

天弘中证 A500 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人:天弘基金管理有限公司

基金托管人: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	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	39
7.1 期末基金资产组合情况	39
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
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	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	54
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	55
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	55
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	55
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	55
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	55
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	55
7.12 投资组合报告附注	55
§8 基金份额持有人信息	56
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	56
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	56

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.....	56
§9 开放式基金份额变动.....	56
§10 重大事件揭示.....	57
10.1 基金份额持有人大会决议.....	57
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	57
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	57
10.4 基金投资策略的改变	57
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	57
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	57
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	58
10.8 其他重大事件	59
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	61
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.....	61
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	62
§12 备查文件目录.....	63
12.1 备查文件目录	63
12.2 存放地点.....	63
12.3 查阅方式.....	63

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	天弘中证A500增强策略交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	天弘中证A500增强策略ETF
场内简称	A500增强ETF天弘
基金主代码	159240
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2025年06月05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	20,619,776.00份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2025年06月17日

2.2 基金产品说明

投资目标	在对标的指数进行有效跟踪被动投资基础上，通过量化策略进行组合投资，并结合增强型的主动投资力争获取超越业绩比较基准的超额收益，实现基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采用指数增强型投资策略，以中证A500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，力争控制本基金份额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0.35%，年跟踪误差不超过6.5%，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、存托凭证投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、股票期权投资策略、国债期货投资策略、参与融资及转融通证券出借业务策略等。
业绩比较基准	中证A500指数收益率
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

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点	基金管理人及基金托管人的办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2026年01月01日- 2026年06月30日)
本期已实现收益	3,068,167.56
本期利润	3,070,467.93
加权平均基金份额本期利润	0.1899
本期加权平均净值利润率	14.40%
本期基金份额净值增长率	13.66%
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	8,544,177.92
期末可供分配基金份额利润	0.4144
期末基金资产净值	29,163,953.92
期末基金份额净值	1.4144
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	41.44%

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

- 2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
- 3、期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	15.14%	1.40%	14.26%	1.41%	0.88%	-0.01%
过去六个月	13.66%	1.29%	11.91%	1.29%	1.75%	0.00%
过去一年	38.68%	1.15%	36.38%	1.14%	2.30%	0.01%
自基金合同生效日起至 今	41.44%	1.11%	39.29%	1.12%	2.15%	-0.01%

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



注：1、本基金合同于2025年06月05日生效。

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06月05日至2025年12月04日，建仓期结束时及至报告期末，各项资产配置比例均符合基金合同的约定。

§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		
刘笑明	本基金基金经理	2025	-	12年	男，运筹学硕士。历任建信

		年06 月05 日			基金管理有限责任公司量化研究员、北京极至投资管理有限公司投资经理、中国人保资产管理有限公司基金经理，2020年4月加盟本公司。
--	--	-----------------	--	--	---

注：1、上述任职日期/离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金按照国家法律法规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不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，本基金份额净值为1.4144元，本报告期份额净值增长率13.66%，同期业绩比较基准增长率11.91%。

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

本基金本报告期末未进行利润分配，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

本基金本报告期内存在连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元的情形，基金管理人已向中国证监会报告并采取适当措施。本报告期内，自2026年01月01日起至2026年06月30日，由本基金管理人承担本基金的信息披露费、审计费等固定费用，不再从基金资产中计提。

§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中证A500增强策略交易型开放式指数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关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本托管人复核范围内）。

§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：天弘中证A500增强策略交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2026年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	109,630.79	186,533.63
结算备付金		265.36	218,146.21
存出保证金		-	166,262.40
交易性金融资产	6.4.7.2	29,065,129.51	16,801,341.00
其中：股票投资		29,065,129.51	16,801,341.00
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券 投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	799,818.52
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	43,332.98
资产总计		29,175,025.66	18,215,434.74
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		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		9,226.46	7,604.79
应付托管费		1,845.28	1,520.97
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	454.09
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	-	12,721.69
负债合计		11,071.74	22,301.54
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	20,619,776.00	14,619,776.00
未分配利润	6.4.7.8	8,544,177.92	3,573,357.20
净资产合计		29,163,953.92	18,193,133.20
负债和净资产总计		29,175,025.66	18,215,434.74

注：1.报告截止日2026年06月30日，基金份额净值1.4144元，基金份额总额20,619,776.00份。

2.本财务报表的比较期间为2025年06月05日(基金合同生效日)至2025年06月30日(下同)。

6.2 利润表

会计主体：天弘中证A500增强策略交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026年01月01日至 2026年06月30日	上年度可比期间 2025年06月05日（基金 合同生效日）至2025年
-----	-----	-----------------------------------	---

			06月30日
一、营业总收入		3,133,829.07	1,605,955.58
1.利息收入		808.01	84,513.51
其中：存款利息收入	6.4.7.9	409.54	64,766.00
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		398.47	19,747.51
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		3,104,880.64	827,755.14
其中：股票投资收益	6.4.7.10	2,819,950.90	415,308.62
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	18.68	-
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	80,470.53	-
股利收益	6.4.7.15	204,440.53	412,446.52
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	2,300.37	612,674.47
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	25,840.05	81,012.46
减：二、营业总支出		63,361.14	78,605.12
1.管理人报酬		52,557.96	51,376.80
2.托管费		10,511.62	10,275.36
3.销售服务费		-	-

4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		1.69	-
其中：卖出回购金融资产支出		1.69	-
6.信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7.税金及附加		289.87	-
8.其他费用	6.4.7.19	-	16,952.96
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		3,070,467.93	1,527,350.46
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		3,070,467.93	1,527,350.46
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		3,070,467.93	1,527,350.46

6.3 净资产变动表

会计主体：天弘中证A500增强策略交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	14,619,776.00	3,573,357.20	18,193,133.20
二、本期期初净资产	14,619,776.00	3,573,357.20	18,193,133.20
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	6,000,000.00	4,970,820.72	10,970,820.72
（一）、综合收益总额	-	3,070,467.93	3,070,467.93

（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）	6,000,000.00	1,900,352.79	7,900,352.79
其中：1.基金申购款	27,000,000.00	8,836,344.98	35,836,344.98
2.基金赎回款	-21,000,000.00	-6,935,992.19	-27,935,992.19
（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	20,619,776.00	8,544,177.92	29,163,953.92
项 目	上年度可比期间 2025年06月05日（基金合同生效日）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	-	-	-
二、本期期初净资产	224,619,776.00	-	224,619,776.00
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-183,000,000.00	828,700.33	-182,171,299.67
（一）、综合收益总额	-	1,527,350.46	1,527,350.46
（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）	-183,000,000.00	-698,650.13	-183,698,650.13
其中：1.基金申购款	6,000,000.00	-18,663.19	5,981,336.81

2.基金赎回款	-189,000,000.00	-679,986.94	-189,679,986.94
（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	41,619,776.00	828,700.33	42,448,476.33

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

天弘中证A500增强策略交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2025]423号《关于准予天弘中证A500增强策略交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》的准许，由基金管理人天弘基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于2025年06月05日正式生效，首次设立募集规模为224,619,776.00份基金份额。本基金的运作方式为交易型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为天弘基金管理有限公司，基金托管人为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（含主板、创业板及其他中国证监会允许上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、衍生品（包括股指期货、股票期权、国债期货）、资产支持证券、货币市场工具、同业存单、债券回购、银行存款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。本基金可根据法律法规的规定参与融资、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。本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的80%，投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产不低于非现金基金资产的80%。股指期货、国债期货、股票期权及其

他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。如法律法规或中国证监会变更上述投资品种的比例限制，以变更后的比例为准，基金管理人在依法履行适当程序后，可对本基金的投资比例做相应调整。

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	20,007.80
等于：本金	20,000.00
加：应计利息	7.80
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	89,622.99
等于：本金	89,600.63
加：应计利息	22.36
减：坏账准备	-
合计	109,630.79

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。

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	28,206,967.98	-	29,065,129.51	858,161.53

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		28,206,967.98	-	29,065,129.51	858,161.53

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款估值增值。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

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

本基金本报告期末未持有其他负债。

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2026年01月01日至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	14,619,776.00	14,619,776.00

本期申购	27,000,000.00	27,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-21,000,000.00	-21,000,000.00
本期末	20,619,776.00	20,619,776.00

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,388,265.87	185,091.33	3,573,357.20
本期期初	3,388,265.87	185,091.33	3,573,357.20
本期利润	3,068,167.56	2,300.37	3,070,467.93
本期基金份额交易产生的变动数	2,274,317.09	-373,964.30	1,900,352.79
其中：基金申购款	9,392,719.54	-556,374.56	8,836,344.98
基金赎回款	-7,118,402.45	182,410.26	-6,935,992.19
本期已分配利润	-	-	-
本期末	8,730,750.52	-186,572.60	8,544,177.92

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	146.75
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	131.72
结算备付金利息收入	131.07
其他	-
合计	409.54

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2026年01月01日至2026年06月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	2,190,547.50
股票投资收益——赎回差价收入	629,403.40
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	2,819,950.90

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
卖出股票成交总额	81,242,536.03
减：卖出股票成本总额	78,968,205.44
减：交易费用	83,783.09
买卖股票差价收入	2,190,547.50

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
赎回基金份额对价总额	27,935,992.19
减：现金支付赎回款总额	15,307,107.19
减：赎回股票成本总额	11,999,481.60
减：交易费用	-
赎回差价收入	629,403.40

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	14.68

债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	4.00
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	18.68

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	100,454.05
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	100,106.00
减：应计利息总额	344.05
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	4.00

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

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2026年01月01日至2026年06月30日
期货投资	80,470.53

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	204,440.53
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	204,440.53

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	26,060.37
——股票投资	26,060.37
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-23,760.00
——权证投资	-
——期货投资	-23,760.00
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	2,300.37

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
基金赎回费收入	-
基金转换费收入	-
ETF基金替代损益	25,840.05
合计	25,840.05

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

基金固定费用为其他费用项下的“信息披露费”、“审计费”等费用，本报告期内，自2026年01月01日至2026年06月30日，本基金的固定费用由基金管理人承担。

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
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

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

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

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

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

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

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06月05日（基金合同 生效日）至2025年06月30 日
当期发生的基金应支付的管理费	52,557.96	51,376.80
其中：应支付销售机构的客户维护费	17,997.39	22,067.15
应支付基金管理人的净管理费	34,560.57	29,309.65

注:1、支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬＝前一日基金资产净值×该日适用费率/当年天数。

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日 至2026年06月30 日	上年度可比期间 2025年06月05日（基金合同生 效日）至2025年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	10,511.62	10,275.36

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0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费＝前一日基金资产净值×该日适用费率/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行过银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金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	本期	上年度可比期间
------	----	---------

称	2026年01月01日至2026年06月30日		2025年06月05日（基金合同生效日）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	20,007.80	146.75	80,042.67	63,078.51

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	001248	华润新能源	网上申购	1,500	15,165.00
上年度可比期间 2025年06月05日（基金合同生效日）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
-	-	-	-	-	-

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
001248	华润新能源	2026-06-23	1个月内（含）	新股未上市	10.11	10.11	1,500	15,165.00	15,165.00	-

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

本基金是股票型指数基金，紧密跟踪标的指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似，本基金预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。本基金在对标的指数进行有效跟踪被动投资基础上，通过量化策略进行组合投资，并结合增强型的主动投资力争获取超越业绩比较基准的超额收益，实现基金资产的长期增值。

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

本基金本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级的债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级的同业存单。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级的债券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级的同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。本期末，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合法律法规的相关要求。

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	109,630.79	-	-	-	109,630.79
结算备付金	265.36	-	-	-	265.36
交易性金融资产	-	-	-	29,065,129.51	29,065,129.51
资产总计	109,896.15	-	-	29,065,129.51	29,175,025.66
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	9,226.46	9,226.46
应付托管费	-	-	-	1,845.28	1,845.28
负债总计	-	-	-	11,071.74	11,071.74

利率敏感度缺口	109,896.15	-	-	29,054,057.77	29,163,953.92
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	186,533.63	-	-	-	186,533.63
结算备付金	218,146.21	-	-	-	218,146.21
存出保证金	-	-	-	166,262.40	166,262.40
交易性金融资产	-	-	-	16,801,341.00	16,801,341.00
买入返售金融资产	799,818.52	-	-	-	799,818.52
其他资产	-	-	-	43,332.98	43,332.98
资产总计	1,204,498.36	-	-	17,010,936.38	18,215,434.74
负债					
应付管理人报酬	-	-	-	7,604.79	7,604.79
应付托管费	-	-	-	1,520.97	1,520.97
应交税费	-	-	-	454.09	454.09
其他负债	-	-	-	12,721.69	12,721.69
负债总计	-	-	-	22,301.54	22,301.54
利率敏感度缺口	1,204,498.36	-	-	16,988,634.84	18,193,133.20

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

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

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上

市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金采用指数增强型投资策略，以中证A500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。本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的80%，投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产不低于非现金基金资产的80%。股指期货、国债期货、股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。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	29,065,129.51	99.66	16,801,341.00	92.35
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	29,065,129.51	99.66	16,801,341.00	92.35

注：1、其他包含在期货交易所交易的期货投资(附注6.4.7.3)。在当日无负债结算制度下，期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为0。

2、由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币元)	
		本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
	业绩比较基准上升5%	1,643,632.05	947,252.90
	业绩比较基准下降5%	-1,643,632.05	-947,252.90

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	29,049,964.51	16,706,769.00
第二层次	15,165.00	94,572.00
第三层次	-	-
合计	29,065,129.51	16,801,341.00

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	29,065,129.51	99.62
	其中：股票	29,065,129.51	99.62
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	109,896.15	0.38
8	其他各项资产	-	-

9	合计	29,175,025.66	100.00
---	----	---------------	--------

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	1,252,486.00	4.29
C	制造业	20,450,101.59	70.12
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	551,217.00	1.89
E	建筑业	239,545.00	0.82
F	批发和零售业	208,848.00	0.72
G	交通运输、仓储和邮政业	509,364.00	1.75
H	住宿和餐饮业	50,169.00	0.17
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,553,566.04	5.33
J	金融业	2,924,897.00	10.03
K	房地产业	199,134.00	0.68
L	租赁和商务服务业	432,267.00	1.48
M	科学研究和技术服务业	436,920.00	1.50
N	水利、环境和公共设施管理业	140,668.00	0.48
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	9,086.00	0.03
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	28,958,268.63	99.29

7.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	91,695.88	0.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	15,165.00	0.05
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	106,860.88	0.37

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	1,000	1,270,000.00	4.35
2	300750	宁德时代	2,400	943,224.00	3.23
3	300502	新易盛	1,240	752,680.00	2.58
4	601318	中国平安	10,700	510,818.00	1.75
5	688256	寒武纪	298	475,473.90	1.63
6	601899	紫金矿业	18,500	465,090.00	1.59
7	688012	中微公司	898	420,713.00	1.44
8	603259	药明康德	3,300	410,883.00	1.41
9	603986	兆易创新	500	407,500.00	1.40
10	688981	中芯国际	2,400	381,168.00	1.31
11	600519	贵州茅台	300	355,647.00	1.22
12	000333	美的集团	4,700	354,991.00	1.22
13	600276	恒瑞医药	6,600	343,464.00	1.18
14	002384	东山精密	1,300	341,055.00	1.17
15	601398	工商银行	47,700	337,239.00	1.16
16	002475	立讯精密	4,500	316,800.00	1.09
17	601211	国泰海通	16,300	296,660.00	1.02
18	688041	海光信息	800	296,240.00	1.02
19	300059	东方财富	14,000	285,320.00	0.98
20	600036	招商银行	7,900	280,450.00	0.96
21	300408	三环集团	1,600	267,040.00	0.92
22	002371	北方华创	300	265,368.00	0.91
23	000725	京东方 A	30,300	263,004.00	0.90
24	600150	中国船舶	7,400	250,046.00	0.86
25	688008	澜起科技	804	249,159.60	0.85
26	600584	长电科技	2,400	248,520.00	0.85
27	600309	万华化学	3,400	232,594.00	0.80
28	600549	厦门钨业	2,700	230,040.00	0.79
29	601166	兴业银行	13,200	218,592.00	0.75
30	000858	五 粮 液	2,900	214,600.00	0.74

31	000100	TCL科技	35,700	207,774.00	0.71
32	600460	士兰微	3,800	207,708.00	0.71
33	601601	中国太保	7,200	205,344.00	0.70
34	300604	长川科技	600	204,852.00	0.70
35	002049	紫光国微	2,300	204,125.00	0.70
36	002600	领益智造	11,500	199,410.00	0.68
37	000938	紫光股份	6,900	199,134.00	0.68
38	300124	汇川技术	3,000	198,990.00	0.68
39	000977	浪潮信息	2,800	196,000.00	0.67
40	600887	伊利股份	8,100	194,076.00	0.67
41	603799	华友钴业	4,000	193,040.00	0.66
42	601225	陕西煤业	9,300	189,255.00	0.65
43	300014	亿纬锂能	2,900	188,587.00	0.65
44	601728	中国电信	35,000	181,650.00	0.62
45	000425	徐工机械	22,400	181,216.00	0.62
46	601988	中国银行	31,500	180,180.00	0.62
47	000338	潍柴动力	6,500	177,125.00	0.61
48	600183	生益科技	1,000	173,400.00	0.59
49	000568	泸州老窖	2,200	170,544.00	0.58
50	002463	沪电股份	1,100	168,080.00	0.58
51	002415	海康威视	4,900	167,580.00	0.57
52	003816	中国广核	40,800	159,528.00	0.55
53	600900	长江电力	6,000	158,820.00	0.54
54	601872	招商轮船	9,000	158,130.00	0.54
55	002938	鹏鼎控股	1,500	158,070.00	0.54
56	300394	天孚通信	520	157,393.60	0.54
57	002432	九安医疗	2,200	155,496.00	0.53
58	002281	光迅科技	600	154,164.00	0.53
59	600893	航发动力	4,000	153,360.00	0.53
60	688469	芯联集成	14,378	152,550.58	0.52
61	002837	英维克	1,900	151,164.00	0.52

62	603019	中科曙光	1,400	150,122.00	0.51
63	688521	芯原股份	400	148,456.00	0.51
64	688396	华润微	1,500	146,325.00	0.50
65	605589	圣泉集团	2,300	146,211.00	0.50
66	600011	华能国际	18,900	143,451.00	0.49
67	300274	阳光电源	900	143,118.00	0.49
68	300782	卓胜微	1,300	142,454.00	0.49
69	002266	浙富控股	27,800	140,668.00	0.48
70	688002	睿创微纳	900	139,221.00	0.48
71	603993	洛阳钼业	7,900	138,645.00	0.48
72	002008	大族激光	900	135,099.00	0.46
73	600482	中国动力	4,100	134,480.00	0.46
74	688099	晶晨股份	1,300	133,770.00	0.46
75	002027	分众传媒	27,300	132,132.00	0.45
76	603486	科沃斯	2,600	131,950.00	0.45
77	300458	全志科技	3,300	130,218.00	0.45
78	600031	三一重工	7,500	129,600.00	0.44
79	601288	农业银行	21,200	128,684.00	0.44
80	300223	北京君正	500	124,450.00	0.43
81	600000	浦发银行	14,400	123,984.00	0.43
82	000960	锡业股份	2,900	123,801.00	0.42
83	002532	天山铝业	11,200	120,176.00	0.41
84	601233	桐昆股份	5,500	119,075.00	0.41
85	600019	宝钢股份	21,900	118,917.00	0.41
86	002466	天齐锂业	1,900	116,508.00	0.40
87	600153	建发股份	14,600	115,778.00	0.40
88	688472	阿特斯	10,678	115,535.96	0.40
89	600392	盛和资源	3,800	113,126.00	0.39
90	300418	昆仑万维	2,800	113,008.00	0.39
91	300049	福瑞医科	2,800	108,864.00	0.37
92	601058	赛轮轮胎	9,400	108,382.00	0.37

93	601888	中国中免	2,000	107,420.00	0.37
94	300866	安克创新	1,000	104,500.00	0.36
95	300476	胜宏科技	300	103,929.00	0.36
96	600522	中天科技	1,700	103,156.00	0.35
97	002138	顺络电子	1,400	102,340.00	0.35
98	300857	协创数据	300	101,970.00	0.35
99	688676	金盘科技	1,200	101,568.00	0.35
100	000519	中兵红箭	4,800	101,136.00	0.35
101	300803	指南针	1,100	100,837.00	0.35
102	000792	盐湖股份	3,300	99,627.00	0.34
103	002465	海格通信	7,800	99,606.00	0.34
104	000001	平安银行	9,900	99,495.00	0.34
105	688525	佰维存储	200	98,946.00	0.34
106	600487	亨通光电	900	98,406.00	0.34
107	603816	顾家家居	4,400	98,384.00	0.34
108	600039	四川路桥	12,500	97,750.00	0.34
109	600028	中国石化	21,200	94,552.00	0.32
110	000034	神州数码	3,360	93,240.00	0.32
111	000625	长安汽车	12,900	92,493.00	0.32
112	002179	中航光电	2,000	92,400.00	0.32
113	000807	云铝股份	4,100	90,774.00	0.31
114	600115	中国东航	23,800	90,678.00	0.31
115	002064	华峰化学	9,500	90,155.00	0.31
116	000830	鲁西化工	7,500	90,000.00	0.31
117	603885	吉祥航空	8,700	89,523.00	0.31
118	600066	宇通客车	3,300	88,473.00	0.30
119	002517	恺英网络	5,400	87,750.00	0.30
120	600489	中金黄金	4,800	86,640.00	0.30
121	002028	思源电气	500	86,500.00	0.30
122	601088	中国神华	2,200	85,888.00	0.29
123	001979	招商蛇口	13,300	85,519.00	0.29

124	601600	中国铝业	10,200	83,844.00	0.29
125	688213	思特威	782	83,728.74	0.29
126	002851	麦格米特	500	83,590.00	0.29
127	002294	信立泰	2,600	82,914.00	0.28
128	002821	凯莱英	500	81,000.00	0.28
129	002891	中宠股份	2,900	77,488.00	0.27
130	601857	中国石油	8,900	77,252.00	0.26
131	600166	福田汽车	26,500	77,115.00	0.26
132	600875	东方电气	2,600	74,802.00	0.26
133	001965	招商公路	8,100	74,196.00	0.25
134	605499	东鹏饮料	600	74,058.00	0.25
135	300033	同花顺	300	72,300.00	0.25
136	002080	中材科技	800	72,000.00	0.25
137	603939	益丰药房	4,000	71,920.00	0.25
138	300409	道氏技术	3,600	71,748.00	0.25
139	600690	海尔智家	3,500	71,435.00	0.24
140	002405	四维图新	10,900	70,523.00	0.24
141	301308	江波龙	100	70,380.00	0.24
142	600208	衢州发展	24,800	70,184.00	0.24
143	002131	利欧股份	14,700	69,825.00	0.24
144	601117	中国化学	9,300	68,355.00	0.23
145	601328	交通银行	10,600	68,158.00	0.23
146	688120	华海清科	200	64,436.00	0.22
147	300757	罗博特科	100	61,900.00	0.21
148	000831	中国稀土	1,100	61,039.00	0.21
149	600941	中国移动	700	60,291.00	0.21
150	300136	信维通信	500	59,625.00	0.20
151	600104	上汽集团	6,100	59,536.00	0.20
152	603606	东方电缆	1,400	58,114.00	0.20
153	600316	洪都航空	2,000	55,880.00	0.19
154	002594	比亚迪	700	55,790.00	0.19

155	603806	福斯特	3,300	55,407.00	0.19
156	000988	华工科技	300	55,383.00	0.19
157	002129	TCL中环	4,600	55,292.00	0.19
158	601179	中国西电	3,700	55,204.00	0.19
159	600029	南方航空	10,600	54,908.00	0.19
160	600312	平高电气	3,100	54,746.00	0.19
161	600938	中国海油	2,000	54,300.00	0.19
162	300115	长盈精密	1,900	53,086.00	0.18
163	300001	特锐德	1,400	52,962.00	0.18
164	300450	先导智能	1,300	52,936.00	0.18
165	002558	巨人网络	1,900	52,364.00	0.18
166	002648	卫星化学	2,200	51,678.00	0.18
167	601766	中国中车	9,900	51,480.00	0.18
168	600988	赤峰黄金	1,900	50,008.00	0.17
169	300496	中科创达	800	49,432.00	0.17
170	688111	金山办公	228	48,575.40	0.17
171	600499	科达制造	3,400	46,920.00	0.16
172	000683	博源化工	7,900	45,504.00	0.16
173	600258	首旅酒店	4,100	44,772.00	0.15
174	688599	天合光能	3,100	43,772.00	0.15
175	300919	中伟新材	1,000	43,750.00	0.15
176	688390	固德威	400	43,404.00	0.15
177	600362	江西铜业	1,000	43,300.00	0.15
178	300073	当升科技	900	43,236.00	0.15
179	600989	宝丰能源	2,100	42,693.00	0.15
180	600886	国投电力	3,200	42,592.00	0.15
181	300054	鼎龙股份	400	42,388.00	0.15
182	600535	天士力	3,200	42,336.00	0.15
183	603659	璞泰来	1,400	40,502.00	0.14
184	000967	盈峰环境	3,800	40,014.00	0.14
185	002273	水晶光电	1,100	39,028.00	0.13

186	300724	捷佳伟创	500	35,300.00	0.12
187	688166	博瑞医药	985	34,484.85	0.12
188	601985	中国核电	3,800	34,314.00	0.12
189	601868	中国能建	11,700	31,239.00	0.11
190	000786	北新建材	1,700	30,753.00	0.11
191	002353	杰瑞股份	200	30,500.00	0.10
192	688223	晶科能源	6,400	30,400.00	0.10
193	300475	香农芯创	100	30,000.00	0.10
194	002252	上海莱士	6,800	29,512.00	0.10
195	300346	南大光电	300	27,795.00	0.10
196	000032	深桑达 A	1,100	27,445.00	0.09
197	300760	迈瑞医疗	200	27,166.00	0.09
198	300763	锦浪科技	300	27,105.00	0.09
199	600426	华鲁恒升	1,100	26,312.00	0.09
200	300759	康龙化成	900	26,037.00	0.09
201	600497	驰宏锌锗	2,100	25,431.00	0.09
202	603596	伯特利	1,000	24,840.00	0.09
203	002001	新 和 成	800	22,736.00	0.08
204	600176	中国巨石	300	21,864.00	0.07
205	688578	艾力斯	200	21,840.00	0.07
206	300573	兴齐眼药	500	20,380.00	0.07
207	601155	新城控股	1,900	19,494.00	0.07
208	300454	深信服	200	19,240.00	0.07
209	000547	航天发展	1,000	19,150.00	0.07
210	000157	中联重科	2,700	18,819.00	0.06
211	300342	天银机电	400	18,800.00	0.06
212	600096	云天化	600	18,240.00	0.06
213	601689	拓普集团	300	16,926.00	0.06
214	600816	建元信托	6,900	16,836.00	0.06
215	300442	润泽科技	200	16,614.00	0.06
216	601111	中国国航	2,600	15,730.00	0.05

217	002444	巨星科技	500	15,550.00	0.05
218	002156	通富微电	200	15,174.00	0.05
219	601668	中国建筑	3,400	14,756.00	0.05
220	600704	物产中大	2,900	13,688.00	0.05
221	601021	春秋航空	300	13,674.00	0.05
222	002185	华天科技	600	13,386.00	0.05
223	600372	中航机载	1,200	13,020.00	0.04
224	600008	首创环保	4,600	12,512.00	0.04
225	600048	XD保利发	2,700	12,501.00	0.04
226	002202	金风科技	500	11,950.00	0.04
227	601615	明阳智能	1,000	11,570.00	0.04
228	601168	西部矿业	400	10,856.00	0.04
229	605117	德业股份	100	10,618.00	0.04
230	300015	爱尔眼科	1,100	9,086.00	0.03
231	600741	华域汽车	500	7,760.00	0.03
232	002025	航天电器	100	7,622.00	0.03
233	002244	滨江集团	1,000	7,600.00	0.03
234	600415	小商品城	700	7,112.00	0.02
235	601360	三六零	800	6,952.00	0.02
236	600885	宏发股份	200	6,898.00	0.02
237	688180	君实生物	200	6,764.00	0.02
238	000933	神火股份	300	6,360.00	0.02
239	600233	圆通速递	400	6,300.00	0.02
240	601000	唐山港	1,500	6,225.00	0.02
241	601127	赛力斯	100	6,125.00	0.02
242	688005	容百科技	200	6,120.00	0.02
243	002738	中矿资源	100	5,899.00	0.02
244	600754	锦江酒店	300	5,397.00	0.02
245	600160	巨化股份	100	5,301.00	0.02
246	600486	扬农化工	100	5,070.00	0.02
247	300832	新产业	100	4,200.00	0.01

248	002422	科伦药业	100	3,852.00	0.01
249	300339	润和软件	100	3,851.00	0.01
250	600515	海南机场	1,400	3,836.00	0.01
251	000623	吉林敖东	200	3,546.00	0.01
252	002271	东方雨虹	200	2,374.00	0.01
253	002555	三七互娱	100	1,887.00	0.01
254	300003	乐普医疗	100	1,185.00	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	300628	亿联网络	1,700	57,494.00	0.20
2	002245	蔚蓝锂芯	1,828	34,201.88	0.12
3	001248	华润新能源	1,500	15,165.00	0.05

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	601899	紫金矿业	996,421.00	5.48
2	601318	中国平安	987,264.00	5.43
3	603986	兆易创新	847,898.00	4.66
4	600519	贵州茅台	840,631.00	4.62
5	603259	药明康德	729,850.00	4.01
6	688256	寒武纪	692,028.00	3.80
7	688041	海光信息	680,017.58	3.74
8	688012	中微公司	658,952.46	3.62
9	600549	厦门钨业	655,927.00	3.61

10	600309	万华化学	652,814.00	3.59
11	688008	澜起科技	633,181.00	3.48
12	600276	恒瑞医药	623,348.00	3.43
13	603019	中科曙光	605,927.00	3.33
14	600150	中国船舶	602,612.00	3.31
15	600522	中天科技	595,276.00	3.27
16	601398	工商银行	592,955.00	3.26
17	688981	中芯国际	592,877.80	3.26
18	603993	洛阳钼业	567,319.00	3.12
19	600584	长电科技	565,849.00	3.11
20	300750	宁德时代	555,265.00	3.05
21	600036	招商银行	552,867.00	3.04
22	601872	招商轮船	543,523.00	2.99
23	002371	北方华创	527,302.00	2.90
24	603799	华友钴业	503,954.00	2.77
25	002028	思源电气	487,743.00	2.68
26	002281	光迅科技	475,114.00	2.61
27	601211	国泰海通	466,788.00	2.57
28	300223	北京君正	458,773.00	2.52
29	002851	麦格米特	456,744.00	2.51
30	603806	福斯特	454,375.00	2.50
31	600887	伊利股份	451,860.00	2.48
32	600482	中国动力	435,868.00	2.40
33	601689	拓普集团	435,575.00	2.39
34	600176	中国巨石	426,596.00	2.34
35	300274	阳光电源	425,216.00	2.34
36	601600	中国铝业	423,364.00	2.33
37	002008	大族激光	413,227.00	2.27
38	002384	东山精密	412,831.00	2.27
39	300136	信维通信	409,339.00	2.25
40	000960	锡业股份	408,746.00	2.25

41	300308	中际旭创	408,477.00	2.25
42	601166	兴业银行	406,362.00	2.23
43	603606	东方电缆	404,082.00	2.22
44	688521	芯原股份	401,747.00	2.21
45	603659	璞泰来	399,685.00	2.20
46	002463	沪电股份	398,909.00	2.19
47	601728	中国电信	397,955.00	2.19
48	600346	恒力石化	397,192.00	2.18
49	600183	生益科技	395,446.00	2.17
50	601088	中国神华	394,457.00	2.17
51	605589	圣泉集团	392,483.00	2.16
52	688099	晶晨股份	390,089.36	2.14
53	300124	汇川技术	383,202.00	2.11
54	600900	长江电力	380,398.00	2.09
55	601225	陕西煤业	376,943.00	2.07
56	600111	北方稀土	373,701.00	2.05
57	600563	法拉电子	373,384.00	2.05
58	300502	新易盛	372,292.00	2.05
59	688002	睿创微纳	370,907.84	2.04
60	600028	中国石化	370,240.00	2.04
61	300408	三环集团	365,660.00	2.01

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	601899	紫金矿业	890,970.00	4.90
2	600519	贵州茅台	829,062.80	4.56

3	688041	海光信息	802,445.00	4.41
4	601318	中国平安	799,202.00	4.39
5	603986	兆易创新	775,938.00	4.27
6	688008	澜起科技	690,621.57	3.80
7	603259	药明康德	673,498.00	3.70
8	600522	中天科技	605,249.00	3.33
9	603019	中科曙光	594,783.00	3.27
10	600549	厦门钨业	569,159.00	3.13
11	300223	北京君正	552,320.00	3.04
12	002156	通富微电	544,102.00	2.99
13	600176	中国巨石	531,610.00	2.92
14	002008	大族激光	492,297.00	2.71
15	601398	工商银行	492,106.00	2.70
16	300750	宁德时代	488,196.00	2.68
17	688256	寒武纪	472,154.06	2.60
18	300308	中际旭创	471,556.00	2.59
19	603799	华友钴业	467,533.00	2.57
20	600036	招商银行	462,523.00	2.54
21	601166	兴业银行	462,019.00	2.54
22	002851	麦格米特	459,545.00	2.53
23	002281	光迅科技	458,281.00	2.52
24	002463	沪电股份	455,437.79	2.50
25	601088	中国神华	452,417.50	2.49
26	600309	万华化学	439,658.00	2.42
27	300274	阳光电源	439,641.00	2.42
28	688981	中芯国际	433,456.59	2.38
29	600028	中国石化	425,477.00	2.34
30	002028	思源电气	424,990.00	2.34
31	603993	洛阳钼业	419,935.00	2.31
32	603659	璞泰来	416,760.00	2.29
33	603806	福斯特	413,174.00	2.27

34	600584	长电科技	413,143.00	2.27
35	688012	中微公司	410,086.96	2.25
36	600482	中国动力	407,898.00	2.24
37	688002	睿创微纳	403,585.67	2.22
38	600497	驰宏锌锗	403,350.00	2.22
39	601689	拓普集团	401,062.00	2.20
40	688017	绿的谐波	400,758.00	2.20
41	300567	精测电子	400,116.00	2.20
42	300763	锦浪科技	395,062.00	2.17
43	601857	中国石油	393,480.00	2.16
44	000063	中兴通讯	390,191.00	2.14
45	600346	恒力石化	389,487.00	2.14
46	600563	法拉电子	388,633.00	2.14
47	300136	信维通信	383,337.00	2.11
48	601872	招商轮船	382,055.00	2.10
49	600795	国电电力	381,507.00	2.10
50	002384	东山精密	371,817.00	2.04
51	000988	华工科技	368,384.00	2.02
52	300395	菲利华	368,160.00	2.02
53	300033	同花顺	365,871.40	2.01
54	600160	巨化股份	365,480.00	2.01

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

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	87,286,341.18
卖出股票收入（成交）总额	81,242,536.03

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用与A500指数相关性高、流动性好、交易活跃的期货合约与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金投资于股指期货，对基金总体风险的影响十分有限，并符合基金合同的相关约定。

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 本报告期内未发现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查，未发现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

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

本基金本报告期末未持有其他资产。

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值	占基金资产 净值比例(%)	流通受限情况说 明
1	001248	华润新能源	15,165.00	0.05	新股未上市

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人 户数(户)	户均持有的基金份 额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总份 额比例
436	47,293.06	12,280,847.00	59.56%	8,338,929.00	40.44%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2025年06月05日)基金份额总额	224,619,776.00
本报告期期初基金份额总额	14,619,776.00
本报告期基金总申购份额	27,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	21,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	20,619,776.00

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，基金管理人根据法律法规及《基金合同》等相关规定以通讯方式召开基金份额持有人大会，大会审议通过《关于持续运作天弘中证A500增强策略交易型开放式指数证券投资基金的议案》，本次大会决议自2026年4月14日起生效。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天弘中证A500增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告》。

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	
东方财富	6	168,513,712.21	100.00%	32,352.58	100.00%	-

证券						
----	--	--	--	--	--	--

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。

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
东方财富证券	200,216.00	100.00%	4,088,000.00	100.00%	-	-	-	-

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部分基金新增金融街证券股份有限公司为申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会规定媒介	2026-01-12
2	天弘中证A500增强策略交易型开放式指数证券投资基金2025年第4季度报告	中国证监会规定媒介	2026-01-22
3	天弘中证A500增强策略交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会规定媒介	2026-03-07
4	天弘基金管理有限公司关于以通讯方式召开天弘中证A500增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的公告	中国证监会规定媒介	2026-03-13

5	天弘基金管理有限公司关于以通讯方式召开天弘中证A500增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	中国证监会规定媒介	2026-03-16
6	天弘基金管理有限公司关于以通讯方式召开天弘中证A500增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	中国证监会规定媒介	2026-03-17
7	天弘基金管理有限公司关于旗下部分深交所ETF变更场内简称的公告	中国证监会规定媒介	2026-03-23
8	天弘中证A500增强策略交易型开放式指数证券投资基金2025年年度报告	中国证监会规定媒介	2026-03-31
9	天弘中证A500增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要（更新）	中国证监会规定媒介	2026-03-31
10	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
11	天弘中证A500增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要（更新）	中国证监会规定媒介	2026-04-09
12	天弘基金管理有限公司关于天弘中证A500增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会计票日停牌的提示性公告	中国证监会规定媒介	2026-04-14

13	天弘基金管理有限公司关于天弘中证A500增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会表决结果暨决议生效的公告	中国证监会规定媒介	2026-04-15
14	天弘中证A500增强策略交易型开放式指数证券投资基金2026年第1季度报告	中国证监会规定媒介	2026-04-22
15	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
16	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
17	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
18	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金新增申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会规定媒介	2026-06-12
19	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
20	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金新增申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会规定媒介	2026-06-17
21	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	2026-06-25

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20260107-20260108, 20260424-20260426, 20260525-20260525	1,353,547.00	26,922,002.00	25,086,598.00	3,188,951.00	15.47%
产品特有风险							
基金管理人秉承谨慎勤勉、独立决策、规范运作、充分披露原则，公平对待投资者，保障投资者合法权益。当单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%时，由此可能导致的特有风险主要包括： （1）超出基金管理人允许的单一投资者持有基金份额比例的申购申请不被确认的风险； （2）极端市场环境下投资者集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对赎回申请的风险； （3）持有基金份额占比较高的投资者大额赎回可能引发基金净值大幅波动的风险； （4）持有基金份额占比较高的投资者在召开基金份额持有人大会并对重大事项进行投票表决时，可能拥有较大话语权； （5）极端情况下，持有基金份额占比较高的投资者大量赎回后，可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平，面临转换基金运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等风险。							

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

2、份额占比精度处理方式四舍五入。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金注册的文件
- 2、基金合同
- 3、托管协议
- 4、招募说明书
- 5、报告期内在指定报刊上披露的各项公告
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 7、中国证监会规定的其他文件

12.2 存放地点

天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层

12.3 查阅方式

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

公司网站：www.thfund.com.cn

天弘基金管理有限公司
二〇二六年八月三十一日