

天弘沪深 300 指数量化增强型证券投资基金

2025 年年度报告

2025 年 12 月 31 日

基金管理人:天弘基金管理有限公司

基金托管人:中信银行股份有限公司

送出日期:2026 年 03 月 31 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2026年03月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告期自2025年08月19日起至2025年12月31日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	10
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	17
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	17
§6 审计报告	17
6.1 审计报告基本信息	17
6.2 审计报告的基本内容	18
§7 年度财务报表	21
7.1 资产负债表	21
7.2 利润表	22
7.3 净资产变动表	24
7.4 报表附注	25
§8 投资组合报告	58
8.1 期末基金资产组合情况	58
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	58
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	60
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	78
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	80
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	80
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	80
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	80
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	80
8.10 本基金投资股指期货的投资政策	80

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	80
8.12 投资组合报告附注	80
§9 基金份额持有人信息	81
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	81
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	82
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	82
§10 开放式基金份额变动	83
§11 重大事件揭示	83
11.1 基金份额持有人大会决议	83
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	83
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	84
11.4 基金投资策略的改变	84
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	84
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	84
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	84
11.8 其他重大事件	85
§12 影响投资者决策的其他重要信息	87
12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	87
12.2 影响投资者决策的其他重要信息	87
§13 备查文件目录	87
13.1 备查文件目录	87
13.2 存放地点	87
13.3 查阅方式	87

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	天弘沪深300指数量化增强型证券投资基金	
基金简称	天弘沪深300指数量化增强	
基金主代码	024855	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025年08月19日	
基金管理人	天弘基金管理有限公司	
基金托管人	中信银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	182,797,550.22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指数量化增强A	天弘沪深300指数量化增强C
下属分级基金的交易代码	024855	024856
报告期末下属分级基金的份额总额	14,034,253.66份	168,763,296.56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，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，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%，年化跟踪误差不超过7.75%，以实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人将采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。本基金运作过程中，当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市，且指数编制机构

	暂未作出调整的，基金管理人应当按照基金份额持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。本基金的投资策略包括：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。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。本基金若投资港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

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	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	童建林
	联系电话	022-83310208
	电子邮箱	service@thfund.com.cn
客户服务电话	400-986-8888	95558
传真	022-83865564	010-85230024
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	北京市朝阳区光华路10号院1号楼6-30层、32-42层
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	北京市朝阳区光华路10号院1号楼6-30层、32-42层
邮政编码	300203	100020
法定代表人	黄辰立	方合英

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露	中国证券报
------------	-------

露报纸名称	
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.thfund.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)	北京市东长安街1号东方广场毕马威大楼8层
注册登记机构	天弘基金管理有限公司	天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	本期2025年08月19日（基金合同生效日） - 2025年12月31日	
	天弘沪深300指数量化增强A	天弘沪深300指数量化增强C
本期已实现收益	934,109.43	5,592,524.09
本期利润	1,513,343.88	11,025,491.75
加权平均基金份额本期利润	0.0387	0.0478
本期加权平均净值利润率	3.81%	4.71%
本期基金份额净值增长率	4.36%	4.21%
3.1.2 期末数据和指标	2025年末	
期末可供分配利润	416,054.46	4,744,385.84
期末可供分配基金份额利润	0.0296	0.0281
期末基金资产净值	14,646,329.53	175,863,460.86
期末基金份额净值	1.0436	1.0421

3.1.3 累计期末指标	2025年末	
	基金份额累计净值增长率	4.36%

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。

4、本基金合同于2025年08月19日生效，合同生效当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

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

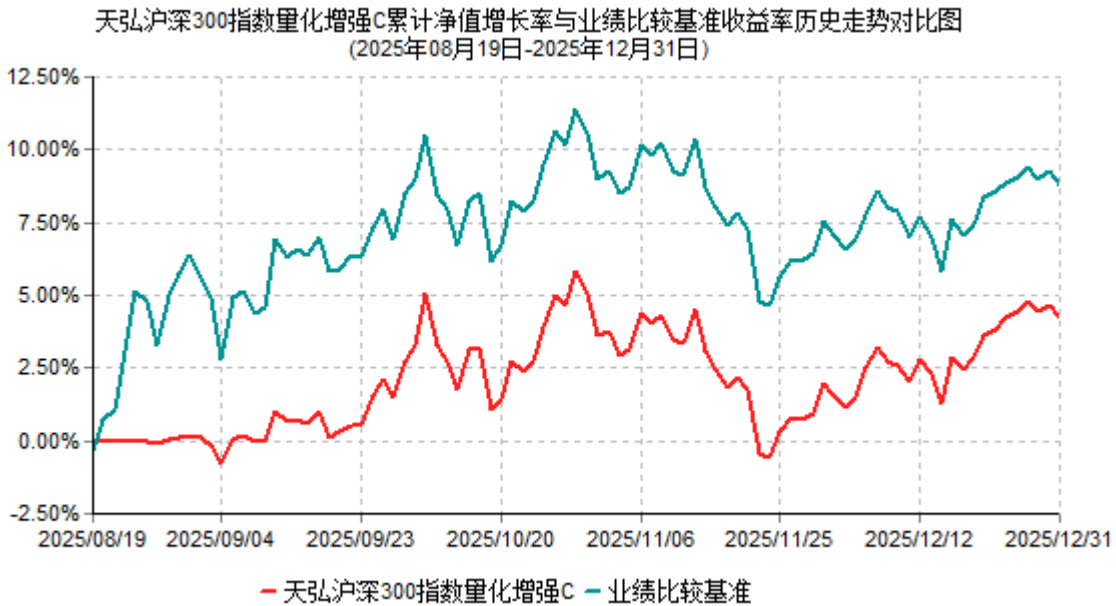
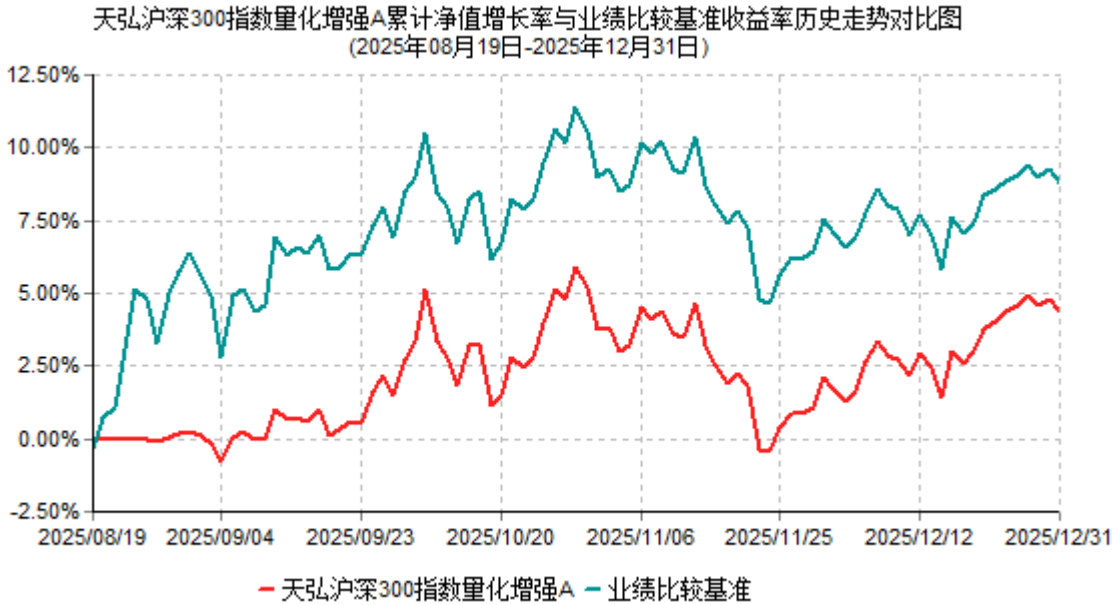
天弘沪深300指数量化增强A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.97%	0.86%	-0.20%	0.90%	1.17%	-0.04%
自基金合同生效日起至 今	4.36%	0.75%	8.76%	0.96%	-4.40%	-0.21%

天弘沪深300指数量化增强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	0.87%	0.86%	-0.20%	0.90%	1.07%	-0.04%
自基金合同生效日起至 今	4.21%	0.75%	8.76%	0.96%	-4.55%	-0.21%

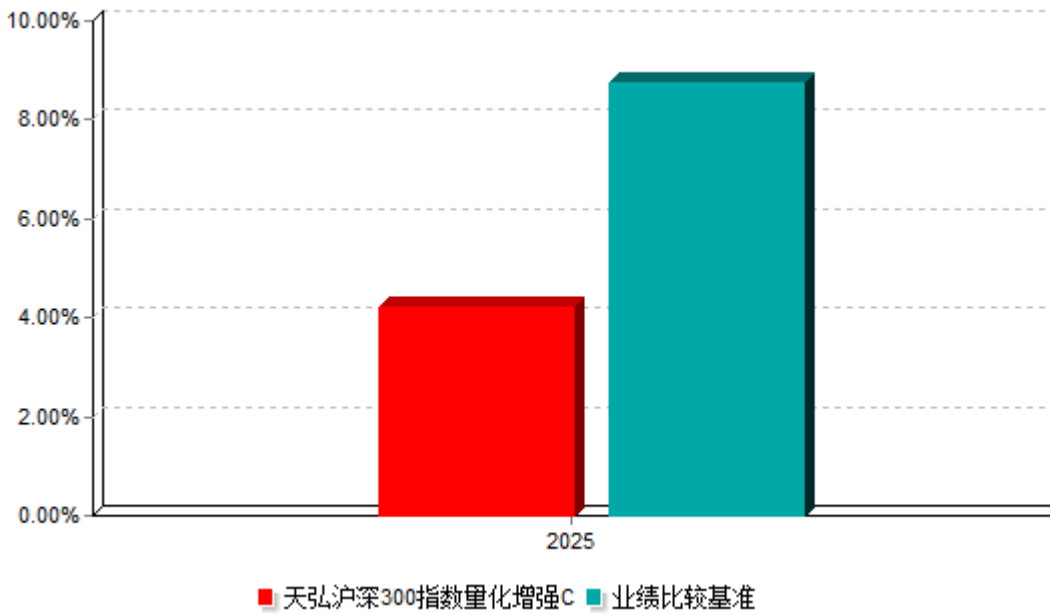
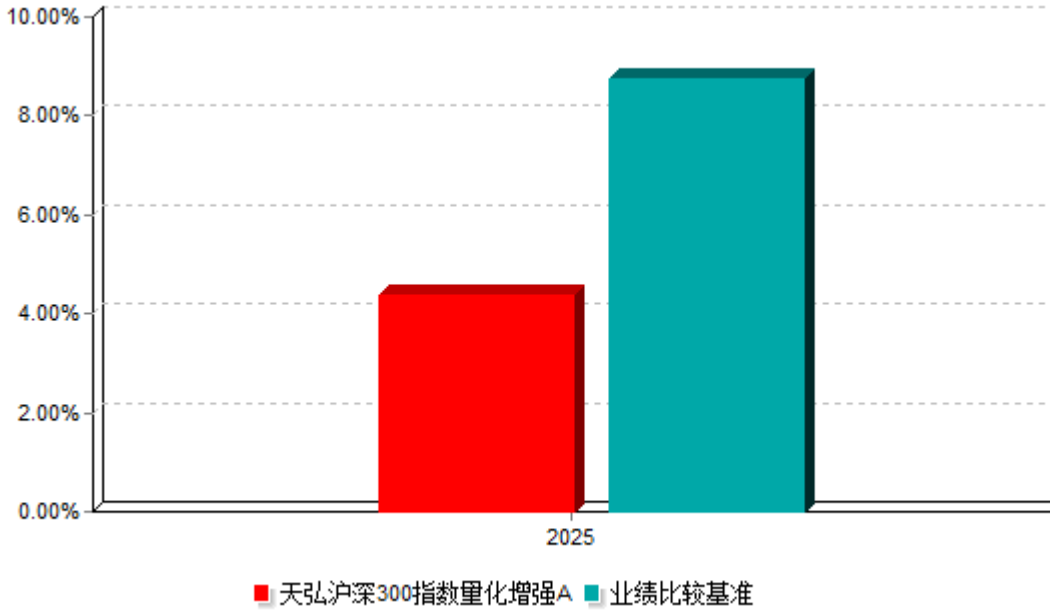
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、本基金合同于2025年08月19日生效，本基金合同生效起至披露时点不满1年。

2、按照本基金合同的约定，基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。本基金的建仓期为2025年08月19日至2026年02月18日，截止本报告期末本基金仍处于建仓期。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金合同于2025年08月19日生效。基金合同生效当年2025年的净值增长率按照基金合同生效后当年的实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金于2025年08月19日成立，自基金合同生效以来未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

截至2025年12月31日，公司共管理运作242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		
林心龙	本基金基金经理	2025年08月19日	-	10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、证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

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

本报告期内，本基金运作合法合规，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

公平交易的执行情况包括：建立统一的研究平台和公共信息平台，保证各组合得到公平的投资资讯；公平对待不同投资组合，禁止各投资组合之间进行以利益输送为目的的投资交易活动；在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，严格执行授权审批程序；实行集中交易制度和公平交易分配制度；建立不同投资组合投资信息的管理及保密制度，保证不同投资组合经理之间的重大非公开投资信息的相互隔离；加强对投资交易行为的监察稽核力度，建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估体系等。报告期内，公司公平交易程序运作良好，未出现异常情况；场外、网下业务公平交易制度执行情况良好，未出现异常情况。公司对旗下各投资组合的交易行为进行监控和分析，对各投资组合不同时间窗口（1日、3日、5日）内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验，

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易次数为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，市场整体震荡上行，成长风格持续占优，大盘蓝筹股表现相对稳健，市场结构分化格局贯穿全年。具体来说：本报告期内，万得数据显示，中证全指上涨24.60%，沪深300上涨17.66%，中证500上涨30.39%，创业板指上涨49.57%，中证1000上涨27.49%。本基金在报告期内成立并已完成建仓，建仓过程中受仓位和申赎冲击影响，业绩波动较大，当前已进入稳定运作阶段，受益于市场强劲表现和增强策略的有效性，本基金在报告期内获得了一定的正收益。

展望未来，我们认为沪深300指数具备较强的稳定性和长期配置价值，大盘蓝筹股的估值修复和业绩增长将成为核心驱动力，也为基金后续超额收益的获取提供了广阔空间。短期来看，国内宏观经济持续复苏，消费、金融等顺周期板块盈利修复确定性强，叠加市场风险偏好逐步提升，大盘蓝筹股有望迎来估值修复行情。中期维度，沪深300指数成分股中的龙头企业，在行业竞争中具备明显优势，受益于产业升级、消费升级等长期趋势，业绩增长稳定性较强，同时指数波动率处于历史低位，风险收益比优势凸显，是稳健型投资者的核心配置标的，也与本基金的投资定位高度契合。长期来看，国内经济持续高质量发展，大盘蓝筹股作为经济的核心支柱，将充分享受经济增长带来的红利，同时随着资本市场对外开放程度不断提升，沪深300指数成分股的全球吸引力持续增强，长期成长空间明确。

我们将持续优化针对沪深300指数的增强选股策略，在对基准指数进行有效跟踪、严格控制跟踪误差的基础上，通过对市场结构变化、行业景气度动态及成分股基本面的持续跟踪分析，重点关注金融、消费、高端制造等核心行业的龙头企业，利用量化选股模型及优化策略积极抽样组合，重点聚焦估值合理、业绩稳定增长、具备核心竞争力的大盘蓝筹股，力争在控制风险的前提下，持续提升超额收益能力，为投资者提供高于业绩比较基准的投资回报，实现稳健增值。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2025年12月31日，天弘沪深300指数量化增强A基金份额净值为1.0436元，天弘沪深300指数量化增强C基金份额净值为1.0421元。报告期内份额净值增长率天弘沪深300指数量化增强A为4.36%，同期业绩比较基准增长率为8.76%；天弘沪深300指数量化增强C为4.21%，同期业绩比较基准增长率为8.76%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2025年作为“十四五”规划收官之年，中国经济总体保持平稳运行、向新向好的发展态势，经济总量再上新台阶，全年GDP首次突破140万亿元，同比增长5.0%，圆满达成全年增长目标。从季度走势来看，一季度经济稳健开局，二、三季度受全球供应链波动影响增速略有承压，四季度依托内需提振与产业升级的双重动能企稳，经济实现平稳运行，全年整体呈现“稳中有升、结构优化”的鲜明运行特征。2025年我国持续强化科技创新核心驱动作用，新质生产力加快培育形成，经济向新发展的态势愈发凸显。研发经费投入强度提升至2.8%，较上年提高0.11个百分点，首次超越OECD国家平均水平；世界知识产权组织发布的数据显示，我国创新指数排名首次跻身全球前十。从基础研究的全新探索到关键核心技术的持续突破，从科技创新与产业创新的深度融合到惠民科创成果的广泛落地，我国在人工智能、量子科技、脑机接口等前沿领域捷报频传，一批重大科研成果密集涌现，新质生产力的发展根基不断夯实、规模持续壮大。2025年规模以上数字产品制造业增加值比上年增长9.3%。股票市场方面，2025年A股市场震荡上行、结构分化特征显著，整体呈现“科技引领、结构制胜”的走势。全年上证指数上涨18.41%，科创综指上涨46.30%，创业板指以49.57%的涨幅领跑主要宽基指数，市场总市值历史性突破120万亿元大关。具体风格中，以国证2000为代表的小盘风格大幅跑赢以上证50为代表的大盘风格，以国证成长为代表的成长风格大幅跑赢以国证价值为代表的价值风格，按照大盘-中盘-小盘和成长-价值划分，小盘成长大幅跑赢大盘价值。具体赛道中，周期+科技表现极为亮眼，成为全年行情核心引擎，其中周期赛道中细分有色上涨95.50%，细分化工上涨41.09%，科技赛道中人工智能上涨67.39%，芯片产业上涨43.15%。

展望2026年，宏观多项有利因素仍将持续。首先，美国降息进程虽暂缓但大方向未改。1月28日，美联储宣布维持联邦基金利率3.50%至3.75%不变，符合市场预期，此前此轮降息已累计下降175BP。据FedWatch数据，市场预期2026年美联储仍可能实施1至2次降息，具体节奏取决于通胀回落态势。美联储点阵图显示，联邦基金利率中位数2026年预计为3.4%，2027年和2028年预计均为3.1%，长期维持3.0%。另外，鲍威尔任期5月即将结束，特朗普将提名新一任美联储主席，若鸽派候选人当选，预计将进一步推动宽松政策。美联储整体仍处于降息通道，全球流动性有望持续宽松。其次，国内复苏进程延续弱复苏态势，仍面临结构性挑战，宏观政策将持续维持宽松基调。经济方面，2025年12月制造业PMI为50.1%，非制造业商务活动指数为50.2%，综合PMI产出指数为50.7%，均重返扩张区间，表明企业生产经营活动逐步改善。政策方面，2025年中央经济工作会

议明确，2026年将加大逆周期和跨周期调节力度，继续实施更加积极的财政政策和适度宽松的货币政策。从当前时点看，2026年国内有降准降息预期，加之美联储潜在降息动作，将为国内货币政策调整留下充足空间，助力经济平稳回升。最后，资金端支撑依旧强劲。一方面，在前期多项推动中长期资金入市政策的持续发力下，险资与养老资金有望进一步加大A股配置力度，为市场注入可观增量资金；另一方面，受存款利率持续下行以及居民定期存款陆续到期等因素推动，国内“存款搬家”趋势预计仍将持续，居民储蓄有望进一步向理财、基金及A股等权益类资产转移，成为资本市场的又一重要资金来源。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，基金管理人的监察稽核工作从保障基金份额持有人利益、合规运作、防范和控制风险出发，由独立的内控合规部门按照规定的权限和程序，认真履行职责，对公司、基金运作及员工行为的合法性、合规性进行监督和检查。发现问题及时提出建议并督促相关部门改进完善，及时与有关人员沟通，并定期制作监察稽核报告报公司董事会。公司经理层成立了风险管理委员会，指导、协调和监督各业务或职能部门开展风险管理工作；决定公司风险控制政策和程序，审批公司风险管理标准和重要业务风险管理口径；听取风险汇报，并就报告的重大风险管理事项进行决策；听取创新业务或产品风险评估报告；组织和协调重大风险事件的应对，直至风险得到妥善处理；审议公司重要的风险管理制度和流程。

同时，本基金管理人根据全面性原则、独立性原则、相互制约原则、定性和定量相结合原则、重要性原则建立了一套比较完整的内部控制体系，该内部控制体系由一系列业务管理制度及相应的业务处理、控制程序组成，具体包括控制环境、风险评估、控制活动、信息和沟通、监控等要素。

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

1、投研交环节，加强研究业务独立性，注重程序合规和质量控制。在关注研究报告形式与内容的合法性基础上，做好投资备选库的入选、维护管理。持续规范新股/新债询价、申购流程，做好关联交易的识别与管控。对投资运作过程中的风险点进行识别和监控，预防和控制由内部或外部流程、人员和系统失控而造成的损失。根据法律法规要求、基金合同约定、投资决策委员会决定，适时提出增加或优化交易系统风控指标的建议，通过投资交易系统控制投资风险。跟踪每日的交易行为和交易结果，发现预警信息通过电话、邮件及时提醒，保障投资环节的合规性。监督检查各投资组合新股/新债申购、银行间交易等场外交易的合规执行情况，保证投资组合合规开展各项场内、场外交易；

2、投资管理人员管理环节，加强对投资管理人员即时聊天工具、办公电话、移动电话、终端设备网上交易的合规监控，监督投资管理人员及其配偶、利害关系人证券投资申报制度、交易时间移动电话集中保管制度的有效执行，采取各种有效方式杜绝利用未公开信息交易、非公平交易及各种形式的利益输送行为；

3、基金募集与营销环节，严格落实基金销售相关法规政策要求，提升对基金宣传推介材料的合规审核质效，确保基金营销活动合法合规。坚守投资者利益优先原则，深化投资者适当性管理，致力于提升产品风险评级的合理性和科学性，切实保障投资者合法权益；

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

报告期内，本基金管理人未与任何第三方签订与估值相关的定价服务协议。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内本基金管理人无应说明预警信息。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

作为本基金的托管人，中信银行严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对天弘沪深300指数量化增强型证券投资基金报告期的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，履行了托管人的义务，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人认为，天弘基金管理有限公司在天弘沪深300指数量化增强型证券投资基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，天弘基金管理有限公司的信息披露事务符合《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的报告期内的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有关损害基金持有人利益的行为。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第2604342号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	天弘沪深300指数量化增强型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>我们审计了后附的天弘沪深300指数量化增强型证券投资基金（以下简称“该基金”）财务报表，包括2025年12月31日的资产负债表，自2025年08月19日（基金合同生效日）至2025年12月31日止期间的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）及财务报表附注7.4.2中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了该基金2025年12月31日的财务状况以及自2025年08月19日（基金合同生效日）至2025年12月31日止期间的经营成果和净资产变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则（以下简称“审计准则”）的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则和《中国注册会计师独立性准则第1号——财务报表审计和审阅业务对独立性的要求》中适用于公众利益实体财务报表审计业务的独立性要求，我们独立于该基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	该基金管理人天弘基金管理有限公司（以下简称

	<p>“该基金管理人”)管理层对其他信息负责。其他信息包括该基金2025年年度报告中涵盖的信息,但不包括财务报表和我们的审计报告。我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息,我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。</p> <p>结合我们对财务报表的审计,我们的责任是阅读其他信息,在此过程中,考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。</p> <p>基于我们已执行的工作,如果我们确定其他信息存在重大错报,我们应当报告该事实。在这方面,我们无任何事项需要报告。</p>
<p>管理层和治理层对财务报表的责任</p>	<p>该基金管理人管理层负责按照企业会计准则及财务报表附注7.4.2中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,该基金管理人管理层负责评估该基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非该基金预计在清算时资产无法按照公允价值处置。该基金管理人治理层负责监督该基金的财务报告过程。</p>
<p>注册会计师对财务报表审计的责任</p>	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p>

	<p>在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：</p> <p>(1)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(2)了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(3)评价该基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(4)对该基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对该基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致该基金不能持续经营。</p> <p>(5)评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与该基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>	
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所(特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	管祎铭	贾君宇

会计师事务所的地址	北京市东长安街1号东方广场毕马威大楼8层
审计报告日期	2026-03-27

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：天弘沪深300指数量化增强型证券投资基金

报告截止日：2025年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025年12月31日
资产：		
货币资金	7.4.7.1	15,882,890.10
结算备付金		4,705,138.29
存出保证金		1,162,929.60
交易性金融资产	7.4.7.2	170,765,346.93
其中：股票投资		170,765,346.93
基金投资		-
债券投资		-
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
其他投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-976.38
应收清算款		-
应收股利		-
应收申购款		720,400.35
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.5	-
资产总计		193,235,728.89
负债和净资产	附注号	本期末

		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	7.4.7.3	-
卖出回购金融资产款		-
应付清算款		-
应付赎回款		2,497,337.68
应付管理人报酬		117,806.51
应付托管费		14,725.84
应付销售服务费		52,473.76
应付投资顾问费		-
应交税费		3,510.71
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.6	40,084.00
负债合计		2,725,938.50
净资产：		
实收基金	7.4.7.7	182,797,550.22
未分配利润	7.4.7.8	7,712,240.17
净资产合计		190,509,790.39
负债和净资产总计		193,235,728.89

注：1.报告截止日2025年12月31日，天弘沪深300指数量化增强型证券投资基金A类基金份额净值1.0436元，天弘沪深300指数量化增强型证券投资基金C类基金份额净值1.0421元；基金份额总额182,797,550.22份，其中天弘沪深300指数量化增强型证券投资基金A类基金份额14,034,253.66份，天弘沪深300指数量化增强型证券投资基金C类基金份额168,763,296.56份。

2.本财务报表的实际编制期间为2025年08月19日(基金合同生效日)至2025年12月31日，无上一年度可比期间(下同)。

7.2 利润表

会计主体：天弘沪深300指数量化增强型证券投资基金

本报告期：2025年08月19日（基金合同生效日）至2025年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025年08月19日（基金合同 生效日）至2025年12月31 日
一、营业总收入		13,814,624.31
1.利息收入		268,011.40
其中：存款利息收入	7.4.7.9	62,913.08
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		205,098.32
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		7,532,032.27
其中：股票投资收益	7.4.7.10	5,683,537.10
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.11	76,334.10
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	-
贵金属投资收益	7.4.7.13	-
衍生工具收益	7.4.7.14	614,816.52
股利收益	7.4.7.15	1,157,344.55
其他投资收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	6,012,202.11
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	2,378.53
减：二、营业总支出		1,275,788.68
1.管理人报酬		794,261.54
2.托管费		99,282.73
3.销售服务费		339,225.56
4.投资顾问费		-

5.利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6.信用减值损失	7.4.7.18	-
7.税金及附加		2,218.23
8.其他费用	7.4.7.19	40,800.62
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		12,538,835.63
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		12,538,835.63
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		12,538,835.63

7.3 净资产变动表

会计主体：天弘沪深300指数量化增强型证券投资基金

本报告期：2025年08月19日（基金合同生效日）至2025年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2025年08月19日（基金合同生效日）至2025年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	-	-	-
二、本期期初净资产	557,036,489.05	-	557,036,489.05
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-374,238,938.83	7,712,240.17	-366,526,698.66
（一）、综合收益总额	-	12,538,835.63	12,538,835.63
（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）	-374,238,938.83	-4,826,595.46	-379,065,534.29

列)			
其中：1.基金申购款	91,043,817.25	1,962,710.91	93,006,528.16
2.基金赎回款	-465,282,756.08	-6,789,306.37	-472,072,062.45
(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	182,797,550.22	7,712,240.17	190,509,790.39

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

高阳

薄贺龙

薄贺龙

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

天弘沪深300指数量化增强型证券投资基金（以下简称“本基金”）系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2025]1351号《关于准予天弘沪深300指数量化增强型证券投资基金注册的批复》的准许，由基金管理人天弘基金管理有限公司自2025年07月28日至2025年08月15日止期间向社会公开发行募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明（2025）验字第80007653_B17号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2025年08月19日正式生效。本基金的运作方式为契约型开放式，存续期限不定。

设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币556,895,299.08元，募集资金在募集期间产生的利息为人民币141,189.97元，以上实收基金（本息）合计为人民币557,036,489.05元，折合557,036,489.05份基金份额，其中A类基金份额78,621,205.91份，C类基金份额478,415,283.14份。本基金的基金管理人为天弘基金管理有限公司，基金托管人为中信银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括科创板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票、存托凭证）、港股通标的股票、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、金融衍生工具（包括国债期货、股指期货、股票期权等）、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可以根据相关法律法规的规定参与融资和转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金投资于股票的资产不低于基金资产的80%，其中投资于港股通标的股票比例占股票资产的0%-50%，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国债期货、股指期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

本财务报表由本基金的基金管理人天弘基金管理有限公司于2026年03月27日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2025年08月19日(基金合同生效日)至2025年12月31日止期间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2025年12月31日的财务状况以及2025年08月19日(基金合同生效日)至2025年12月31日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2025年08月19日(基金合同生效日)至2025年12月31日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

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

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

- 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；
- 该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

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

(2) 金融负债的分类

本基金将金融负债分类为以摊余成本计量的金融负债。本基金无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

(3) 衍生金融工具

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

(1) 金融工具的初始确认

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

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

(2) 金融工具的后续计量

初始确认后，对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失(包括利息、股利收入和利息费用)计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

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

(3) 金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；

- 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

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

- 所转移金融资产在终止确认日的账面价值；
- 因转移金融资产而收到的对价。

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

(4) 金融工具的减值

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

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

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

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

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

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

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

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据企业会计准则的规定采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

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

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似金融工具的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

投资收益

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

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

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

公允价值变动收益

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

由于本基金A类基金份额不收取销售服务费，而C类基金份额收取销售服务费，各类别基金份额对应的可供分配利润将有所不同，基金管理人可对各类别基金份额分别制定收益分配方案，本基金同一类别的每份基金份额享有同等分配权；

本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为对应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金份额持有人可对A类、C类基金份额选择不同的分红方式；

基金管理人可每季度对基金相对业绩比较基准的超额收益率或基金的可供收益分配利润进行评价，在符合收益分配相关规定的前提下，基金管理人可进行收益分配；

在符合上述基金分红条件的前提下，本基金可每季度进行收益分配，具体分配方案以届时的公告为准，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人可在履行适当程序后可酌情调整以上基金收益分配原则和支付方式，无需召开基金份额持有人大会审议，但应于变更实施日前在规定媒介公告。

7.4.4.12 外币交易

外币交易按交易发生日的即期汇率将外币金额折算为人民币入账。

以公允价值计量的外币非货币性项目，于估值日采用估值日的即期汇率折算为人民币，所产生的折算差额直接计入公允价值变动损益科目。

7.4.4.13 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.14 其他重要的会计政策和会计估计

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

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

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，根据中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《关于固定收益品种的估值处理标准》在银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所及中国证券监督管理委员会认可的其他交易场所上市交易或挂牌转让的固定收益品种（估值处理标准另有规定的除外），采用第三方估值基准服务机构提供的价格数据进行估值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81号文《关于沪港股票

市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、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》、中投信〔2021〕20号《关于香港联合交易所有限公司上调股票交易印花税率有关提示的通知》、财政部公告2019年第93号《关于继续执行沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、财政部税务总局公告2023年第2号《关于延续实施有关个人所得税优惠政策的公告》、财政部 税务总局 中国证监会公告2023年第23号《关于延续实施沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、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》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

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

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

b) 对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

对证券投资基金从中国内地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。

c) 对基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限

售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

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

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称中国结算）提出申请，由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册，H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利，由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。对内地证券投资基金通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的股息红利所得，按照上述规定计征个人所得税。

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的转让差价所得和通过基金互认买卖香港基金份额取得的转让差价所得，继续暂免征收个人所得税，执行至2027年12月31日。

d)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。对于基金通过沪港通、深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日
活期存款	50,039.31
等于：本金	50,000.00
加：应计利息	39.31
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	15,832,850.79
等于：本金	15,832,513.37
加：应计利息	337.42
减：坏账准备	-
合计	15,882,890.10

注：其他存款为存放在证券经纪商证券资金账户的证券交易结算资金。

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	165,002,704.83	-	170,765,346.93	5,762,642.10
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	165,002,704.83	-	170,765,346.93	5,762,642.10

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

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

7.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2025年12月31日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	9,441,519.99	-	-	-
--股指期货	9,441,519.99	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	9,441,519.99	-	-	-

7.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动
IF2601	IF2601	6.00	8,313,120.00	209,360.01
IF2603	IF2603	1.00	1,377,960.00	40,200.00
合计				249,560.01
减：可抵销 期货暂收 款				249,560.01
净额				-

注：1、买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

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

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	-976.38	-

银行间市场	-	-
合计	-976.38	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	40,000.00
其他应付款	84.00
合计	40,084.00

7.4.7.7 实收基金

7.4.7.7.1 天弘沪深300指数量化增强A

金额单位：人民币元

项目 (天弘沪深300指数量化增强 A)	本期 2025年08月19日（基金合同生效日）至2025年12月31 日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	78,621,205.91	78,621,205.91

本期申购	3,699,702.92	3,699,702.92
本期赎回（以“-”号填列）	-68,286,655.17	-68,286,655.17
本期末	14,034,253.66	14,034,253.66

7.4.7.7.2 天弘沪深300指数量化增强C

金额单位：人民币元

项目 (天弘沪深300指数量化增强C)	本期 2025年08月19日（基金合同生效日）至2025年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	478,415,283.14	478,415,283.14
本期申购	87,344,114.33	87,344,114.33
本期赎回（以“-”号填列）	-396,996,100.91	-396,996,100.91
本期末	168,763,296.56	168,763,296.56

注：1、申购含转换转入份额；赎回含转换转出份额。

2、本基金合同于2025年08月19日生效,基金合同生效日的基金份额总额为557,036,489.05份基金份额，其中认购资金利息折合141,189.97份基金份额。

7.4.7.8 未分配利润

7.4.7.8.1 天弘沪深300指数量化增强A

单位：人民币元

项目 (天弘沪深300指数量化增强A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期期初（基金合同生效日）	-	-	-
本期利润	934,109.43	579,234.45	1,513,343.88
本期基金份额交易产生的变动数	-518,054.97	-383,213.04	-901,268.01
其中：基金申购款	25,275.28	28,009.51	53,284.79
基金赎回款	-543,330.25	-411,222.55	-954,552.80

本期已分配利润	-	-	-
本期末	416,054.46	196,021.41	612,075.87

7.4.7.8.2 天弘沪深300指数量化增强C

单位：人民币元

项目 (天弘沪深300指数量化增强C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期期初(基金合同生效日)	-	-	-
本期利润	5,592,524.09	5,432,967.66	11,025,491.75
本期基金份额交易产生的变动数	-848,138.25	-3,077,189.20	-3,925,327.45
其中：基金申购款	1,640,009.74	269,416.38	1,909,426.12
基金赎回款	-2,488,147.99	-3,346,605.58	-5,834,753.57
本期已分配利润	-	-	-
本期末	4,744,385.84	2,355,778.46	7,100,164.30

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年08月19日(基金合同生效日)至2025年12月31日
活期存款利息收入	1,325.46
定期存款利息收入	39,875.00
其他存款利息收入	10,494.41
结算备付金利息收入	11,206.12
其他	12.09
合计	62,913.08

7.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025年08月19日（基金合同生效日）至2025年12月31日
卖出股票成交总额	328,918,604.50
减：卖出股票成本总额	322,901,960.92
减：交易费用	333,106.48
买卖股票差价收入	5,683,537.10

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2025年08月19日（基金合同生效日）至2025年12月31日
债券投资收益——利息收入	82,705.86
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-6,371.76
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	76,334.10

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025年08月19日（基金合同生效日）至2025年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	80,044,142.52

减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	79,285,387.30
减：应计利息总额	765,126.98
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-6,371.76

7.4.7.12 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。

7.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期未取得贵金属投资收益。

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期未取得买卖权证差价收入。

7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年08月19日（基金合同生效日）至2025年12月31日
期货投资	614,816.52

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年08月19日（基金合同生效日）至2025年12月31日
股票投资产生的股利收益	1,157,344.55
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	1,157,344.55

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2025年08月19日（基金合同生效日）至2025年12月31日
1.交易性金融资产	5,762,642.10
——股票投资	5,762,642.10
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	249,560.01
——权证投资	-
——期货投资	249,560.01
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	6,012,202.11

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2025年08月19日（基金合同生效日）至2025年12月31日
基金赎回费收入	2,378.53
基金转换费收入	-
合计	2,378.53

7.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内未发生信用减值损失。

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025年08月19日（基金合同生效日）至2025年12月31日
审计费用	40,000.00
信息披露费	-
证券出借违约金	-
开户费	800.00
存托服务费	0.62
合计	40,800.62

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
天弘基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
中信银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
蚂蚁科技集团股份有限公司	基金管理人的控股股东
内蒙古君正能源化工集团股份有限公司	基金管理人的股东
天津信托有限责任公司	基金管理人的股东
芜湖高新投资有限公司	基金管理人的股东
新疆天阜恒基股权投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
新疆天惠新盟股权投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东

新疆天聚宸兴股权投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
新疆天瑞博丰股权投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
天弘创新资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025年08月19日（基金合同生效日）至2025年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	794,261.54
其中：应支付销售机构的客户维护费	371,375.61
应支付基金管理人的净管理费	422,885.93

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0.80%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日管理人报酬=前一日基金资产净值×该日适用费率/当年天数。

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

7.4.10.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期
	2025年08月19日(基金合同生效日)至2025年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	99,282.73

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

7.4.10.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2025年08月19日(基金合同生效日)至2025年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	天弘沪深300指数量化增强A	天弘沪深300指数量化增强C	合计
天弘基金管理有限公司	-	317.82	317.82
中信银行股份有限公司	-	159,190.25	159,190.25
合计	-	159,508.07	159,508.07

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指数量化增强C的销售服务费率为0.40%。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指数量化增强A不收取销售服务费。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行过银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期末未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

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

本基金本报告期末未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

天弘沪深300指数量化增强A

本报告期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指数量化增强C

本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年08月19日（基金合同生效日）至2025年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中信银行	50,039.31	1,325.46

股份有限 公司		
------------	--	--

注：本基金由基金托管人中信银行股份有限公司保管的银行存款，按银行同业利率或约定利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期未在承销期内参与关联方承销证券交易。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况--固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期无利润分配事项。

7.4.12 期末（2025年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688795	摩尔线程	2025-11-26	9个月	新股流通受限	114.28	416.02	542	61,939.76	225,482.84	-
688783	西安奕材	2025-10-20	9个月	新股流通受限	8.62	18.39	10,805	93,139.10	198,703.95	-
688802	沐曦股份	2025-12-09	9个月	新股流通受限	104.66	399.40	366	38,305.56	146,180.40	-
688790	昂瑞微	2025-12-09	9个月	新股流通受限	83.06	117.07	435	36,131.10	50,925.45	-
6887	禾元	2025-	6个	新股	29.06	52.62	950	27,60	49,98	-

65	生物	10-16	月	流通受限				7.00	9.00	
688759	必贝特	2025-10-21	6个月	新股流通受限	17.78	25.11	1,240	22,047.20	31,136.40	-
001280	中国铀业	2025-11-25	6个月	新股流通受限	17.89	45.36	577	10,322.53	26,172.72	-
001386	马可波罗	2025-10-15	6个月	新股流通受限	13.75	18.53	717	9,858.75	13,286.01	-
688727	恒坤新材	2025-11-11	6个月	新股流通受限	14.99	34.87	269	4,032.31	9,380.03	-
688809	C强一	2025-12-23	6个月	新股流通受限	85.09	203.31	46	3,914.14	9,352.26	-
688807	优迅股份	2025-12-10	6个月	新股流通受限	51.66	135.56	57	2,944.62	7,726.92	-
603175	超颖电子	2025-10-17	6个月	新股流通受限	17.08	48.56	149	2,544.92	7,235.44	-
688796	百奥赛图	2025-12-02	6个月	新股流通受限	26.68	42.25	138	3,681.84	5,830.50	-
001233	海安集团	2025-11-18	6个月	新股流通受限	48.00	51.88	101	4,848.00	5,239.88	-
688805	健信超导	2025-12-17	6个月	新股流通受限	18.58	32.37	157	2,917.06	5,082.09	-
6030	德力	2025-	6个	新股	46.68	55.66	56	2,61	3,11	-

92	佳	10-30	月	流通受限				4.08	6.96	
603376	大明电子	2025-10-28	6个月	新股流通受限	12.55	26.21	111	1,393.05	2,909.31	-
603334	丰倍生物	2025-10-29	6个月	新股流通受限	24.49	32.82	85	2,081.65	2,789.70	-
603248	锡华科技	2025-12-16	6个月	新股流通受限	10.10	16.30	130	1,313.00	2,119.00	-

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

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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
002049	紫光国微	2025-12-30	重大事项	78.81	2026-01-15	86.69	8,400	644,233.79	662,004.00	-
688012	中微公司	2025-12-19	重大事项	283.75	2026-01-05	278.00	2,605	651,320.87	739,168.75	-

注：本基金截至2025年12月31日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2025年12月31日，本基金未持有银行间市场债券正回购交易中作为质押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2025年12月31日，本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为质押的债券。

7.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金管理人按照“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。

7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款和定期存款存放在本基金的托管人中信银行股份有限公司及其他具有基金托管资格的国有银行和大型股份制银行，并实施不同区间的额度管理，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，本基金以非约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司出借证券，本基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近1年的分类结果为A类，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

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

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末未持有短期信用评级的债券。

7.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末未持有短期信用评级的资产支持证券。

7.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末未持有短期信用评级的同业存单。

7.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末未持有长期信用评级的债券。

7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末未持有长期信用评级的资产支持证券。

7.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末未持有长期信用评级的同业存单。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

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。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市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7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投

资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。本期末，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合法律法规的相关要求。

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

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

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	15,882,890.10	-	-	-	15,882,890.10

结算备付金	4,705,138.29	-	-	-	4,705,138.29
存出保证金	-	-	-	1,162,929.60	1,162,929.60
交易性金融资产	-	-	-	170,765,346.93	170,765,346.93
买入返售金融资产	-976.38	-	-	-	-976.38
应收申购款	-	-	-	720,400.35	720,400.35
资产总计	20,587,052.01	-	-	172,648,676.88	193,235,728.89
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,497,337.68	2,497,337.68
应付管理人报酬	-	-	-	117,806.51	117,806.51
应付托管费	-	-	-	14,725.84	14,725.84
应付销售服务费	-	-	-	52,473.76	52,473.76
应交税费	-	-	-	3,510.71	3,510.71
其他负债	-	-	-	40,084.00	40,084.00
负债总计	-	-	-	2,725,938.50	2,725,938.50
利率敏感度缺口	20,587,052.01	-	-	169,922,738.38	190,509,790.39

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金采用指数增强型投资策略，以沪深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80%，其中投资于港股通标的股票比例占股票资产的0%-50%，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国债期货、股指期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	170,765,346.93	89.64
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	170,765,346.93	89.64

注：1、其他包含在期货交易所交易的期货投资(附注7.4.7.3)。在当日无负债结算制度下，期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为0。

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。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）
		本期末

		2025年12月31日
	业绩比较基准上升5%	9,911,339.73
	业绩比较基准下降5%	-9,911,339.73

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2025年12月31日
第一层次	168,561,515.32
第二层次	1,401,172.75
第三层次	802,658.86
合计	170,765,346.93

7.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2025年08月19日（基金合同生效日）至2025年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	-	-
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	331,635.67	331,635.67
转出第三层次	-	-	-
当期利得或损失总额	-	471,023.19	471,023.19
其中：计入损益的利得或损失	-	471,023.19	471,023.19
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	802,658.86	802,658.86
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	471,023.19	471,023.19

注：于2025年12月31日，本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

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

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股票投资	802,658.86	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	0.8285~2.9588	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2025年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

7.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

7.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	170,765,346.93	88.37
	其中：股票	170,765,346.93	88.37
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	-976.38	0.00
	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	20,588,028.39	10.65
8	其他各项资产	1,883,329.95	0.97
9	合计	193,235,728.89	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例
----	------	---------	-----------

			(%)
A	农、林、牧、渔业	1,495,816.00	0.79
B	采矿业	9,932,745.60	5.21
C	制造业	79,868,117.70	41.92
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,043,244.00	2.12
E	建筑业	2,757,130.00	1.45
F	批发和零售业	24,337.00	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	4,156,674.02	2.18
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,347,907.00	3.33
J	金融业	36,514,644.50	19.17
K	房地产业	831,415.00	0.44
L	租赁和商务服务业	1,670,463.00	0.88
M	科学研究和技术服务业	2,320,387.00	1.22
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	2,196.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	3,276.00	0.00
S	综合	-	-
	合计	149,968,352.82	78.72

8.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	2,665.00	0.00
B	采矿业	726,034.72	0.38
C	制造业	16,319,697.89	8.57

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	204,780.00	0.11
E	建筑业	63,379.00	0.03
F	批发和零售业	434,802.00	0.23
G	交通运输、仓储和邮政业	368,356.00	0.19
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,539,113.00	0.81
J	金融业	570,313.00	0.30
K	房地产业	341,802.00	0.18
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	184,651.50	0.10
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	41,400.00	0.02
S	综合	-	-
	合计	20,796,994.11	10.92

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

8.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300750	宁德时代	16,900	6,206,694.00	3.26
2	600519	贵州茅台	3,900	5,371,002.00	2.82
3	601318	中国平安	75,600	5,171,040.00	2.71
4	601899	紫金矿业	120,900	4,167,423.00	2.19

5	300308	中际旭创	6,700	4,087,000.00	2.15
6	600036	招商银行	85,400	3,595,340.00	1.89
7	000333	美的集团	36,800	2,875,920.00	1.51
8	601166	兴业银行	128,100	2,697,786.00	1.42
9	300502	新易盛	5,800	2,499,104.00	1.31
10	600030	中信证券	75,450	2,166,169.50	1.14
11	002475	立讯精密	37,600	2,132,296.00	1.12
12	600276	恒瑞医药	34,500	2,055,165.00	1.08
13	601138	工业富联	31,800	1,973,190.00	1.04
14	688981	中芯国际	15,897	1,952,628.51	1.02
15	600900	长江电力	68,700	1,867,953.00	0.98
16	603259	药明康德	19,800	1,794,672.00	0.94
17	002594	比亚迪	18,200	1,778,504.00	0.93
18	601398	工商银行	207,600	1,646,268.00	0.86
19	601328	交通银行	223,800	1,622,550.00	0.85
20	300059	东方财富	69,500	1,611,010.00	0.85
21	601211	国泰海通	77,900	1,600,845.00	0.84
22	300274	阳光电源	8,800	1,505,152.00	0.79
23	688041	海光信息	6,644	1,490,980.04	0.78
24	600887	伊利股份	51,900	1,484,340.00	0.78
25	688256	寒武纪	1,000	1,355,550.00	0.71
26	600150	中国船舶	40,000	1,330,400.00	0.70
27	000725	京东方 A	308,800	1,300,048.00	0.68
28	300476	胜宏科技	4,300	1,236,594.00	0.65
29	002714	牧原股份	24,000	1,213,920.00	0.64
30	688008	澜起科技	10,253	1,207,803.40	0.63
31	601816	京沪高铁	225,600	1,161,840.00	0.61
32	600031	三一重工	54,500	1,151,585.00	0.60
33	600000	浦发银行	91,500	1,138,260.00	0.60
34	601288	农业银行	146,000	1,121,280.00	0.59
35	002415	海康威视	35,600	1,062,304.00	0.56

36	000425	徐工机械	91,200	1,056,096.00	0.55
37	603993	洛阳钼业	52,400	1,048,000.00	0.55
38	000651	格力电器	25,800	1,037,676.00	0.54
39	601601	中国太保	24,500	1,026,795.00	0.54
40	000858	五粮液	9,600	1,017,024.00	0.53
41	601668	中国建筑	196,500	1,008,045.00	0.53
42	603501	豪威集团	8,000	1,007,200.00	0.53
43	002142	宁波银行	34,900	980,341.00	0.51
44	600028	中国石化	157,600	973,968.00	0.51
45	601919	中远海控	64,100	973,038.00	0.51
46	000338	潍柴动力	54,900	944,280.00	0.50
47	000100	TCL科技	207,300	941,142.00	0.49
48	600690	海尔智家	35,300	920,977.00	0.48
49	601229	上海银行	91,000	919,100.00	0.48
50	002371	北方华创	2,000	918,160.00	0.48
51	601728	中国电信	145,000	913,500.00	0.48
52	601857	中国石油	86,500	900,465.00	0.47
53	603799	华友钴业	13,000	887,380.00	0.47
54	601988	中国银行	151,000	865,230.00	0.45
55	600050	中国联通	165,100	843,661.00	0.44
56	601225	陕西煤业	38,100	812,292.00	0.43
57	688111	金山办公	2,600	798,382.00	0.42
58	603019	中科曙光	9,300	796,452.00	0.42
59	600919	江苏银行	76,400	794,560.00	0.42
60	002027	分众传媒	106,700	786,379.00	0.41
61	600019	宝钢股份	104,200	776,290.00	0.41
62	000063	中兴通讯	20,200	764,368.00	0.40
63	601818	光大银行	218,700	763,263.00	0.40
64	002463	沪电股份	10,400	759,928.00	0.40
65	688012	中微公司	2,605	739,168.75	0.39
66	300124	汇川技术	9,600	723,168.00	0.38

67	601688	华泰证券	29,300	691,187.00	0.36
68	600111	北方稀土	14,800	682,576.00	0.36
69	600160	巨化股份	17,700	680,034.00	0.36
70	300760	迈瑞医疗	3,501	666,765.45	0.35
71	002049	紫光国微	8,400	662,004.00	0.35
72	600989	宝丰能源	33,700	661,531.00	0.35
73	601088	中国神华	16,300	660,150.00	0.35
74	600415	小商品城	41,200	657,140.00	0.34
75	600438	通威股份	31,900	654,588.00	0.34
76	601628	中国人寿	14,300	650,650.00	0.34
77	600309	万华化学	8,300	636,444.00	0.33
78	601390	中国中铁	117,600	636,216.00	0.33
79	000166	申万宏源	120,700	636,089.00	0.33
80	603986	兆易创新	2,900	621,325.00	0.33
81	600958	东方证券	56,100	611,490.00	0.32
82	688271	联影医疗	4,848	608,424.00	0.32
83	002074	国轩高科	15,500	606,205.00	0.32
84	000157	中联重科	69,200	597,196.00	0.31
85	601066	中信建投	21,600	578,232.00	0.30
86	601600	中国铝业	45,300	553,566.00	0.29
87	001979	招商蛇口	63,300	546,912.00	0.29
88	600372	中航机载	40,300	540,826.00	0.28
89	000792	盐湖股份	19,200	540,672.00	0.28
90	600183	生益科技	7,500	535,575.00	0.28
91	601825	沪农商行	56,800	527,672.00	0.28
92	600941	中国移动	5,000	505,250.00	0.27
93	002600	领益智造	32,500	505,050.00	0.27
94	000001	平安银行	43,500	496,335.00	0.26
95	601877	正泰电器	17,700	493,653.00	0.26
96	601618	中国中冶	157,600	468,072.00	0.25
97	600188	兖矿能源	34,700	456,305.00	0.24

98	000708	中信特钢	27,700	453,449.00	0.24
99	000568	泸州老窖	3,900	453,258.00	0.24
100	600803	新奥股份	21,800	452,568.00	0.24
101	300033	同花顺	1,400	451,052.00	0.24
102	601995	中金公司	12,600	441,000.00	0.23
103	300759	康龙化成	15,500	440,665.00	0.23
104	002230	科大讯飞	8,700	437,523.00	0.23
105	301236	软通动力	9,200	436,356.00	0.23
106	600938	中国海油	14,400	434,592.00	0.23
107	002304	洋河股份	7,100	431,254.00	0.23
108	600029	南方航空	53,500	428,535.00	0.22
109	601009	南京银行	36,800	420,624.00	0.22
110	600089	特变电工	18,800	417,736.00	0.22
111	600406	国电南瑞	18,500	415,880.00	0.22
112	002384	东山精密	4,900	414,785.00	0.22
113	300628	亿联网络	11,600	413,540.00	0.22
114	300442	润泽科技	7,800	411,840.00	0.22
115	002050	三花智控	7,400	409,294.00	0.21
116	601012	隆基绿能	22,300	405,860.00	0.21
117	600741	华域汽车	19,900	398,000.00	0.21
118	600584	长电科技	10,200	375,156.00	0.20
119	601006	大秦铁路	71,800	370,488.00	0.19
120	600104	上汽集团	23,700	360,714.00	0.19
121	000768	中航西飞	14,200	360,396.00	0.19
122	600585	海螺水泥	15,800	345,388.00	0.18
123	600660	福耀玻璃	5,300	343,281.00	0.18
124	600346	恒力石化	15,000	337,950.00	0.18
125	601916	浙商银行	110,800	336,832.00	0.18
126	600905	三峡能源	80,200	328,018.00	0.17
127	600999	招商证券	19,700	327,808.00	0.17
128	600547	山东黄金	8,300	321,293.00	0.17

129	601298	青岛港	38,200	318,588.00	0.17
130	000538	云南白药	5,600	317,856.00	0.17
131	600926	杭州银行	20,700	316,296.00	0.17
132	601127	赛力斯	2,600	314,496.00	0.17
133	001965	招商公路	30,669	309,143.52	0.16
134	601336	新华保险	4,400	306,680.00	0.16
135	002916	深南电路	1,300	301,977.00	0.16
136	600027	华电国际	60,100	298,096.00	0.16
137	600016	民生银行	77,600	297,208.00	0.16
138	600011	华能国际	39,200	292,432.00	0.15
139	600048	保利发展	46,400	283,040.00	0.15
140	300498	温氏股份	16,700	281,896.00	0.15
141	002352	顺丰控股	7,100	272,072.00	0.14
142	002028	思源电气	1,700	262,803.00	0.14
143	601186	中国铁建	33,400	256,178.00	0.13
144	300394	天孚通信	1,200	243,636.00	0.13
145	002601	龙佰集团	12,400	242,792.00	0.13
146	688506	百利天恒	748	241,678.80	0.13
147	600176	中国巨石	13,900	237,690.00	0.12
148	600482	中国动力	11,300	233,910.00	0.12
149	002241	歌尔股份	8,100	232,713.00	0.12
150	002493	荣盛石化	19,700	230,687.00	0.12
151	601888	中国中免	2,400	226,944.00	0.12
152	603288	海天味业	6,100	225,822.00	0.12
153	601901	方正证券	28,900	225,420.00	0.12
154	601766	中国中车	32,000	218,240.00	0.11
155	300014	亿纬锂能	3,300	217,008.00	0.11
156	605499	东鹏饮料	800	213,912.00	0.11
157	601169	北京银行	37,300	204,404.00	0.11
158	600600	青岛啤酒	3,300	201,960.00	0.11
159	688126	沪硅产业	9,262	200,429.68	0.11

160	601058	赛轮轮胎	11,700	189,306.00	0.10
161	600809	山西汾酒	1,100	188,870.00	0.10
162	600886	国投电力	14,200	186,304.00	0.10
163	601788	光大证券	10,600	186,030.00	0.10
164	003816	中国广核	47,500	178,600.00	0.09
165	601319	中国人保	19,900	178,105.00	0.09
166	601939	建设银行	19,100	177,248.00	0.09
167	002625	光启技术	3,600	175,536.00	0.09
168	600023	浙能电力	33,900	167,805.00	0.09
169	600196	复星医药	6,300	166,887.00	0.09
170	601360	三六零	14,600	163,082.00	0.09
171	002736	国信证券	12,400	162,688.00	0.09
172	000776	广发证券	7,300	160,746.00	0.08
173	601117	中国化学	21,000	158,130.00	0.08
174	002460	赣锋锂业	2,500	157,225.00	0.08
175	600522	中天科技	8,600	155,832.00	0.08
176	601689	拓普集团	2,000	154,360.00	0.08
177	601800	中国交建	18,100	149,144.00	0.08
178	000408	藏格矿业	1,700	143,480.00	0.08
179	601021	春秋航空	2,401	142,859.50	0.07
180	601881	中国银河	8,900	139,908.00	0.07
181	601985	中国核电	16,100	139,265.00	0.07
182	600219	南山铝业	24,300	130,734.00	0.07
183	688223	晶科能源	20,611	116,246.04	0.06
184	000977	浪潮信息	1,700	113,220.00	0.06
185	601111	中国国航	12,000	112,440.00	0.06
186	600489	中金黄金	4,685	109,441.60	0.06
187	603296	华勤技术	1,200	108,888.00	0.06
188	002311	海大集团	1,950	107,991.00	0.06
189	603893	瑞芯微	600	106,968.00	0.06
190	688082	盛美上海	600	105,630.00	0.06

191	300408	三环集团	2,200	100,650.00	0.05
192	600015	华夏银行	14,400	98,928.00	0.05
193	000807	云铝股份	2,600	85,384.00	0.04
194	300347	泰格医药	1,500	85,050.00	0.04
195	600025	华能水电	8,900	80,812.00	0.04
196	600039	四川路桥	8,000	79,600.00	0.04
197	300803	指南针	600	78,522.00	0.04
198	600893	航发动力	1,900	76,057.00	0.04
199	002709	天赐材料	1,600	74,128.00	0.04
200	002920	德赛西威	600	72,180.00	0.04
201	002938	鹏鼎控股	1,400	70,812.00	0.04
202	601100	恒立液压	600	65,946.00	0.03
203	601658	邮储银行	10,800	58,860.00	0.03
204	002466	天齐锂业	1,000	55,380.00	0.03
205	000625	长安汽车	4,500	53,370.00	0.03
206	600436	片仔癀	300	50,634.00	0.03
207	601633	长城汽车	2,200	49,786.00	0.03
208	300433	蓝思科技	1,500	45,405.00	0.02
209	688009	中国通号	8,106	44,339.82	0.02
210	600233	圆通速递	2,700	44,334.00	0.02
211	301269	华大九天	400	42,532.00	0.02
212	688396	华润微	800	42,288.00	0.02
213	300979	华利集团	800	40,168.00	0.02
214	600674	川投能源	2,800	38,920.00	0.02
215	000895	双汇发展	1,300	34,411.00	0.02
216	300866	安克创新	300	34,317.00	0.02
217	601898	中煤能源	2,700	33,588.00	0.02
218	600760	中航沈飞	500	28,075.00	0.01
219	000661	长春高新	300	27,765.00	0.01
220	688036	传音控股	400	26,464.00	0.01
221	688047	龙芯中科	200	26,422.00	0.01

222	302132	中航成飞	300	23,700.00	0.01
223	600010	包钢股份	9,900	23,562.00	0.01
224	688303	大全能源	800	21,456.00	0.01
225	300661	圣邦股份	305	20,935.20	0.01
226	000630	铜陵有色	3,400	20,434.00	0.01
227	300832	新产业	300	16,875.00	0.01
228	688472	阿特斯	1,111	16,565.01	0.01
229	300782	卓胜微	200	16,296.00	0.01
230	300316	晶盛机电	400	14,700.00	0.01
231	300896	爱美客	100	14,172.00	0.01
232	603392	万泰生物	300	13,482.00	0.01
233	600061	国投资本	1,700	13,005.00	0.01
234	002001	新和成	500	12,595.00	0.01
235	601607	上海医药	700	12,502.00	0.01
236	603195	公牛集团	300	12,249.00	0.01
237	000963	华东医药	300	11,835.00	0.01
238	600795	国电电力	2,100	10,584.00	0.01
239	603260	合盛硅业	200	10,540.00	0.01
240	688187	时代电气	200	10,258.00	0.01
241	000975	山金国际	400	9,732.00	0.01
242	600085	同仁堂	300	9,678.00	0.01
243	300999	金龙鱼	300	8,622.00	0.00
244	300418	昆仑万维	200	8,340.00	0.00
245	000786	北新建材	300	7,491.00	0.00
246	000938	紫光股份	300	7,380.00	0.00
247	603369	今世缘	200	6,956.00	0.00
248	600009	上海机场	200	6,552.00	0.00
249	600066	宇通客车	200	6,540.00	0.00
250	600426	华鲁恒升	200	6,286.00	0.00
251	600845	宝信软件	300	6,213.00	0.00
252	600570	恒生电子	200	6,030.00	0.00

253	002422	科伦药业	200	5,870.00	0.00
254	000999	华润三九	200	5,692.00	0.00
255	000876	新希望	600	5,532.00	0.00
256	600875	东方电气	200	4,856.00	0.00
257	002459	晶澳科技	400	4,580.00	0.00
258	600018	上港集团	800	4,336.00	0.00
259	601808	中海油服	300	4,212.00	0.00
260	002236	大华股份	200	3,788.00	0.00
261	601136	首创证券	200	3,758.00	0.00
262	601377	兴业证券	500	3,710.00	0.00
263	002179	中航光电	100	3,544.00	0.00
264	601059	信达证券	200	3,542.00	0.00
265	600026	中远海能	300	3,504.00	0.00
266	300251	光线传媒	200	3,276.00	0.00
267	000617	中油资本	300	2,880.00	0.00
268	600460	士兰微	100	2,841.00	0.00
269	601872	招商轮船	300	2,694.00	0.00
270	002252	上海莱士	400	2,536.00	0.00
271	601236	红塔证券	300	2,457.00	0.00
272	601238	广汽集团	300	2,448.00	0.00
273	300413	芒果超媒	100	2,442.00	0.00
274	600377	宁沪高速	200	2,422.00	0.00
275	300015	爱尔眼科	200	2,196.00	0.00
276	601878	浙商证券	200	2,162.00	0.00
277	600930	华电新能	300	1,887.00	0.00
277	300122	智飞生物	100	1,887.00	0.00
278	001391	国货航	300	1,776.00	0.00
279	002648	卫星化学	100	1,768.00	0.00
280	600161	天坛生物	100	1,634.00	0.00
281	601838	成都银行	100	1,612.00	0.00
282	601018	宁波港	400	1,452.00	0.00

283	600588	用友网络	100	1,326.00	0.00
284	000983	山西焦煤	200	1,284.00	0.00
285	000301	东方盛虹	100	1,089.00	0.00
286	601669	中国电建	200	1,040.00	0.00
287	601456	国联民生	100	1,017.00	0.00
288	000002	万科A	200	930.00	0.00
289	601868	中国能建	300	705.00	0.00
290	600918	中泰证券	100	650.00	0.00
291	600115	中国东航	100	600.00	0.00
292	600515	海南机场	100	533.00	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300373	扬杰科技	5,100	346,800.00	0.18
2	300735	光弘科技	13,500	335,610.00	0.18
3	000733	振华科技	6,400	335,424.00	0.18
4	603816	顾家家居	10,900	335,066.00	0.18
5	300496	中科创达	4,900	330,750.00	0.17
6	002085	万丰奥威	20,600	329,806.00	0.17
7	002841	视源股份	8,300	328,929.00	0.17
8	600352	浙江龙盛	30,700	327,262.00	0.17
9	300003	乐普医疗	20,300	320,943.00	0.17
10	603565	中谷物流	31,700	318,268.00	0.17
11	603606	东方电缆	5,300	316,675.00	0.17
12	600392	盛和资源	14,700	316,491.00	0.17
13	688100	威胜信息	8,000	314,400.00	0.17
14	300763	锦浪科技	4,400	314,204.00	0.16
15	603179	新泉股份	4,200	310,296.00	0.16

16	002156	通富微电	8,200	309,140.00	0.16
17	688349	三一重能	12,100	305,888.00	0.16
18	600901	江苏金租	49,500	302,940.00	0.16
19	688027	国盾量子	600	302,274.00	0.16
20	600131	国网信通	18,500	298,590.00	0.16
21	601168	西部矿业	10,800	298,512.00	0.16
22	002414	高德红外	20,200	296,334.00	0.16
23	601865	福莱特	18,800	294,596.00	0.15
24	688772	珠海冠宇	13,400	288,502.00	0.15
25	600208	衢州发展	74,400	287,928.00	0.15
26	600435	北方导航	18,200	280,644.00	0.15
27	600132	重庆啤酒	5,300	276,872.00	0.15
28	600739	辽宁成大	24,600	275,028.00	0.14
29	688065	凯赛生物	5,400	268,920.00	0.14
30	600497	驰宏锌锗	35,000	255,850.00	0.13
31	002312	川发龙蟒	22,100	241,553.00	0.13
32	002078	太阳纸业	15,300	240,975.00	0.13
33	688795	摩尔线程	542	225,482.84	0.12
34	601799	星宇股份	1,800	222,066.00	0.12
35	600166	福田汽车	73,900	215,788.00	0.11
36	600361	创新新材	49,000	207,760.00	0.11
37	601608	中信重工	30,900	203,631.00	0.11
38	600988	赤峰黄金	6,500	203,060.00	0.11
39	600398	海澜之家	33,400	202,070.00	0.11
40	300474	景嘉微	2,800	201,236.00	0.11
41	688783	西安奕材	10,805	198,703.95	0.10
42	600177	雅戈尔	26,100	198,360.00	0.10
43	002410	广联达	15,700	197,506.00	0.10
44	601958	金钼股份	12,500	194,750.00	0.10
45	002756	永兴材料	3,500	189,875.00	0.10
46	600096	云天化	5,600	187,096.00	0.10

47	002185	华天科技	16,900	185,393.00	0.10
48	688561	奇安信	5,200	185,016.00	0.10
49	000528	柳工	15,500	183,985.00	0.10
50	301358	湖南裕能	2,800	181,048.00	0.10
51	300699	光威复材	4,500	177,570.00	0.09
52	601577	长沙银行	18,100	175,570.00	0.09
53	002203	海亮股份	13,500	170,910.00	0.09
54	689009	九号公司	3,000	166,770.00	0.09
55	300748	金力永磁	4,800	163,728.00	0.09
56	688297	中无人机	3,400	163,268.00	0.09
57	688248	南网科技	3,400	152,116.00	0.08
58	603659	璞泰来	5,400	147,636.00	0.08
59	002056	横店东磁	7,500	146,250.00	0.08
60	688802	沐曦股份	366	146,180.40	0.08
61	600486	扬农化工	2,100	145,719.00	0.08
62	688385	复旦微电	1,904	140,324.80	0.07
63	000893	亚钾国际	2,900	139,113.00	0.07
64	002138	顺络电子	3,900	138,567.00	0.07
65	603833	欧派家居	2,600	135,434.00	0.07
66	688387	信科移动	10,277	132,573.30	0.07
67	002436	兴森科技	6,200	131,254.00	0.07
68	603486	科沃斯	1,600	129,088.00	0.07
69	002508	老板电器	6,600	127,710.00	0.07
70	603233	大参林	6,700	118,054.00	0.06
71	601615	明阳智能	8,100	117,288.00	0.06
72	600487	亨通光电	4,700	116,231.00	0.06
73	000831	中国稀土	2,400	111,456.00	0.06
74	000050	深天马A	12,100	109,263.00	0.06
75	688188	柏楚电子	800	108,712.00	0.06
76	688728	格科微	7,120	106,372.80	0.06
77	002372	伟星新材	9,900	103,257.00	0.05

78	000400	许继电气	3,900	100,269.00	0.05
79	002281	光迅科技	1,400	97,930.00	0.05
80	000921	海信家电	3,900	96,759.00	0.05
81	002261	拓维信息	2,700	89,370.00	0.05
82	600060	海信视像	3,600	87,408.00	0.05
83	603160	汇顶科技	1,100	86,900.00	0.05
84	600685	中船防务	3,000	85,350.00	0.04
85	603341	龙旗科技	2,000	84,520.00	0.04
86	605358	立昂微	2,400	83,568.00	0.04
87	688819	天能股份	2,500	83,050.00	0.04
88	300677	英科医疗	2,100	81,690.00	0.04
89	688002	睿创微纳	800	80,640.00	0.04
90	601991	大唐发电	22,200	77,478.00	0.04
91	301308	江波龙	300	73,452.00	0.04
92	300017	网宿科技	6,600	67,650.00	0.04
93	688213	思特威	700	66,563.00	0.03
94	688072	拓荆科技	200	66,000.00	0.03
95	002271	东方雨虹	4,700	63,873.00	0.03
96	600970	中材国际	6,100	63,379.00	0.03
97	001286	陕西能源	6,600	61,446.00	0.03
98	600298	安琪酵母	1,400	61,236.00	0.03
99	600378	昊华科技	1,800	57,528.00	0.03
100	600873	梅花生物	5,300	53,689.00	0.03
101	000723	美锦能源	11,400	53,580.00	0.03
102	688099	晶晨股份	600	52,338.00	0.03
103	688692	达梦数据	200	52,254.00	0.03
104	603899	晨光股份	1,900	51,414.00	0.03
105	688790	昂瑞微	435	50,925.45	0.03
106	688765	禾元生物	950	49,989.00	0.03
107	688617	惠泰医疗	200	48,654.00	0.03
108	600765	中航重机	2,400	45,984.00	0.02

109	601555	东吴证券	5,000	45,300.00	0.02
110	688122	西部超导	600	44,748.00	0.02
111	002244	滨江集团	4,300	43,215.00	0.02
112	688220	翱捷科技	500	41,305.00	0.02
113	300001	特锐德	1,600	41,088.00	0.02
114	688301	奕瑞科技	400	40,444.00	0.02
115	002294	信立泰	800	39,640.00	0.02
116	688017	绿的谐波	200	38,420.00	0.02
117	600998	九州通	7,300	37,376.00	0.02
118	603379	三美股份	600	36,432.00	0.02
119	301536	星宸科技	600	35,946.00	0.02
120	000951	中国重汽	2,100	35,490.00	0.02
121	002558	巨人网络	800	34,632.00	0.02
122	688759	必贝特	1,240	31,136.40	0.02
123	603529	爱玛科技	1,000	29,700.00	0.02
124	002603	以岭药业	1,700	29,019.00	0.02
125	688702	盛科通信	200	28,338.00	0.01
126	000429	粤高速 A	2,400	28,272.00	0.01
127	688375	国博电子	300	27,933.00	0.01
128	002821	凯莱英	300	27,879.00	0.01
129	688521	芯原股份	200	27,394.00	0.01
130	603605	珀莱雅	400	27,392.00	0.01
131	688295	中复神鹰	832	27,297.92	0.01
132	001280	中国铀业	577	26,172.72	0.01
133	002738	中矿资源	300	23,565.00	0.01
134	688525	佰维存储	200	22,958.00	0.01
135	600863	内蒙华电	5,100	22,848.00	0.01
136	000729	燕京啤酒	2,000	22,460.00	0.01
137	601598	中国外运	3,600	21,816.00	0.01
138	601108	财通证券	2,500	21,800.00	0.01
139	600032	浙江新能	2,900	21,489.00	0.01

140	300573	兴齐眼药	300	21,087.00	0.01
141	601928	凤凰传媒	2,100	21,084.00	0.01
142	688578	艾力斯	200	20,830.00	0.01
143	600363	联创光电	300	18,918.00	0.01
144	300073	当升科技	300	17,340.00	0.01
145	000598	兴蓉环境	2,300	16,491.00	0.01
146	688778	厦钨新能	200	15,474.00	0.01
147	300450	先导智能	300	14,994.00	0.01
148	000738	航发控制	700	14,917.00	0.01
149	300558	贝达药业	300	14,007.00	0.01
150	300627	华测导航	400	13,964.00	0.01
151	001386	马可波罗	717	13,286.01	0.01
152	300012	华测检测	900	12,195.00	0.01
153	688475	萤石网络	400	12,044.00	0.01
154	002773	康弘药业	400	11,988.00	0.01
155	300144	宋城演艺	1,400	11,466.00	0.01
156	002837	英维克	100	10,689.00	0.01
157	002130	沃尔核材	400	10,528.00	0.01
158	300207	欣旺达	400	10,460.00	0.01
159	300679	电连技术	200	9,736.00	0.01
160	688727	恒坤新材	269	9,380.03	0.00
161	688809	C强一	46	9,352.26	0.00
162	300919	中伟股份	200	9,266.00	0.00
163	300676	华大基因	200	9,072.00	0.00
164	600282	南钢股份	1,700	8,942.00	0.00
165	688363	华熙生物	200	8,736.00	0.00
166	605589	圣泉集团	300	8,490.00	0.00
167	300458	全志科技	200	8,406.00	0.00
168	002008	大族激光	200	8,238.00	0.00
169	600549	厦门钨业	200	8,212.00	0.00
170	600927	永安期货	500	8,035.00	0.00

171	000988	华工科技	100	7,933.00	0.00
172	300957	贝泰妮	200	7,922.00	0.00
173	603786	科博达	100	7,810.00	0.00
174	688807	优迅股份	57	7,726.92	0.00
175	688153	唯捷创芯	200	7,528.00	0.00
176	600867	通化东宝	900	7,353.00	0.00
177	002080	中材科技	200	7,268.00	0.00
178	603175	超颖电子	149	7,235.44	0.00
179	600038	中直股份	200	7,226.00	0.00
180	600316	洪都航空	200	6,982.00	0.00
181	600312	平高电气	400	6,940.00	0.00
182	000878	云南铜业	300	6,153.00	0.00
183	600885	宏发股份	200	6,080.00	0.00
184	601019	山东出版	700	6,048.00	0.00
185	603589	口子窖	200	6,010.00	0.00
186	600007	中国国贸	300	5,946.00	0.00
187	000959	首钢股份	1,200	5,880.00	0.00
188	688796	百奥赛图	138	5,830.50	0.00
189	688599	天合光能	342	5,660.10	0.00
190	001233	海安集团	101	5,239.88	0.00
191	688805	健信超导	157	5,082.09	0.00
192	600995	南网储能	400	5,028.00	0.00
193	601965	中国汽研	300	4,980.00	0.00
194	000987	越秀资本	600	4,884.00	0.00
195	600862	中航高科	200	4,726.00	0.00
196	603858	步长制药	300	4,692.00	0.00
197	600535	天士力	300	4,521.00	0.00
198	002568	百润股份	200	4,362.00	0.00
199	603939	益丰药房	200	4,344.00	0.00
200	002202	金风科技	200	4,080.00	0.00
201	600143	金发科技	200	3,908.00	0.00

202	601699	潞安环能	300	3,540.00	0.00
203	603092	德力佳	56	3,116.96	0.00
204	601231	环旭电子	100	3,000.00	0.00
205	603376	大明电子	111	2,909.31	0.00
206	600373	中文传媒	300	2,802.00	0.00
207	603806	福斯特	200	2,792.00	0.00
208	600109	国金证券	300	2,790.00	0.00
209	603334	丰倍生物	85	2,789.70	0.00
210	600566	济川药业	100	2,630.00	0.00
211	600332	白云山	100	2,574.00	0.00
212	600517	国网英大	400	2,404.00	0.00
213	600663	陆家嘴	300	2,373.00	0.00
214	600848	上海临港	200	2,340.00	0.00
215	002064	华峰化学	200	2,200.00	0.00
216	603248	锡华科技	130	2,119.00	0.00
217	002461	珠江啤酒	200	1,858.00	0.00
218	601179	中国西电	200	1,820.00	0.00
219	000728	国元证券	200	1,670.00	0.00
220	688425	铁建重工	319	1,617.33	0.00
221	002945	华林证券	100	1,533.00	0.00
222	600598	北大荒	100	1,495.00	0.00
223	601118	海南橡胶	200	1,170.00	0.00
224	000932	华菱钢铁	200	1,124.00	0.00
225	600390	五矿资本	200	1,110.00	0.00
226	002926	华西证券	100	928.00	0.00
227	002129	TCL中环	100	857.00	0.00
228	002340	格林美	100	836.00	0.00
229	002797	第一创业	100	687.00	0.00
230	603077	和邦生物	300	678.00	0.00
231	600155	华创云信	100	662.00	0.00
232	003035	南网能源	100	458.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	7,849,528.00	4.12
2	600519	贵州茅台	7,614,283.45	4.00
3	300750	宁德时代	7,459,133.00	3.92
4	600036	招商银行	7,139,833.00	3.75
5	000333	美的集团	5,557,161.00	2.92
6	601899	紫金矿业	5,444,854.00	2.86
7	002594	比亚迪	4,755,944.00	2.50
8	600276	恒瑞医药	4,667,261.00	2.45
9	601166	兴业银行	4,317,810.00	2.27
10	603259	药明康德	4,212,937.00	2.21
11	600000	浦发银行	4,169,623.00	2.19
12	601816	京沪高铁	3,622,235.00	1.90
13	300760	迈瑞医疗	3,599,112.98	1.89
14	601211	国泰海通	3,523,872.84	1.85
15	601601	中国太保	3,385,895.00	1.78
16	688256	寒武纪	3,099,939.02	1.63
17	601728	中国电信	3,096,679.00	1.63
18	688041	海光信息	3,055,287.59	1.60
19	601225	陕西煤业	3,028,980.00	1.59
20	300308	中际旭创	3,020,884.00	1.59

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

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	3,510,759.00	1.84
2	600036	招商银行	3,463,171.00	1.82
3	601899	紫金矿业	3,194,950.00	1.68
4	000333	美的集团	2,878,045.52	1.51
5	600000	浦发银行	2,813,783.00	1.48
6	601012	隆基绿能	2,755,125.00	1.45
7	002594	比亚迪	2,592,095.00	1.36
8	300750	宁德时代	2,544,175.00	1.34
9	300760	迈瑞医疗	2,533,483.00	1.33
10	601127	赛力斯	2,498,914.00	1.31
11	600276	恒瑞医药	2,459,809.80	1.29
12	601688	华泰证券	2,409,120.00	1.26
13	601816	京沪高铁	2,398,095.00	1.26
14	600016	民生银行	2,358,280.00	1.24
15	601601	中国太保	2,291,963.00	1.20
16	600406	国电南瑞	2,282,941.00	1.20
17	601360	三六零	2,269,241.00	1.19
18	000776	广发证券	2,192,953.00	1.15
19	002230	科大讯飞	2,164,692.50	1.14
20	601225	陕西煤业	2,134,230.00	1.12

注：本项的"卖出金额"均按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	487,904,665.75
卖出股票收入（成交）总额	328,918,604.50

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 本基金投资股指期货的投资政策

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

此外，本基金仅使用沪深300股指期货，并在计算股指期货年化升/贴水的基础上，优选对产品净值最有利的股指期货合约进行投资。本基金不进行投机，对冲等操作。

在申赎相对较少时，本基金可能不使用股指期货。

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

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券发行主体中，【兴业银行股份有限公司】于2025年12月05日收到国家金融监督管理总局出具公开处罚的通报；【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。

8.12.2 基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,162,929.60
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	720,400.35
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,883,329.95

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限情况。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票不存在流通受限情况。

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息**9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

份额 级别	持 有	户均持有的 基金份额	持有人结构	
			机构投资者	个人投资者

	人 户 数 (户)		持有份额	占 总 份 额 比 例	持有份额	占 总 份 额 比 例
天弘 沪深3 00指 数量 化增 强A	327	42,918.21	-	-	14,034,253.66	100.00%
天弘 沪深3 00指 数量 化增 强C	6,2 41	27,041.07	5,033,405.68	2.98%	163,729,890.88	97.02%
合计	6,5 26	28,010.66	5,033,405.68	2.75%	177,764,144.54	97.25%

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

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比 例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	天弘沪深300指数量 化增强A	126,695.40	0.90%
	天弘沪深300指数量 化增强C	-	-
	合计	126,695.40	0.07%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区 间（万份）
----	------	-----------------------

本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	天弘沪深300指数量化增强A	0
	天弘沪深300指数量化增强C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	天弘沪深300指数量化增强A	10~50
	天弘沪深300指数量化增强C	0
	合计	10~50

§10 开放式基金份额变动

单位：份

	天弘沪深300指数量化增强A	天弘沪深300指数量化增强C
基金合同生效日(2025年08月19日)基金份额总额	78,621,205.91	478,415,283.14
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	3,699,702.92	87,344,114.33
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	68,286,655.17	396,996,100.91
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	14,034,253.66	168,763,296.56

注：本基金合同于2025年08月19日生效。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，迟哲先生担任公司副总经理、首席信息官，刘荣逵先生不再担任公司首席信息官，具体信息请参见基金管理人在规定媒介披露的《天弘基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。

本报告期内，基金托管人中信银行股份有限公司发生以下重大人事变更：

2025年4月，经国家金融监督管理总局核准，芦苇先生正式就任中信银行行长。

2025年12月，芦苇先生因工作调整，辞去本行执行董事、行长、董事会风险管理委员会主席及委员、董事会战略与可持续发展委员会委员职务。同日，本行董事会审议通过由方合英先生代为履行行长职责。上述事项对中信银行公募基金业务无影响。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期内，中信银行股份有限公司托管业务未涉及基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略没有改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金应向毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）支付服务费40,000.00元。截至本报告期末，毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）已为本基金提供审计服务5个月。

11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人无受调查或处罚等情况。

11.6.2 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。

11.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期，基金托管人未受到调查或处罚。

11.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期，基金托管人分管公募基金托管业务的高级管理人员未受到调查或处罚。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
财通证券	3	815,981,157.64	100.00%	116,248.93	100.00%	-

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，确定选用交易席位的证券经营机构，再和被选用的证券经营机构签订经纪服务协议。

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
财通证券	148,364,402.84	100.00%	3,001,230,000.00	100.00%	-	-	-	-

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	天弘沪深300指数量化增强型证券投资基金基金份额发售公告	中国证监会规定媒介	2025-07-14
2	天弘沪深300指数量化增强型证券投资基金基金合同	中国证监会规定媒介	2025-07-14
3	天弘沪深300指数量化增强型证券投资基金托管协议	中国证监会规定媒介	2025-07-14

4	天弘沪深300指数量化增强型证券投资基金招募说明书	中国证监会规定媒介	2025-07-14
5	天弘沪深300指数量化增强型证券投资基金（A类份额）基金产品资料概要	中国证监会规定媒介	2025-07-14
6	天弘沪深300指数量化增强型证券投资基金（C类份额）基金产品资料概要	中国证监会规定媒介	2025-07-14
7	天弘沪深300指数量化增强型证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会规定媒介	2025-08-20
8	天弘沪深300指数量化增强型证券投资基金（A类份额）基金产品资料概要（更新）	中国证监会规定媒介	2025-08-21
9	天弘沪深300指数量化增强型证券投资基金（C类份额）基金产品资料概要（更新）	中国证监会规定媒介	2025-08-21
10	天弘基金管理有限公司关于天弘沪深300指数量化增强型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	中国证监会规定媒介	2025-09-01
11	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	2025-09-20
12	天弘基金管理有限公司关于终止方正中期期货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	2025-11-18
13	天弘基金管理有限公司关于旗下部分公募基金风险等级变动的通知	中国证监会规定媒介	2025-11-27
14	天弘基金管理有限公司关于变更客户服务电话号码的公告	中国证监会规定媒介	2025-11-28

	告		
15	天弘基金管理有限公司关于住所变更的公告	中国证监会规定媒介	2025-12-30
16	天弘基金管理有限公司关于旗下部分公募基金风险等级变动的通知	中国证监会规定媒介	2025-12-31

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

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

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，基金管理人决定自2025年12月1日起启用新客户服务电话号码400-986-8888。原客户服务电话号码95046自2026年1月1日起正式停用。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变更客户服务电话号码的公告》。

§13 备查文件目录

13.1 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

13.2 存放地点

天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层

13.3 查阅方式

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

公司网站：www.thfund.com.cn

天弘基金管理有限公司
二〇二六年三月三十一日