天弘沪深300指数增强型发起式证券投资基金

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:中信建投证券股份有限公司

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。

基金托管人中信建投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 11
4.1 基金管理人及基金经理情况 12
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明 14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 16
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 16
§5 托管人报告 16
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 16
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 16
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 16
§6 半年度财务会计报告（未经审计） 17
6.1 资产负债表 17
6.2 利润表 19
6.3 净资产变动表 20
6.4 报表附注 22
§7 投资组合报告 54
7.1 期末基金资产组合情况 54
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 54
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 56
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动 64
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 66
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 66
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 66
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 67
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 67
7.10 本基金投资股指期货的投资政策 67
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 67
7.12 投资组合报告附注 67
§8 基金份额持有人信息 68
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 68
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 69

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 69
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况 70
§9 开放式基金份额变动 70
§10 重大事件揭示 71
10.1 基金份额持有人大会决议 71
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 71
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 71
10.4 基金投资策略的改变 71
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 71
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 71
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 72
10.8 其他重大事件 75
§11 影响投资者决策的其他重要信息 77
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 77
11.2 影响投资者决策的其他重要信息 77
§12 备查文件目录 77
12.1 备查文件目录 77
12.2 存放地点 78
12.3 查阅方式 78

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	天弘沪深300指数增强型发起式证券投资基金			
基金简称	天弘沪深300指数增强发起			
基金主代码	008592			
基金运作方式	契约型开放式、发起式			
基金合同生效日	2019年12月27日			
基金管理人	天弘基金管理有限公司			
基金托管人	中信建投证券股份有限公司			
报告期末基金份额总额	839,986,106.84份			
基金合同存续期	不定期			
下属分级基金的基金简称	天弘沪深300指数增强发起A	天弘沪深300指数增强发起C	天弘沪深300指数增强发起E	天弘沪深300指数增强发起Y
下属分级基金的交易代码	008592	008593	022543	022940
报告期末下属分级基金的份额总额	519,034,230.04份	199,442,648.61份	112,754,633.90份	8,754,594.29份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票型指数增强基金，在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，力争获取高于标的指数的投资收益。
投资策略	本基金采用指数增强型投资策略，以沪深300指数作为基金投资组合的标的指数，结合深入的宏观面、基本面研究及数量化投资技术，在指数化投资基础上优化调整投资组合，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，年跟踪误差不超过7.75%，以实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人将采取合理措施避免跟踪偏离度、跟

	踪误差进一步扩大。本基金产品投资策略包括：资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、其他类型资产投资策略等策略。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×95%+银行活期存款税后利率×5%。
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		天弘基金管理有限公司	中信建投证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	童建林	邱珂磊
	联系电话	022-83310208	4008-888-108
	电子邮箱	service@thfund.com.cn	service@csc.com.cn
客户服务电话		400-986-8888	95587
传真		022-83865564	010-56162085
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	北京市朝阳区安立路66号4号楼
办公地址		天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层	北京市朝阳区景辉街16号院1号楼泰康集团大厦8层/18层，北京市朝阳区光华路10号中信大厦82层
邮政编码		300203	100020
法定代表人		黄辰立	刘成

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
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	基金管理人及基金托管人的办公地址

点	

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	天弘基金管理有限公司	天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层

§3 主要财务指标和基金净值表现

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)			
	天弘沪深300指数增强发起A	天弘沪深300指数增强发起C	天弘沪深300指数增强发起E	天弘沪深300指数增强发起Y
本期已实现收益	87,841,311.07	35,463,788.31	18,432,756.36	1,152,827.48
本期利润	100,718,679.17	40,784,701.50	25,820,145.53	1,435,264.30
加权平均基金份额本期利润	0.2076	0.1983	0.2620	0.2316
本期加权平均净值利润率	13.50%	13.15%	17.06%	14.91%
本期基金份额净值增长率	13.78%	13.61%	13.59%	13.98%
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	309,946,752.26	112,655,388.52	66,303,086.02	5,307,498.62
期末可供分配基金份额利润	0.5972	0.5649	0.5880	0.6063
期末基金资产净值	871,873,852.34	328,562,670.63	188,366,456.39	14,786,393.74
期末基金份额净值	1.6798	1.6474	1.6706	1.6890
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	67.98%	64.74%	29.98%	37.72%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

天弘沪深300指数增强发起A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	16.63%	1.25%	11.30%	1.19%	5.33%	0.06%
过去六个月	13.78%	1.13%	7.20%	1.07%	6.58%	0.06%
过去一年	33.46%	1.00%	25.13%	0.97%	8.33%	0.03%
过去三年	44.52%	1.06%	28.26%	1.06%	16.26%	0.00%
过去五年	9.57%	1.08%	-4.03%	1.06%	13.60%	0.02%
自基金合同生效日起至今	67.98%	1.15%	23.16%	1.13%	44.82%	0.02%

天弘沪深300指数增强发起C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	16.54%	1.25%	11.30%	1.19%	5.24%	0.06%
过去六个月	13.61%	1.13%	7.20%	1.07%	6.41%	0.06%
过去一年	33.06%	1.00%	25.13%	0.97%	7.93%	0.03%

过去三年	43.23%	1.06%	28.26%	1.06%	14.97%	0.00%
过去五年	7.93%	1.08%	-4.03%	1.06%	11.96%	0.02%
自基金合同生效日起至今	64.74%	1.15%	23.16%	1.13%	41.58%	0.02%

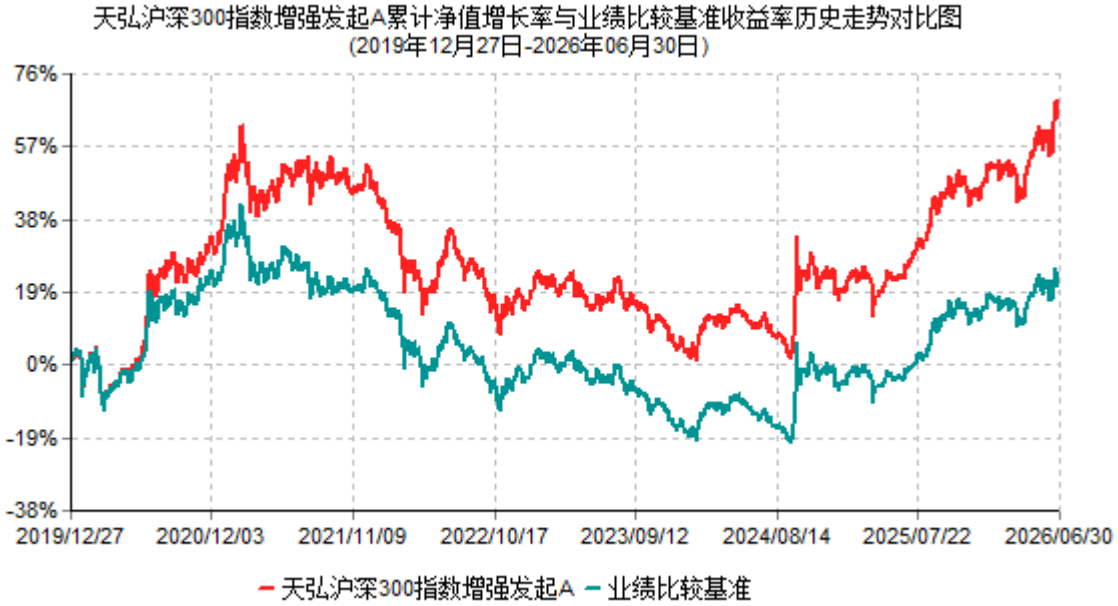
天弘沪深300指数增强发起E

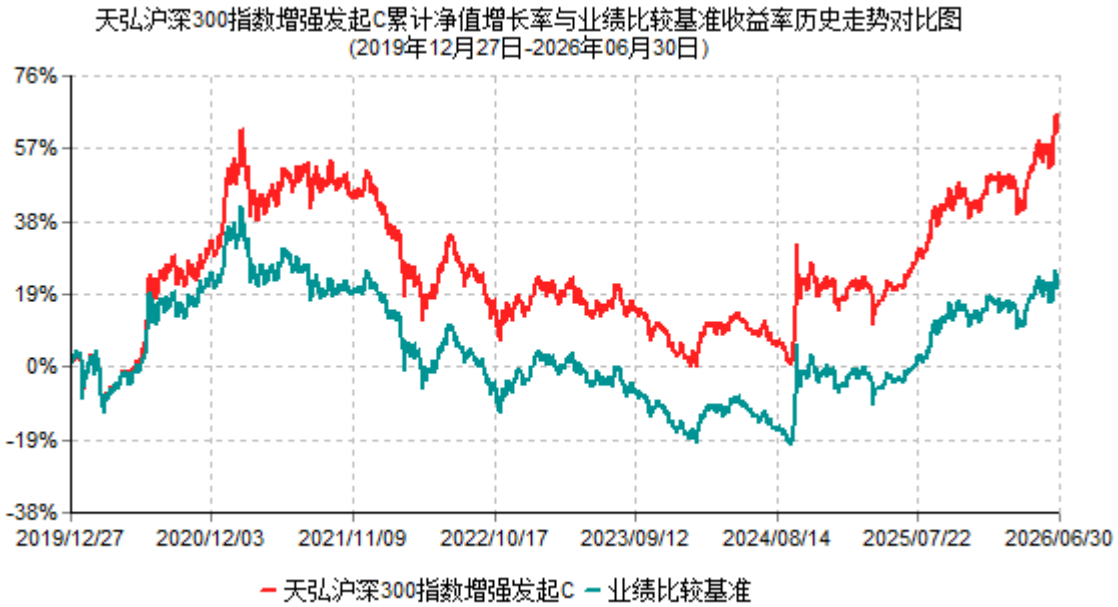
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	16.53%	1.25%	11.30%	1.19%	5.23%	0.06%
过去六个月	13.59%	1.13%	7.20%	1.07%	6.39%	0.06%
过去一年	33.01%	1.00%	25.13%	0.97%	7.88%	0.03%
自基金份额首次确认日起至今	29.98%	1.00%	20.12%	0.97%	9.86%	0.03%

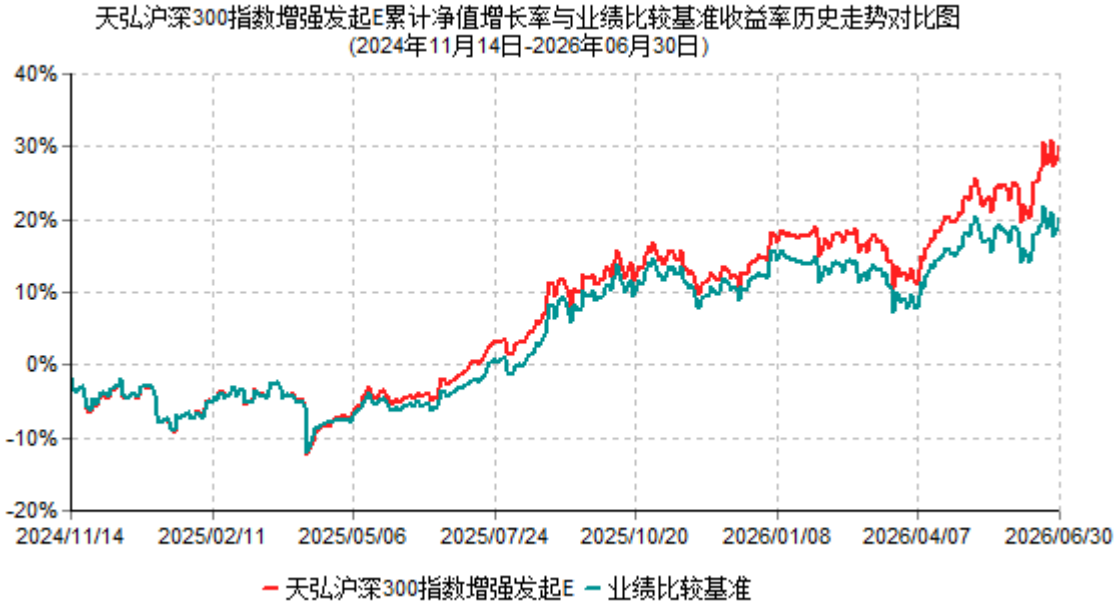
天弘沪深300指数增强发起Y

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	16.73%	1.25%	11.30%	1.19%	5.43%	0.06%
过去六个月	13.98%	1.13%	7.20%	1.07%	6.78%	0.06%
过去一年	33.93%	1.00%	25.13%	0.97%	8.80%	0.03%
自基金份额首次确认日起至今	37.72%	0.99%	25.91%	0.96%	11.81%	0.03%

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


天弘沪深300指数增强发起A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2019年12月27日-2026年06月30日)
76%
57%
38%
19%
0%
-19%
-38%
2019/12/27
2020/12/03
2021/11/09
2022/10/17
2023/09/12
2024/08/14
2025/07/22
2026/06/30
天弘沪深300指数增强发起A
业绩比较基准


天弘沪深300指数增强发起C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2019年12月27日-2026年06月30日)
76%
57%
38%
19%
0%
-19%
-38%
2019/12/27
2020/12/03
2021/11/09
2022/10/17
2023/09/12
2024/08/14
2025/07/22
2026/06/30
天弘沪深300指数增强发起C
业绩比较基准



注：1、本基金合同于2019年12月27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、本基金自2024年11月04日起增设天弘沪深300指数增强发起E基金份额。天弘沪深300指数增强发起E基金份额的首次确认日为2024年11月14日。本基金自2024年12月13日起增设天弘沪深300指数增强发起Y基金份额。天弘沪深300指数增强发起Y基金份额的首次确认日为2024年12月17日。

§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		
杨超	量化投资部总经理、本基金基金经理	2019年12月27日	-	16年	男，金融数学与计算硕士。历任建信基金管理有限责任公司基金经理助理、泰达宏利基金管理有限公司基金经理。2019年1月加盟本公司，历任指数与数量投资部总经理。

林心龙	本基金基金经理助理	2021年01月12日	-	11年	男，光学工程专业硕士。历任南方基金管理股份有限公司研究员、新华基金管理股份有限公司基金经理助理。2019年8月加盟本公司，历任高级研究员。

注：1、上述任职日期/离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2、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，市场整体上行，但结构上有较大分化。具体来说，根据万得数据统计（以价格指数计算，未考虑指数样本股分红收益）：中证全指上涨10.69%，沪深300上涨7.55%，中证A500上涨11.91%，中证500上涨20.97%，创业板指上涨35.58%，中证1000上涨15.99%。报告期内，基金以基准指数为投资基础，通过选股模型围绕基准进行持续优化，力争在基准的行业分布内精选基本面更为优质的标的，并在结构化风险模型和优化器的辅助下构建收益风险比更具优势的投资组合。受益于上述策略的有效性，基金在报告期内取得了一定程度的超额收益。

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

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2026年06月30日，天弘沪深300指数增强发起A基金份额净值为1.6798元，天弘沪深300指数增强发起C基金份额净值为1.6474元，天弘沪深300指数增强发起E基金份额净值为1.6706元，天弘沪深300指数增强发起Y基金份额净值为1.6890元。报告期内份额净值增长率天弘沪深300指数增强发起A为13.78%，同期业绩比较基准增长率为7.20%；天弘沪深300指数增强发起C为13.61%，同期业绩比较基准增长率为7.20%；天弘沪深300指数增强发起E为13.59%，同期业绩比较基准增长率为7.20%；天弘沪深300指数增强发起Y为13.98%，同期业绩比较基准增长率为7.20%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2026年下半年，外部环境依然错综复杂，全球贸易条件与地缘冲突的外溢风险尚未消退，国内经济则处在新旧动能转换与结构升级的关键阶段。上半年我国经济运行在合理区间，经济增速符合全年预期目标，展现出较强的发展韧性与活力，同时经济持续稳中向好的基础仍需进一步巩固。我们认为，下半年宏观运行大概率延续波动中修复、分化中再平衡的特征：出口在经历较快增长后将面临基数抬升与外部不确定性的考验，但依托中国制造业的结构性竞争优势，外贸有望继续保持韧性并发挥托底作用；高技术制造与数字基础设施相关领域的投资有望保持相对韧性，房地产投资的调整或将延续，

其对总量增长的影响仍需观察；消费的修复斜率或仍偏温和，但结构上有望继续向服务消费与更新换代需求倾斜。随着落后产能治理的推进，工业品价格有望保持温和回升，但其持续性仍取决于供需格局的进一步改善，居民消费价格则预计维持低位温和运行。

政策取向清晰而积极。2026年是“十五五”规划的开局之年，宏观政策明确要求精准有效实施更加积极的财政政策和适度宽松的货币政策，持续扩大内需、优化供给，着力稳就业、稳企业、稳市场、稳预期。财政方面，赤字率安排与超长期特别国债的发行规模为扩大财政支出、加强逆周期调节提供了有力支持；货币方面，政策强调增强前瞻性、灵活性与针对性，保持流动性充裕和社会融资条件相对宽松，并通过结构性工具对科技创新、民营企业、普惠小微等重点领域实施定向支持，后续仍具备相机抉择的余地。“十五五”规划纲要关于全面实施“人工智能+”行动、加快建设现代化产业体系等部署，为产业升级提供了明确且具有延续性的政策指引；与此同时，深化资本市场投融资综合改革、健全中长期资金入市机制等安排的持续推进，也在稳步改善权益市场的制度环境与资金结构。

证券市场方面，我们对A股的中长期表现继续保持积极，同时提示两个需要正视的变化。其一是市场结构的高度分化，报告期内无论从行业间的收益差距还是个股收益的截面离散度衡量，市场分化程度均达到近十年来的高位，主要宽基指数的涨幅与多数个股的实际表现之间出现明显背离；我们认为，这一分化反映了不同行业盈利前景、估值水平与市场预期的差异，后续可能随着盈利验证、资金结构及风险偏好的变化而有所调整。其二是市场核心矛盾的切换，本轮行情的驱动力正在从预期与情绪的修复逐步转向企业盈利与现金流的实际兑现，从一季度数据看，上市公司整体营业收入与归属于母公司股东的净利润同比均有所改善，但不同板块之间的景气差异依然明显，前期估值抬升较快的方向能否被后续业绩所验证，将是影响行情高度与节奏的重要因素。相应地，下半年市场的波动中枢可能较上半年有所抬升，部分领域估值与交易拥挤度的上升，可能放大市场对边际变化的敏感度。尽管如此，市场仍存在若干中长期支撑因素，无风险收益率的低位运行与居民资产多元化配置需求，有望为权益市场资金面提供一定支持，中长期资金入市机制的健全亦有助于改善投资者结构与定价稳定性。总体而言，我们认为权益资产的中长期配置价值依然值得重视，但下半年的收益来源或将更多取决于结构的选择与风险的管理，而非对市场整体方向的简单押注。

当然，我们也应认识到，无论是宽基指数还是细分行业指数，准确预测其变化的幅度、速率以及时间窗口始终存在较大挑战。面对市场的不确定性，一套以概率思维为指导的投资框架和应对方法，往往比依赖单一结果的押注式预测更加有效，也更有可能带来良好的投资体验；在个股表现差异显著放大的市场环境中，系统化、纪律化的投资流程对于保持策略的一致性尤为重要。因此，我们鼓励投资者一方面以更长期的视角进行基金配置，更多考虑业绩与估值的匹配程度以及收益风险比，另一方面在投资时机以及

投资品种上进行适度分散化，以更好地对冲风险，力争实现收益的长期积累，并更充分地发挥复利效应。

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

在本报告期内，本基金托管人在托管天弘沪深300指数增强型发起式证券投资基金过程中，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规和基金合同的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，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

在本报告期内，本基金托管人按照相关法律法规、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、基金费用开支方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作进行了监督，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

本报告中财务指标、净值收益表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告的数据真实、准确和完整（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分，以及涉及关联方和基金份额持有人信息等相关数据未在托管人复核范围内）。

§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指数增强型发起式证券投资基金

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	60,489,029.73	64,078,666.66
结算备付金		2,773,173.86	2,807,420.73
存出保证金		495,178.65	318,185.06
交易性金融资产	6.4.7.2	1,343,283,324.66	1,193,982,689.98
其中：股票投资		1,330,385,407.79	1,190,720,513.22
基金投资		-	-
债券投资		12,897,916.87	3,262,176.76
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		3,241,340.73	2,063,466.89
应收股利		-	-
应收申购款		2,901,418.05	1,138,235.27
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		1,413,183,465.68	1,264,388,664.59

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		2,242,924.73	-
应付赎回款		5,896,917.58	6,544,702.93
应付管理人报酬		609,389.07	639,642.43
应付托管费		101,564.80	106,607.08
应付销售服务费		125,287.97	114,215.80
应付投资顾问费		-	-
应交税费		82.39	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	617,926.04	643,331.53
负债合计		9,594,092.58	8,048,499.77
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	839,986,106.84	855,562,248.89
未分配利润	6.4.7.8	563,603,266.26	400,777,915.93
净资产合计		1,403,589,373.10	1,256,340,164.82
负债和净资产总计		1,413,183,465.68	1,264,388,664.59

注：报告截止日2026年06月30日，天弘沪深300指数增强型发起式证券投资基金A类基金份额净值1.6798元，天弘沪深300指数增强型发起式证券投资基金C类基金份额净值1.6474元，天弘沪深300指数增强型发起式证券投资基金E类基金份额净值1.6706元，天弘沪深300指数增强型发起式证券投资基金Y类基金份额净值1.6890元；基金份额总额839,986,106.84份，其中天弘沪深300指数增强型发起式证券投资基金A类基金份额519,034,230.04份，天弘沪深300指数增强型发起式证券投资基金C类基金份额199,442,648.61份，天弘沪深300指数增强型发起式证券投资基金E类基金份额112,754,633.90份，天弘沪深300指数增强型发起式证券投资基金Y类基金份额8,754,594.29份。

6.2 利润表

会计主体：天弘沪深300指数增强型发起式证券投资基金

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		173,771,840.85	36,435,501.51
1.利息收入		403,897.48	587,368.04
其中：存款利息收入	6.4.7.9	403,897.48	587,368.04
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）		147,244,058.64	36,777,601.78
其中：股票投资收益	6.4.7.10	136,355,205.31	15,099,808.91
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	84,045.41	20,422.91
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	-	-
股利收益	6.4.7.15	10,804,807.92	21,657,369.96
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	25,868,107.28	-1,144,055.72
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	255,777.45	214,587.41
减：二、营业总支出		5,013,050.35	6,637,241.85
1.管理人报酬		3,596,182.87	4,807,509.40
2.托管费		599,363.93	801,251.55
3.销售服务费		717,734.36	870,642.63
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		21.22	-
8.其他费用	6.4.7.19	99,747.97	157,838.27
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		168,758,790.50	29,798,259.66
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		168,758,790.50	29,798,259.66
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		168,758,790.50	29,798,259.66

6.3 净资产变动表

会计主体：天弘沪深300指数增强型发起式证券投资基金

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	855,562,248.89	400,777,915.93	1,256,340,164.82
二、本期期初净资	855,562,248.89	400,777,915.93	1,256,340,164.82

产			
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-15,576,142.05	162,825,350.33	147,249,208.28
（一）、综合收益总额	-	168,758,790.50	168,758,790.50
（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）	-15,576,142.05	-5,933,440.17	-21,509,582.22
其中：1.基金申购款	464,277,216.53	249,593,087.25	713,870,303.78
2.基金赎回款	-479,853,358.58	-255,526,527.42	-735,379,886.00
（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	839,986,106.84	563,603,266.26	1,403,589,373.10

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	1,398,555,319.55	316,941,202.26	1,715,496,521.81
二、本期期初净资产	1,398,555,319.55	316,941,202.26	1,715,496,521.81
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-193,720,230.26	-13,863,754.11	-207,583,984.37
（一）、综合收益总额	-	29,798,259.66	29,798,259.66

（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）	-193,720,230.26	-43,662,013.77	-237,382,244.03
其中：1.基金申购款	264,774,565.21	55,657,349.10	320,431,914.31
2.基金赎回款	-458,494,795.47	-99,319,362.87	-557,814,158.34
（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	1,204,835,089.29	303,077,448.15	1,507,912,537.44

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指数增强型发起式证券投资基金（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]2112号《关于准予天弘沪深300指数增强型发起式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27日生效，首次设立募集规模为10,716,235.78份基金份额。本基金的运作方式为契约型开放式、发起式，存续期限不定。本基金的基金管理人为天弘基金管理有限公司，基金托管人为中信建投证券股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、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、金融债、地方政府债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券）、货币市场

工具、同业存单、银行存款、债券回购、股指期货、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可以根据相关法律法规的规定参与融资和转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金投资于股票的资产不低于基金资产的90%，投资于标的指数成份股、备选成份股的资产的比例不低于非现金基金资产的80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。

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	60,489,029.73
等于：本金	60,464,859.62
加：应计利息	24,170.11
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	60,489,029.73

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		1,260,128,604.36	-	1,330,385,407.79	70,256,803.43
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	12,627,351.00	114,546.87	12,897,916.87	156,019.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	12,627,351.00	114,546.87	12,897,916.87	156,019.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		1,272,755,955.36	114,546.87	1,343,283,324.66	70,412,822.43

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

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

本基金本报告期末未持有其他资产。

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	824.81
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	521,853.26
其中：交易所市场	521,853.26
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	95,247.97
合计	617,926.04

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 天弘沪深300指数增强发起A

金额单位：人民币元

项目 (天弘沪深300指数增强发起A)	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	551,620,798.90	551,620,798.90
本期申购	178,164,907.90	178,164,907.90
本期赎回（以“-”号填列）	-210,751,476.76	-210,751,476.76
本期末	519,034,230.04	519,034,230.04

6.4.7.7.2 天弘沪深300指数增强发起C

金额单位：人民币元

项目 (天弘沪深300指数增强发起C)	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	246,374,002.60	246,374,002.60
本期申购	87,113,373.03	87,113,373.03
本期赎回（以“-”号填列）	-134,044,727.02	-134,044,727.02
本期末	199,442,648.61	199,442,648.61

6.4.7.7.3 天弘沪深300指数增强发起E

金额单位：人民币元

项目 (天弘沪深300指数增强发起E)	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	54,426,266.33	54,426,266.33
本期申购	190,868,636.85	190,868,636.85
本期赎回（以“-”号填列）	-132,540,269.28	-132,540,269.28
本期末	112,754,633.90	112,754,633.90

6.4.7.7.4 天弘沪深300指数增强发起Y

金额单位：人民币元

项目 (天弘沪深300指数增强发起Y)	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	3,141,181.06	3,141,181.06
本期申购	8,130,298.75	8,130,298.75
本期赎回（以“-”号填列）	-2,516,885.52	-2,516,885.52
本期末	8,754,594.29	8,754,594.29

注：申购含转换转入份额；赎回含转换转出份额。

6.4.7.8 未分配利润

6.4.7.8.1 天弘沪深300指数增强发起A

单位：人民币元

项目 (天弘沪深300指数增强发起A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	230,119,128.30	32,648,280.94	262,767,409.24
本期期初	230,119,128.30	32,648,280.94	262,767,409.24
本期利润	87,841,311.07	12,877,368.10	100,718,679.17
本期基金份额交易产生的变动数	-8,013,687.11	-2,632,779.00	-10,646,466.11
其中：基金申购款	95,817,266.05	8,331,632.29	104,148,898.34

基金赎回款	-103,830,953.16	-10,964,411.29	-114,795,364.45
本期已分配利润	-	-	-
本期末	309,946,752.26	42,892,870.04	352,839,622.30

6.4.7.8.2 天弘沪深300指数增强发起C

单位：人民币元

项目 (天弘沪深300指数增强发起C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	96,198,011.47	14,679,169.98	110,877,181.45
本期期初	96,198,011.47	14,679,169.98	110,877,181.45
本期利润	35,463,788.31	5,320,913.19	40,784,701.50
本期基金份额交易产生的变动数	-19,006,411.26	-3,535,449.67	-22,541,860.93
其中：基金申购款	42,027,878.71	3,962,805.45	45,990,684.16
基金赎回款	-61,034,289.97	-7,498,255.12	-68,532,545.09
本期已分配利润	-	-	-
本期末	112,655,388.52	16,464,633.50	129,120,022.02

6.4.7.8.3 天弘沪深300指数增强发起E

单位：人民币元

项目 (天弘沪深300指数增强发起E)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	22,394,061.99	3,225,759.21	25,619,821.20
本期期初	22,394,061.99	3,225,759.21	25,619,821.20
本期利润	18,432,756.36	7,387,389.17	25,820,145.53
本期基金份额交易产生的变动数	25,476,267.67	-1,304,411.91	24,171,855.76
其中：基金申购款	85,965,431.70	8,963,649.30	94,929,081.00
基金赎回款	-60,489,164.03	-10,268,061.21	-70,757,225.24
本期已分配利润	-	-	-

本期末	66,303,086.02	9,308,736.47	75,611,822.49

6.4.7.8.4 天弘沪深300指数增强发起Y

单位：人民币元

项目 (天弘沪深300指数增强发起Y)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,327,807.75	185,696.29	1,513,504.04
本期期初	1,327,807.75	185,696.29	1,513,504.04
本期利润	1,152,827.48	282,436.82	1,435,264.30
本期基金份额交易产生的变动数	2,826,863.39	256,167.72	3,083,031.11
其中：基金申购款	4,126,239.68	398,184.07	4,524,423.75
基金赎回款	-1,299,376.29	-142,016.35	-1,441,392.64
本期已分配利润	-	-	-
本期末	5,307,498.62	724,300.83	6,031,799.45

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	397,897.59
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	5,171.25
其他	828.64
合计	403,897.48

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日

卖出股票成交总额	2,419,887,196.23
减：卖出股票成本总额	2,281,013,199.44
减：交易费用	2,518,791.48
买卖股票差价收入	136,355,205.31

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
债券投资收益——利息收入	84,066.41
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-21.00
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	84,045.41

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	304,110.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	300,021.00
减：应计利息总额	4,110.00
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-21.00

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

本基金本报告期未取得其他衍生工具投资收益。

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	10,804,807.92
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	10,804,807.92

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	25,868,107.28
——股票投资	25,839,741.28
——债券投资	28,366.00
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-

3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	25,868,107.28

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	236,422.04
基金转换费收入	19,355.41
合计	255,777.45

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	31,240.60
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行间账户维护费	9,000.00
合计	99,747.97

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、基金销售机构、基金注册登记机构
中信建投证券股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

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
中信建投证券股份有限公司	1,896,874,616.52	39.42%	-	-

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	成交金额	占当期

		债券买卖成交总额的比例		债券买卖成交总额的比例
中信建投证券股份有限公司	8,803,921.00	89.79%	-	-

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
中信建投证券股份有限公司	394,357.37	39.42%	159,774.77	30.62%
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
-	-	-	-	-

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	3,596,182.87	4,807,509.40
其中：应支付销售机构的客户维护费	1,636,324.36	1,913,025.49
应支付基金管理人的净管理费	1,959,858.51	2,894,483.91

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乘以前一日各级基金资产净值占比的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。天弘沪深300指数增强发起A约定的管理费年费率为0.60%，天弘沪深300指数增强发起C约定的管理费年费率为0.60%，天弘沪深300指数增强发起E约定的管理费年费率为0.60%，天弘沪深300指数增强发起Y约定的管理费年费率为0.30%。其计算公式为：日管理人报酬＝前一日基金资产净值×前一日各级基金资产净值占比×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	599,363.93	801,251.55

注:支付基金托管人中信建投证券股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值乘以前一日各级基金资产净值占比的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。天弘沪深300指数增强发起A约定的托管费年费率为0.10%，天弘沪深300指数增强发起C约定的托管费年费率为0.10%，天弘沪深300指数增强发起E约定的托管费年费率为0.10%，天弘沪深300指数增强发起Y约定的托管费年费率为0.05%。其计算公式为：日

托管费＝前一日基金资产净值×前一日各级基金资产净值占比×该日适用费率/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日				
	当期发生的基金应支付的销售服务费				
	天弘沪深300指数增强发起A	天弘沪深300指数增强发起C	天弘沪深300指数增强发起E	天弘沪深300指数增强发起Y	合计
天弘基金管理有限公司	-	8,570.91	508.29	-	9,079.20
中信建投证券股份有限公司	-	262.46	-	-	262.46
合计	-	8,833.37	508.29	-	9,341.66
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日				
	当期发生的基金应支付的销售服务费				
	天弘沪深300指数增强发起A	天弘沪深300指数增强发起C	天弘沪深300指数增强发起E	天弘沪深300指数增强发起Y	合计
天弘基金管理有限公司	-	35,861.73	8.77	-	35,870.50
中信建投证券股份有限公司	-	460.81	-	-	460.81
合计	-	36,322.54	8.77	-	36,331.31

注：1、支付基金销售机构的销售服务费按前一日各级基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给天弘基金管理有限公司，再由天弘基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。天弘沪深300指数增强发起C的销售服务费率为0.30%，天弘沪深300指数增强发起E的销售服务费率为0.35%。销售服务费的计算公式为：

日销售服务费＝前一日各级基金资产净值×该日适用费率/当年天数。

2、天弘沪深300指数增强发起A和天弘沪深300指数增强发起Y不收取销售服务费。

3、根据《公开募集证券投资基金销售费用管理规定》，自该规定施行之日起，或对于已发售基金，自其完成基金合同修订及相关调整之日起，投资人通过基金管理人认购/申购的或者通过代销机构认购/申购且持续持有期限超过一年的基金份额不收取销售服务费。本基金按照该法规要求对不应收取的销售服务费将在投资者赎回基金份额或基金合同终止时随赎回款或清算款一并返还给投资者。

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

天弘沪深300指数增强发起A

本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

天弘沪深300指数增强发起C

本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

天弘沪深300指数增强发起E

本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

天弘沪深300指数增强发起Y

本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

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
中信建投证券股份有限公司	60,489,029.73	397,897.59	77,922,876.15	579,114.02

注：本基金由基金托管人中信建投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
中信证券股份有限公司	688785	恒运昌	网下申购	1,155	106,467.90
中信建投证券股份有限公司	688818	电科蓝天	网下申购	17,168	162,580.96
中信证券股份有限公司	301683	慧谷新材	网下申购	952	74,617.76
中信建投	688813	泰金新能	网下申购	2,337	61,416.36

证券股份有限公司					
中信证券股份有限公司	688811	有研复材	网下申购	8,337	53,440.17
中信证券股份有限公司	688820	盛合晶微	网下申购	15,570	306,417.60
中信证券股份有限公司	001312	福恩股份	网下申购	1,333	24,500.54
中信证券股份有限公司	688808	联讯仪器	网下申购	1,624	132,973.12
中信证券股份有限公司	301669	高特电子	网下申购	5,455	38,621.40
中信证券股份有限公司	688797	臻宝科技	网下申购	2,070	92,239.20
中信证券股份有限公司	001248	华润新能源	网下申购	48,836	493,731.96
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
中信证券股份有限公司	688758	赛分科技	网下申购	7,768	33,557.76
中信证券股份有限	688583	思看科技	网下申购	1,742	58,287.32

公司					
中信证券股份有限公司	603124	江南新材	网下申购	879	9,264.66
中信证券股份有限公司	603257	中国瑞林	网下申购	780	16,005.60
中信证券股份有限公司	301662	宏工科技	网下申购	1,429	38,011.40
中信建投证券股份有限公司	603202	天有为	网下申购	1,657	154,929.50
中信证券股份有限公司	688755	汉邦科技	网下申购	2,023	46,063.71
中信建投证券股份有限公司	603049	中策橡胶	网下申购	6,950	323,175.00
中信证券股份有限公司	688775	影石创新	网下申购	5,725	270,620.75
中信建投证券股份有限公司	603400	华之杰	网下申购	569	11,311.72

注：中信证券股份有限公司为托管人的重要关联方。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

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
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	-
001248	华润新能源	2026-06-24	6个月	新股流通受限	10.11	10.11	34,186	345,620.46	345,620.46	-
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	-
688820	盛合晶微	2026-04-13	6个月	新股流通受限	19.68	141.49	1,557	30,641.76	220,299.93	-
001399	C惠科	2026-06-16	6个月	新股流通受限	10.12	27.73	5,800	58,696.00	160,834.00	-
001248	华润新能源	2026-06-24	1个月内（含）	新股未上市	10.11	10.11	14,650	148,111.50	148,111.50	-
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	-

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	-
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

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

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

本基金为股票型指数基金，采用指数复制投资策略，按照个股在标的指数中的基准权重构建股票组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应地调整，以复制和跟踪标的指数。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，力争获取高于标的指数的投资收益。

本基金管理人按照“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中信建投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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	10,312,141.09	705,440.98
合计	10,312,141.09	705,440.98

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

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

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
AAA	-	-
AAA以下	-	-
未评级	2,585,775.78	2,556,735.78
合计	2,585,775.78	2,556,735.78

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

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一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

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。

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

通股票的30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。

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

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

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

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 2026年06月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	60,489,029.73	-	-	-	60,489,029.73
结算备付金	2,773,173.86	-	-	-	2,773,173.86
存出保证金	495,178.65	-	-	-	495,178.65
交易性金融资产	10,312,141.09	-	2,585,775.78	1,330,385,407.79	1,343,283,324.66
应收清算款	-	-	-	3,241,340.73	3,241,340.73
应收申购款	-	-	-	2,901,418.05	2,901,418.05
资产总计	74,069,523.33	-	2,585,775.78	1,336,528,166.57	1,413,183,465.68
负债					
应付清算款	-	-	-	2,242,924.73	2,242,924.73
应付赎回款	-	-	-	5,896,917.58	5,896,917.58
应付管理人报酬	-	-	-	609,389.07	609,389.07
应付托管费	-	-	-	101,564.80	101,564.80
应付销售服务费	-	-	-	125,287.97	125,287.97
应交税费	-	-	-	82.39	82.39
其他负债	-	-	-	617,926.04	617,926.04
负债总计	-	-	-	9,594,092.58	9,594,092.58
利率敏感度缺口	74,069,523.33	-	2,585,775.78	1,326,934,073.99	1,403,589,373.10
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	64,078,666.66	-	-	-	64,078,666.66
结算备付金	2,807,420.73	-	-	-	2,807,420.73
存出保证金	318,185.06	-	-	-	318,185.06
交易性金融资产	705,440.98	-	2,556,735.78	1,190,720,513.22	1,193,982,689.98
应收清算款	-	-	-	2,063,466.89	2,063,466.89
应收申购款	-	-	-	1,138,235.27	1,138,235.27

资产总计	67,909,713.43	-	2,556,735.78	1,193,922,215.38	1,264,388,664.59
负债					
应付赎回款	-	-	-	6,544,702.93	6,544,702.93
应付管理人报酬	-	-	-	639,642.43	639,642.43
应付托管费	-	-	-	106,607.08	106,607.08
应付销售服务费	-	-	-	114,215.80	114,215.80
其他负债	-	-	-	643,331.53	643,331.53
负债总计	-	-	-	8,048,499.77	8,048,499.77
利率敏感度缺口	67,909,713.43	-	2,556,735.78	1,185,873,715.61	1,256,340,164.82

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，本基金持有的交易性债券投资占基金净资产的比例为0.92%(2025年12月31日：0.26%)，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。

本基金采用指数增强型投资策略，以沪深300指数作为基金投资组合的标的指数，结合深入的宏观面、基本面研究及数量化投资技术，在指数化投资基础上优化调整投资组合。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于股票的资产不低于基金资产的90%，投资于标的指数成份股、备选成份股的资产的比例不低于非现金基金资产的80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期

日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

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	1,330,385,407.79	94.78	1,190,720,513.22	94.78
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	1,330,385,407.79	94.78	1,190,720,513.22	94.78

注：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%	80,840,037.77	66,696,224.99

	业绩比较基准下降5%	-80,840,037.77	-66,696,224.99

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	1,327,602,780.12	1,187,166,280.59
第二层次	13,391,648.83	3,262,176.76
第三层次	2,288,895.71	3,554,232.63
合计	1,343,283,324.66	1,193,982,689.98

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	1,330,385,407.79	94.14
	其中：股票	1,330,385,407.79	94.14
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	12,897,916.87	0.91
	其中：债券	12,897,916.87	0.91
	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	63,262,203.59	4.48
8	其他各项资产	6,637,937.43	0.47
9	合计	1,413,183,465.68	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	15,042,900.80	1.07
B	采矿业	61,345,863.08	4.37

C	制造业	721,269,738.53	51.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,222,807.75	2.51
E	建筑业	3,250,922.00	0.23
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	29,849,740.14	2.13
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	62,824,911.58	4.48
J	金融业	242,483,479.91	17.28
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	4,296,886.50	0.31
M	科学研究和技术服务业	15,302,279.00	1.09
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	1,190,889,529.29	84.85

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	3,252.00	0.00
B	采矿业	916,250.82	0.07
C	制造业	112,151,198.30	7.99
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,677,825.96	0.26
E	建筑业	5,356,765.00	0.38

F	批发和零售业	5,610,000.00	0.40
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	2,562,827.96	0.18
J	金融业	5,751,525.00	0.41
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	3,464,650.00	0.25
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	139,495,878.50	9.94

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	59,900	76,073,000.00	5.42
2	300750	宁德时代	97,546	38,336,553.46	2.73
3	600519	贵州茅台	31,010	36,762,044.90	2.62
4	300502	新易盛	60,120	36,492,840.00	2.60
5	601318	中国平安	614,700	29,345,778.00	2.09
6	688012	中微公司	59,523	27,886,525.50	1.99
7	002384	东山精密	99,300	26,051,355.00	1.86

8	688981	中芯国际	162,992	25,886,389.44	1.84
9	688256	寒武纪	15,012	23,952,396.60	1.71
10	600036	招商银行	634,960	22,541,080.00	1.61
11	601899	紫金矿业	849,500	21,356,430.00	1.52
12	600276	恒瑞医药	409,371	21,303,666.84	1.52
13	601398	工商银行	2,861,200	20,228,684.00	1.44
14	300408	三环集团	115,860	19,337,034.00	1.38
15	601211	国泰海通	985,000	17,927,000.00	1.28
16	688521	芯原股份	48,017	17,821,029.38	1.27
17	300274	阳光电源	111,843	17,785,273.86	1.27
18	002475	立讯精密	226,422	15,940,108.80	1.14
19	601166	兴业银行	951,100	15,750,216.00	1.12
20	300014	亿纬锂能	235,600	15,321,068.00	1.09
21	603259	药明康德	122,900	15,302,279.00	1.09
22	002714	牧原股份	429,920	15,042,900.80	1.07
23	603986	兆易创新	18,400	14,996,000.00	1.07
24	600919	江苏银行	1,371,630	14,786,171.40	1.05
25	601688	华泰证券	700,191	14,437,938.42	1.03
26	600900	长江电力	536,601	14,203,828.47	1.01
27	600460	士兰微	257,900	14,096,814.00	1.00
28	002460	赣锋锂业	215,400	14,087,160.00	1.00
29	601988	中国银行	2,445,200	13,986,544.00	1.00
30	600999	招商证券	653,200	13,782,520.00	0.98
31	000333	美的集团	181,663	13,721,006.39	0.98
32	000858	五 粮 液	183,462	13,576,188.00	0.97
33	000776	广发证券	578,100	13,527,540.00	0.96
34	600938	中国海油	489,100	13,279,065.00	0.95
35	000338	潍柴动力	476,700	12,990,075.00	0.93
36	600309	万华化学	187,450	12,823,454.50	0.91
37	002600	领益智造	736,000	12,762,240.00	0.91
38	300033	同花顺	52,420	12,633,220.00	0.90

39	300124	汇川技术	187,900	12,463,407.00	0.89
40	601872	招商轮船	689,300	12,111,001.00	0.86
41	002415	海康威视	344,470	11,780,874.00	0.84
42	601601	中国太保	393,194	11,213,892.88	0.80
43	600031	三一重工	637,200	11,010,816.00	0.78
44	600887	伊利股份	457,420	10,959,783.20	0.78
45	000725	京东方A	1,244,100	10,798,788.00	0.77
46	000100	TCL科技	1,820,200	10,593,564.00	0.75
47	002371	北方华创	11,500	10,172,440.00	0.72
48	300059	东方财富	498,522	10,159,878.36	0.72
49	600795	国电电力	2,168,300	10,125,961.00	0.72
50	600188	兖矿能源	551,475	9,799,710.75	0.70
51	002558	巨人网络	336,000	9,260,160.00	0.66
52	600026	中远海能	515,600	9,249,864.00	0.66
53	601288	农业银行	1,519,900	9,225,793.00	0.66
54	000063	中兴通讯	254,900	9,224,831.00	0.66
55	600000	浦发银行	1,039,700	8,951,817.00	0.64
56	600489	中金黄金	492,669	8,892,675.45	0.63
57	600150	中国船舶	253,027	8,549,782.33	0.61
58	002241	歌尔股份	372,300	8,387,919.00	0.60
59	000938	紫光股份	284,600	8,213,556.00	0.59
60	601328	交通银行	1,241,900	7,985,417.00	0.57
61	002028	思源电气	41,600	7,196,800.00	0.51
62	002352	顺丰控股	223,880	6,998,488.80	0.50
63	000657	中钨高新	68,400	6,547,248.00	0.47
64	600362	江西铜业	145,400	6,295,820.00	0.45
65	601728	中国电信	1,205,200	6,254,988.00	0.45
66	600183	生益科技	35,900	6,225,060.00	0.44
67	600066	宇通客车	231,300	6,201,153.00	0.44
68	000807	云铝股份	267,200	5,915,808.00	0.42
69	688008	澜起科技	18,685	5,790,481.50	0.41

70	000651	格力电器	148,800	5,580,000.00	0.40
71	600690	海尔智家	260,700	5,320,887.00	0.38
72	688041	海光信息	14,235	5,271,220.50	0.38
73	688111	金山办公	24,652	5,252,108.60	0.37
74	002466	天齐锂业	85,060	5,215,879.20	0.37
75	600660	福耀玻璃	101,934	5,141,550.96	0.37
76	002001	新 和 成	176,194	5,007,433.48	0.36
77	002916	深南电路	10,700	4,899,530.00	0.35
78	600886	国投电力	342,600	4,560,006.00	0.32
79	601138	工业富联	62,100	4,480,515.00	0.32
80	600426	华鲁恒升	184,100	4,403,672.00	0.31
81	000425	徐工机械	490,900	3,971,381.00	0.28
82	600989	宝丰能源	187,400	3,809,842.00	0.27
83	600011	华能国际	476,200	3,614,358.00	0.26
84	601898	中煤能源	295,066	3,593,903.88	0.26
85	600549	厦门钨业	41,400	3,527,280.00	0.25
86	601088	中国神华	89,200	3,482,368.00	0.25
87	601998	中信银行	501,100	3,472,623.00	0.25
88	688472	阿特斯	317,752	3,438,076.64	0.24
89	601668	中国建筑	748,700	3,249,358.00	0.23
90	600482	中国动力	97,700	3,204,560.00	0.23
91	002027	分众传媒	586,500	2,838,660.00	0.20
92	600027	华电国际	609,200	2,710,940.00	0.19
93	601600	中国铝业	306,200	2,516,964.00	0.18
94	600089	特变电工	107,300	2,414,250.00	0.17
95	603501	豪威集团	24,700	2,342,795.00	0.17
96	600176	中国巨石	31,100	2,266,568.00	0.16
97	601766	中国中车	407,900	2,121,080.00	0.15
98	002493	荣盛石化	189,700	2,039,275.00	0.15
99	002648	卫星化学	84,300	1,980,207.00	0.14
100	605117	德业股份	16,800	1,783,824.00	0.13

101	600019	宝钢股份	282,000	1,531,260.00	0.11
102	600346	恒力石化	85,200	1,508,892.00	0.11
103	601888	中国中免	27,150	1,458,226.50	0.10
104	600809	山西汾酒	12,800	1,399,936.00	0.10
105	000568	泸州老窖	17,200	1,333,344.00	0.09
106	002625	光启技术	42,900	1,300,728.00	0.09
107	002050	三花智控	27,700	1,214,091.00	0.09
108	600893	航发动力	29,300	1,123,362.00	0.08
109	688036	传音控股	19,029	1,121,759.55	0.08
110	002463	沪电股份	7,100	1,084,880.00	0.08
111	300661	圣邦股份	7,300	1,047,404.00	0.07
112	002049	紫光国微	11,000	976,250.00	0.07
113	300803	指南针	9,100	834,197.00	0.06
114	300760	迈瑞医疗	5,761	782,516.63	0.06
115	002594	比亚迪	9,500	757,150.00	0.05
116	601225	陕西煤业	32,200	655,270.00	0.05
117	601009	南京银行	59,500	588,455.00	0.04
118	688396	华润微	5,879	573,496.45	0.04
119	601336	新华保险	9,200	548,872.00	0.04
120	002179	中航光电	11,600	535,920.00	0.04
121	601816	京沪高铁	116,400	527,292.00	0.04
122	600233	圆通速递	31,300	492,975.00	0.04
123	600029	南方航空	90,530	468,945.40	0.03
124	600015	华夏银行	67,400	430,686.00	0.03
125	000895	双汇发展	17,800	398,720.00	0.03
126	000792	盐湖股份	12,000	362,280.00	0.03
127	603019	中科曙光	3,200	343,136.00	0.02
128	601857	中国石油	33,000	286,440.00	0.02
129	600941	中国移动	3,300	284,229.00	0.02
130	600875	东方电气	6,300	181,251.00	0.01
131	300896	爱美客	1,900	165,680.00	0.01

132	603799	华友钴业	2,700	130,302.00	0.01
133	601939	建设银行	12,700	122,301.00	0.01
134	300476	胜宏科技	200	69,286.00	0.00
135	601127	赛力斯	400	24,500.00	0.00
136	605499	东鹏饮料	80	9,874.40	0.00
137	003816	中国广核	1,400	5,474.00	0.00
138	601995	中金公司	79	2,855.85	0.00
139	600025	华能水电	252	2,240.28	0.00
140	600039	四川路桥	200	1,564.00	0.00
141	601006	大秦铁路	200	922.00	0.00
142	601919	中远海控	19	251.94	0.00

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	002156	通富微电	132,450	10,048,981.50	0.72
2	002080	中材科技	107,800	9,702,000.00	0.69
3	600418	江淮汽车	373,500	9,647,505.00	0.69
4	000519	中兵红箭	434,600	9,157,022.00	0.65
5	002281	光迅科技	35,300	9,069,982.00	0.65
6	600885	宏发股份	248,844	8,582,629.56	0.61
7	002185	华天科技	370,300	8,261,393.00	0.59
8	300223	北京君正	29,900	7,442,110.00	0.53
9	000783	长江证券	589,900	5,751,525.00	0.41
10	300475	香农芯创	18,700	5,610,000.00	0.40
11	000032	深桑达Ａ	214,700	5,356,765.00	0.38
12	002465	海格通信	404,500	5,165,465.00	0.37
13	603179	新泉股份	90,480	4,492,332.00	0.32
14	600601	方正科技	293,600	4,063,424.00	0.29

15	300604	长川科技	11,300	3,858,046.00	0.27
16	002131	利欧股份	729,400	3,464,650.00	0.25
17	300857	协创数据	9,880	3,358,212.00	0.24
18	000060	中金岭南	421,500	3,190,755.00	0.23
19	688615	合合信息	22,658	2,562,619.80	0.18
20	000027	深圳能源	412,000	2,554,400.00	0.18
21	002294	信立泰	70,200	2,238,678.00	0.16
22	002851	麦格米特	8,000	1,337,440.00	0.10
23	300390	天华新能	12,700	1,187,577.00	0.08
24	600392	盛和资源	39,500	1,175,915.00	0.08
25	688469	芯联集成	106,621	1,131,248.81	0.08
26	600801	华新建材	71,900	1,121,640.00	0.08
27	688301	奕瑞科技	7,949	985,676.00	0.07
28	002444	巨星科技	28,000	870,800.00	0.06
29	000703	恒逸石化	59,200	803,344.00	0.06
30	300438	鹏辉能源	9,200	762,220.00	0.05
31	002432	九安医疗	10,300	728,004.00	0.05
32	001203	大中矿业	21,900	655,905.00	0.05
33	001286	陕西能源	62,100	629,694.00	0.04
34	301666	大普微	1,220	565,262.60	0.04
35	001248	华润新能源	48,836	493,731.96	0.04
36	000831	中国稀土	5,900	327,391.00	0.02
37	002056	横店东磁	9,400	286,512.00	0.02
38	688781	视涯科技	6,335	267,083.60	0.02
39	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.02
40	601699	XD潞安环	15,700	224,196.00	0.02
41	688820	盛合晶微	1,557	220,299.93	0.02
42	001399	C惠科	5,800	160,834.00	0.01
43	301358	湖南裕能	2,000	151,740.00	0.01
44	003031	中瓷电子	800	144,240.00	0.01
45	000967	盈峰环境	13,000	136,890.00	0.01

46	002812	恩捷股份	1,900	127,129.00	0.01
47	600105	永鼎股份	1,800	121,464.00	0.01
48	688818	电科蓝天	1,717	120,430.38	0.01
49	301682	宏明电子	714	114,282.84	0.01
50	002436	兴森科技	2,200	112,090.00	0.01
51	301377	鼎泰高科	200	110,180.00	0.01
52	688797	C臻宝	207	97,014.69	0.01
53	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.00
54	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.00
55	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.00
56	688635	长进光子	128	39,448.32	0.00
57	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.00
58	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
59	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
60	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
61	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
62	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
63	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
64	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
65	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
66	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
67	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
68	601112	振石股份	775	13,632.25	0.00
69	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
70	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
71	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
72	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
73	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
74	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
75	600598	北大荒	300	3,252.00	0.00
76	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00

77	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
78	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
79	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
80	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00
81	300017	网宿科技	16	208.16	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	45,567,773.00	3.63
2	603986	兆易创新	43,599,996.00	3.47
3	300502	新易盛	38,071,687.40	3.03
4	601872	招商轮船	36,945,985.48	2.94
5	688012	中微公司	34,393,859.18	2.74
6	600482	中国动力	24,848,781.00	1.98
7	002384	东山精密	24,160,946.04	1.92
8	688256	寒武纪	23,014,817.77	1.83
9	688008	澜起科技	22,536,138.27	1.79
10	002463	沪电股份	21,117,563.96	1.68
11	002714	牧原股份	21,041,906.00	1.67
12	000338	潍柴动力	20,493,057.00	1.63
13	300014	亿纬锂能	20,304,224.18	1.62
14	000725	京东方Ａ	20,151,239.00	1.60
15	600489	中金黄金	19,970,051.98	1.59
16	000960	锡业股份	19,858,756.80	1.58
17	002156	通富微电	19,791,325.00	1.58
18	300408	三环集团	19,348,333.90	1.54
19	600584	长电科技	18,727,890.00	1.49

20	300433	蓝思科技	18,535,830.00	1.48

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	603986	兆易创新	51,271,282.43	4.08
2	688008	澜起科技	40,792,235.22	3.25
3	601872	招商轮船	38,649,904.19	3.08
4	300502	新易盛	33,692,579.80	2.68
5	002463	沪电股份	31,331,007.66	2.49
6	600584	长电科技	31,139,265.00	2.48
7	000725	京东方Ａ	28,279,725.00	2.25
8	300433	蓝思科技	27,707,186.00	2.21
9	600183	生益科技	26,525,251.55	2.11
10	688041	海光信息	26,392,603.71	2.10
11	300604	长川科技	25,674,143.58	2.04
12	002156	通富微电	25,376,000.00	2.02
13	002594	比亚迪	24,666,211.89	1.96
14	000063	中兴通讯	22,234,917.40	1.77
15	300308	中际旭创	22,192,419.00	1.77
16	600482	中国动力	22,063,992.00	1.76
17	601857	中国石油	22,024,742.00	1.75
18	603019	中科曙光	20,491,770.02	1.63
19	300760	迈瑞医疗	20,453,839.91	1.63
20	000960	锡业股份	19,880,760.68	1.58

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	2,394,838,352.73
卖出股票收入（成交）总额	2,419,887,196.23

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

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	12,897,916.87	0.92
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	12,897,916.87	0.92

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

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	019785	25国债13	71,000	7,189,640.90	0.51
2	019705	23国债12	24,000	2,585,775.78	0.18
3	019827	26国债01	25,000	2,516,204.79	0.18
4	019792	25国债19	6,000	606,295.40	0.04

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

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	495,178.65
2	应收清算款	3,241,340.73
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,901,418.05
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	6,637,937.43

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

本基金本报告期末积极投资前五名股票不存在流通受限情况。

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

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
天弘沪深300指数增强发起A	98,189	5,286.07	113,796,368.85	21.92%	405,237,861.19	78.08%
天弘沪深300指数增强发起C	50,702	3,933.62	9,834,612.02	4.93%	189,608,036.59	95.07%

天弘沪深300指数增强发起E	398,168	283.18	19,489,378.29	17.28%	93,265,255.61	82.72%
天弘沪深300指数增强发起Y	2,154	4,064.34	-	-	8,754,594.29	100.00%
合计	545,303	1,540.40	143,120,359.16	17.04%	696,865,747.68	82.96%

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

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	天弘沪深300指数增强发起A	416,570.02	0.08%
	天弘沪深300指数增强发起C	58,539.49	0.03%
	天弘沪深300指数增强发起E	2,980.85	0.00%
	天弘沪深300指数增强发起Y	97,001.62	1.11%
	合计	575,091.98	0.07%

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	份额级别	持有基金份额总量的数量区

		间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	天弘沪深300指数增强发起A	0~10
	天弘沪深300指数增强发起C	0
	天弘沪深300指数增强发起E	0~10
	天弘沪深300指数增强发起Y	0~10
	合计	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	天弘沪深300指数增强发起A	0
	天弘沪深300指数增强发起C	0
	天弘沪深300指数增强发起E	0
	天弘沪深300指数增强发起Y	0
	合计	0

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

本基金成立后有10,000,444.49份为发起份额，发起份额承诺的持有期限为2019年12月27日至2022年12月27日。截至本报告期末，发起资金持有份额为0.00份。

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	天弘沪深300指数增强发起A	天弘沪深300指数增强发起C	天弘沪深300指数增强发起E	天弘沪深300指数增强发起Y
基金合同生效日(2019年12月27日)基金份额总额	5,657,162.01	5,059,073.77	-	-

本报告期期初基金份额总额	551,620,798.90	246,374,002.60	54,426,266.33	3,141,181.06
本报告期基金总申购份额	178,164,907.90	87,113,373.03	190,868,636.85	8,130,298.75
减：本报告期基金总赎回份额	210,751,476.76	134,044,727.02	132,540,269.28	2,516,885.52
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	519,034,230.04	199,442,648.61	112,754,633.90	8,754,594.29

§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》。

自2026年1月起，中信建投证券股份有限公司托管部行政负责人由朱志明变更为孙祥磊。

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，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

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

本报告期内托管人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

本报告期内托管人相关从业人员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

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
财通证券	1	-	-	-	-	-

长江证券	1	-	-	-	-	-
东吴证券	3	-	-	-	-	-
方正证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	974,039,389.72	20.24%	202,504.54	20.24%	-
华宝证券	2	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华金证券	2	-	-	-	-	-
华西证券	1	972,725,756.62	20.22%	202,234.35	20.22%	-
金融街证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	4	-	-	-	-	-
上海证券	1	-	-	-	-	-
申万宏源证券	3	553,046,023.11	11.49%	114,979.19	11.49%	-
天府证券	2	-	-	-	-	-
万联	1	-	-	-	-	-

证券						
中航证券	1	-	-	-	-	-
中信建投证券	6	1,896,874,616.52	39.42%	394,357.37	39.42%	-
中信证券	2	414,861,657.19	8.62%	86,245.93	8.62%	-

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：无。

4、本基金报告期内停止租用交易单元：无。

10.7.2 基金租用或者通过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
财通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东吴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华宝证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华金证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
金融街证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-

上海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
申万宏源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天府证券	-	-	-	-	-	-	-	-
万联证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中航证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	8,803,921.00	89.79%	-	-	-	-	-	-
中信证券	1,000,694.00	10.21%	-	-	-	-	-	-

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	2026-01-22
2	天弘沪深300指数增强型发起式证券投资基金2025年第4季度报告	中国证监会规定媒介	2026-01-22
3	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	2026-02-05
4	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	2026-03-26
5	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
6	天弘沪深300指数增强型发起式证券投资基金2025年年度报告	中国证监会规定媒介	2026-03-31
7	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	2026-04-03

8	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	2026-04-15
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	2026-04-16
10	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	2026-04-18
11	天弘沪深300指数增强型发起式证券投资基金2026年第1季度报告	中国证监会规定媒介	2026-04-22
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	2026-04-27
13	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
14	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
15	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	2026-06-04
16	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
17	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	2026-06-18
18	天弘基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公	中国证监会规定媒介	2026-06-26

	告		
19	天弘沪深300指数增强型发起式证券投资基金（A类份额）基金产品资料概要（更新）	中国证监会规定媒介	2026-06-26
20	天弘沪深300指数增强型发起式证券投资基金（C类份额）基金产品资料概要（更新）	中国证监会规定媒介	2026-06-26
21	天弘沪深300指数增强型发起式证券投资基金（E类份额）基金产品资料概要（更新）	中国证监会规定媒介	2026-06-26
22	天弘沪深300指数增强型发起式证券投资基金（Y类份额）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

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

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