，由于ETF基金一般需要满仓操作，同时基金需要备出一定的现金头寸应对申赎及费用等支付，因此仓位无法达到100%，这时基金仓位就存在裸露风险，通过套期保值方式买入期货合约，可以使基金仓位达到100%，避免仓位暴露的风险。股指期货在买入时总持仓量采用双限制策略，一是限制基金组合中总的股指期货持仓量不能超过向中金所申请并获批的套保总量；二是限制基金组合持有的股指期货合约价值加上基金组合中其他有价证券市值占基金净资产的比例不能超过法规规定的上限，并在股指期货的交易过程中严格遵守基金合同的约束和中金所的规定。根据本基金的基金合同、投资范围、投资目标、投资策略以及对市场走势研判的基础上，结合基金日常的申购赎回情况，制定套期保值交易的合理期限。套期保值的期限一般不超过股指期货当前的最远到期日合约，即次季合约。按照交易月份相近的原则，综合考虑并动态跟踪不同到期日的期货合约的流动性、价差状况和展期风险等因素，选择合适月份的期货合约进行开仓和展期交易来实现远期套保的目的。另外对于交割月的股指期货，通常情况下，最晚在合约交割日进行平仓，尽量避免进行交割。在未来的股指期货交易过程中，本基金将严格遵守《证券投资基金参与股指期货交易指引》，以及中国金融期货交易所颁布的《中国金融期货交易所交易规则》、《中国金融期货交易所套期保值与套利交易管理办法》等相关规定，以套期保值为主要目的参与股指期货，严格控制交易中的各种风险。

7.11 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券发行主体中，【招商银行股份有限公司】于2025年09月12日收到国家金融监督管理总局出具公开处罚、公开批评的通报。本基金为指数型基金，上述主体所发行的证券系标的指数成份股，对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

7.12.2 基金投资的前十名股票，均为基金合同约定备选股票库之内的股票。

7.12.3 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	11,913,493.73
2	应收清算款	10,361,176.29
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	60,492.63
8	其他	-
9	合计	22,335,162.65

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限情况。

7.12.5.2 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	688783	西安奕材	2,547,725.40	0.03	新股流通受限
2	001248	华润新能源	850,291.44	0.01	新股未上市
3	301666	大普微	565,262.60	0.01	新股流通受限
4	688820	盛合晶微	338,302.59	0.00	新股流通受限
5	688781	视涯科技	267,083.60	0.00	新股流通受限

7.12.6 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。

§8 基金份额持有人信息

8.1 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
5,441	989,654.38	204,816,094.00	3.80%	73,514,002.00	1.37%	5,106,379,400.00	94.83%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	10,600.00	0.00%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2019年12月05日)基金份额总额	236,709,496.00
本报告期期初基金份额总额	6,155,709,496.00
本报告期基金总申购份额	1,137,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	1,908,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-

本报告期期末基金份额总额	5,384,709,496.00

§10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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，宋永明先生担任公司副总经理，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》。

2026年1月14日，本基金托管人招商证券股份有限公司免去赵斗斗担任的托管部总经理职务，另有任用。

2026年1月14日，本基金托管人招商证券股份有限公司聘牛中强担任托管部副总经理（主持工作）；2026年6月10日，任托管部总经理。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期无涉及公募基金托管业务的诉讼。

10.4 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。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金所聘用的会计师事务所未发生变化。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

管理人受调查或处罚等情况	内容
受到调查或处罚等措施的主体	天弘基金管理有限公司
受到调查或处罚等措施的时间	2026年06月26日
采取调查或处罚等措施的机构	国家外汇管理局天津市分局
受到调查或处罚等措施类型	行政处罚
受到的具体措施类型	警告、罚款
受到调查或处罚等措施的原因	其他问题（报告报送的部分内容缺失）

受到处罚的依据	《中华人民共和国外汇管理条例》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	基金管理人已通过补充报送、优化流程等方式完成整改，整改成果已经国家外汇管理局天津市分局验收通过。
其他	-

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人在开展基金托管业务过程中无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员在开展基金托管业务过程中无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
渤海证券	1	-	-	-	-	-
长城证券	1	15,505,162.33	0.51%	3,223.56	0.51%	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
第一创业证券	2	-	-	-	-	-
东方	2	365,346,873.34	12.02%	75,956.53	12.02%	-

财富证券						
方正证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	3	-	-	-	-	-
广发证券	2	292,528,078.83	9.63%	60,816.18	9.63%	-
国泰海通证券	2	590,581.55	0.02%	80.96	0.01%	-
华林证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	3	1,389,326,073.00	45.72%	288,846.14	45.73%	-
金融街证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	2	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
英大证券	2	-	-	-	-	-
招商证券	5	519,435,169.76	17.09%	107,992.54	17.10%	-
中国银河证券	1	-	-	-	-	-

中国中金财富证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-
中信证券	3	455,872,220.24	15.00%	94,776.52	15.00%	-
中银国际证券	2	-	-	-	-	-

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

2、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，确定选用交易单元的证券公司，再和被选用的证券公司签订证券交易单元租用协议和综合服务协议。

3、本基金报告期内新租用交易单元：长城证券上海交易单元1个。

4、本基金报告期内停止租用交易单元：华泰证券上海交易单元1个。

10.8 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	天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金2025年第4季度报告	中国证监会规定媒介	2026-01-22
2	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	2026-02-10
3	天弘基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025年度）	中国证监会规定媒介	2026-03-31
4	天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金2025年年	中国证监会规定媒介	2026-03-31

	度报告		
5	天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金2026年第1季度报告	中国证监会规定媒介	2026-04-22
6	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	2026-04-23
7	天弘基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定媒介	2026-04-27
8	2025年度天弘基金管理有限公司以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	中国证监会规定媒介	2026-04-30
9	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	2026-05-13
10	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	2026-05-20
11	天弘基金管理有限公司关于终止中证金牛（北京）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	2026-05-29
12	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	2026-06-13
13	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	2026-06-17
14	天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要（更新）	中国证监会规定媒介	2026-06-26

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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	20260101-20260630	5,493,379,400.00	897,000,000.00	1,284,000,000.00	5,106,379,400.00	94.83%
产品特有风险							
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： （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； （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； （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为四舍五入。

11.2 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。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

1、中国证监会准予基金注册的文件

2、基金合同

3、托管协议

4、招募说明书

5、报告期内在指定报刊上披露的各项公告

6、基金管理人业务资格批件、营业执照

7、中国证监会规定的其他文件

12.2 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

12.3 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

二〇二六年八月三十一日