

# 天弘中证智能汽车主题指数型发起式证券投资基金

## 2024 年中期报告

2024 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:海通证券股份有限公司

送出日期:2024 年 08 月 30 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，并由董事长签发。

基金托管人海通证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2024年08月28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2024年01月01日起至2024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	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§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	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
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	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
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	14
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	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	20
§7 投资组合报告	52
7.1 期末基金资产组合情况	52
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	53
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	55
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	58
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	60
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	61
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	61
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	61
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	61
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	61
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	61
7.12 投资组合报告附注	61
§8 基金份额持有人信息	63
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	63
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	64

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	64
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	64
§9 开放式基金份额变动.....	65
§10 重大事件揭示.....	65
10.1 基金份额持有人大会决议.....	65
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	65
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	65
10.4 基金投资策略的改变.....	66
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	66
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	66
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	66
10.8 其他重大事件.....	67
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	68
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.....	68
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	69
§12 备查文件目录.....	69
12.1 备查文件目录.....	69
12.2 存放地点.....	69
12.3 查阅方式.....	69

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	天弘中证智能汽车主题指数型发起式证券投资基金	
基金简称	天弘中证智能汽车	
基金主代码	010955	
基金运作方式	契约型开放式、发起式	
基金合同生效日	2021年01月19日	
基金管理人	天弘基金管理有限公司	
基金托管人	海通证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	639,099,255.11份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	天弘中证智能汽车A	天弘中证智能汽车C
下属分级基金的交易代码	010955	010956
报告期末下属分级基金的份额总额	126,380,655.50份	512,718,599.61份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。
投资策略	本基金产品投资策略主要包括大类资产配置、股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、参与融资及转融通证券出借业务策略、存托凭证投资策略、其他金融工具投资策略。
业绩比较基准	中证智能汽车主题指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数相似的风险收益特征。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		天弘基金管理有限公司	海通证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	童建林	邓来承
	联系电话	022-83310208	021-23185481
	电子邮箱	service@thfund.com.cn	dlc11913@haitong.com
客户服务电话		95046	95553
传真		022-83865564	021-63410637
注册地址		天津自贸试验区（中心商务区）新华路3678号宝风大厦23层	上海市黄浦区广东路689号
办公地址		天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层	上海市黄浦区中山南路888号海通外滩金融广场
邮政编码		300203	200011
法定代表人		韩歆毅	周杰

## 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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.thfund.com.cn
基金中期报告备置地点	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
注册登记机构	天弘基金管理有限公司	天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层

## §3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2024年01月01日-2024年06月30日)	
	天弘中证智能汽车 A	天弘中证智能汽车 C
本期已实现收益	-8,355,500.41	-45,097,758.39
本期利润	-11,904,198.90	-93,073,808.97
加权平均基金份额本期利润	-0.0938	-0.1550
本期加权平均净值利润率	-12.59%	-20.97%
本期基金份额净值增长率	-11.02%	-11.10%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2024年06月30日)	
期末可供分配利润	-32,616,402.21	-134,942,727.22
期末可供分配基金份额利润	-0.2581	-0.2632
期末基金资产净值	93,764,253.29	377,775,872.39
期末基金份额净值	0.7419	0.7368
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2024年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	-25.81%	-26.32%

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

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

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

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

天弘中证智能汽车A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标	业绩比较 基准收益	业绩比较 基准收益	①-③	②-④
----	--------------	--------------	--------------	--------------	-----	-----

		准差②	率③	率标准差④		
过去一个月	0.38%	1.48%	0.18%	1.49%	0.20%	-0.01%
过去三个月	-4.49%	1.56%	-5.00%	1.55%	0.51%	0.01%
过去六个月	-11.02%	1.96%	-11.42%	1.94%	0.40%	0.02%
过去一年	-14.80%	1.70%	-16.04%	1.70%	1.24%	0.00%
过去三年	-25.71%	1.72%	-30.75%	1.72%	5.04%	0.00%
自基金合同生效日起至今	-25.81%	1.71%	-32.42%	1.71%	6.61%	0.00%

## 天弘中证智能汽车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
过去一个月	0.37%	1.48%	0.18%	1.49%	0.19%	-0.01%
过去三个月	-4.53%	1.56%	-5.00%	1.55%	0.47%	0.01%
过去六个月	-11.10%	1.96%	-11.42%	1.94%	0.32%	0.02%
过去一年	-14.98%	1.70%	-16.04%	1.70%	1.06%	0.00%
过去三年	-26.16%	1.72%	-30.75%	1.72%	4.59%	0.00%
自基金合同生效日起至今	-26.32%	1.71%	-32.42%	1.71%	6.10%	0.00%

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



天弘中证智能汽车A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2021年01月19日-2024年06月30日)



天弘中证智能汽车C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2021年01月19日-2024年06月30日)



- 注：1、本基金合同于2021年01月19日生效。  
2、本报告期内，本基金的各项投资比例达到基金合同约定的各项比例要求。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

天弘基金管理有限公司（以下简称“公司”或“本基金管理人”）经中国证监会证监基金字[2004]164号文批准，于2004年11月8日正式成立，注册资本为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2024年6月30日，公司共管理运作197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	2021年01月	-	9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。
洪明华	本基金基金经理助理	2024年06月	-	8年	男，计算机应用技术硕士。历任朗讯科技(中国)有限公司软件工程师、路孚特(中国)科技有限公司(原路通世

					纪(中国)科技有限公司)高级软件工程师、嘉实基金管理有限公司高级软件工程师，2016年10月加盟本公司。
王帅	本基金基金经理助理	2022年09月	2024年04月	9年	男，数量经济学专业硕士。2015年6月加盟本公司，历任助理研究员、研究员、高级研究员、投资经理。

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、本基金基金经理助理协助基金经理进行投资、研究、头寸管理等日常工作。

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

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

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

本报告期内，本基金运作合法合规，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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1次，投资组合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易，未导致不公平交易和利益输送。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

报告期内，本基金跟踪误差和超额收益的来源主要是申购赎回导致的仓位偏离、标的指数样本股调整导致的结构偏离、打新、成分股分红和转融通券息收益五方面因素。当由于申赎、成分股停牌或新股锁定等情况可能对指数跟踪效果带来影响时，本基金坚持既定的指数化投资策略，对指数基金采取被动复制与基于风险控制的组合优化相结合的方式跟踪指数，在保证跟踪误差可控的前提下实现了相对基准指数的正向偏离。报告期内，本基金整体运行平稳。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2024年06月30日，天弘中证智能汽车A基金份额净值为0.7419元，天弘中证智能汽车C基金份额净值为0.7368元。报告期内份额净值增长率天弘中证智能汽车A为-11.02%，同期业绩比较基准增长率为-11.42%；天弘中证智能汽车C为-11.10%，同期业绩比较基准增长率为-11.42%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2024年上半年经济呈现弱复苏格局，3-4月经济旺季恢复的势头在淡季和雨季的影响下未能延续，PMI回落至荣枯线下方。结构上来看，上半年依然呈现生产好于需求、外需好于内需，服务好于实物消费的特点。从生产端来看，工业增加值保持一定的韧性，工业用电量、货运量在今年处于复苏态势。需求端仍呈现有效需求不足的特点，但外需出现明显改善，全球制造业PMI在今年上半年持续处于荣枯线上方，带动出口增速延续了去年年底以来的修复态势。内需方面，地产链是最大的拖累项，销售、投资和新开工均录得两位数的负增速，地产景气度的持续下行一定程度上影响了消费的复苏，消费者信心指数和社会消费品零售处于低位运行。制造业和基建有所分化，制造业投资韧性较

强，与出口恢复良好、补库周期有较强关联，同时也受设备更新政策的支撑；基建投资增速逐月下行，反映出财政支出进度偏慢。股票市场方面，2024年上半年呈现探底回升，分化加大的特点，在1月市场加速下跌之后，2月初随着救市政策组合拳的推出，市场迎来超跌反弹，5月中旬之后市场再度开启调整。上半年全部A股估值小幅调整，业绩延续负增长，呈现大盘龙头风格占优的格局，小微盘风格表现较差。从风格和行业表现来看，稳定和金融风格占优，其中银行、煤炭、公用事业涨幅居前，家电、石油石化也有不错的涨幅；成长和消费风格跌幅较大，计算机、商贸零售、社会服务领跌。

展望2024年下半年，从经济形势来看，内外需背离的格局预计将延续，一方面外需的韧性较强，欧美发达经济体提前降息有助于进一步夯实全球经济复苏；另一方面内需的改善需要等待地产尤其是房价的企稳。从流动性格局来看，四季度有望迎来中美共振宽松的窗口期，国内降息的空间将打开。从政策导向来看，预计改革与科技创新仍将是下半年的主旋律，新质生产力与产能过剩的破局亦有看点。下半年股票市场预计将呈现结构性行情较为突出的特点。从大势来看，全A估值水平较低叠加托底资金进场，市场下行风险不大，但由于业绩目前处于整固阶段，大幅宽松的条件并不具备，因此指数层面上行的空间也较为有限。

具体行业赛道方面，今年上半年汽车智能化快速推进，在华为、造车新势力的带动下，智能化相关的应用场景不断落地，如城际交通、自动泊车、代客泊车等。此外，无人驾驶出租车也逐步进入应用阶段，对整个国内民众的出行带来深刻变化。各地对智能驾驶的政策支持力度也逐步强化。技术迭代方面，智能驾驶逐步向无图方案演进。海外龙头特斯拉加快推进FSD入华，将会加快智能化的普及速度。展望下半年，汽车行业价格战逐步接近尾声，智能化的配置向下普及到低价位车型，渗透率将会再上一个台阶。智能化普及程度与技术迭代成熟度形成正向反馈，推动板块持续高速发展。本基金将持续跟踪汽车智能化渗透率及相关企业业绩兑现情况，并密切关注技术迭代及相关政策法规落地进程对整车厂商产销数据和板块景气度的边际影响。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

公司基金估值委员会下设基金估值工作小组，由具备丰富专业知识、两年以上基金行业相关领域工作经历、熟悉基金投资品种定价及基金估值法律法规、具备较强专业胜

任能力的基金经理（投资经理）、股票/债券研究员、基金运营部、风险管理部和内控合规部的相关人员组成。

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

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

报告期内，本基金管理人未与任何第三方签订与估值相关的定价服务协议。

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

#### **4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

本报告期内本基金管理人无应说明预警信息。

### **§5 托管人报告**

#### **5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明**

本报告期内，本基金托管人在天弘中证智能汽车主题指数型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，天弘中证智能汽车主题指数型发起式证券投资基金的管理人--天弘基金管理有限公司在天弘中证智能汽车主题指数型发起式证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，天弘中证智能汽车主题指数型发起式证券投资基金未进行利润分配。

#### **5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见**

本托管人依法对天弘基金管理有限公司编制和披露的天弘中证智能汽车主题指数型发起式证券投资基金2024年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告中的财务数据等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## §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：天弘中证智能汽车主题指数型发起式证券投资基金

报告截止日：2024年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
<b>资产：</b>			
货币资金	6.4.7.1	25,372,949.09	37,272,265.33
结算备付金		46,971.60	133,746.49
存出保证金		186,221.08	396,705.09
交易性金融资产	6.4.7.2	447,750,910.35	721,492,977.92
其中：股票投资		447,243,102.82	719,861,891.45
基金投资		-	-
债券投资		507,807.53	1,631,086.47
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	-
应收股利		671.00	-
应收申购款		2,060,385.87	4,252,276.82
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	17,189.85	43,044.16
资产总计		475,435,298.84	763,591,015.81

负债和净资产	附注号	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
<b>负债：</b>			
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		1,204,461.58	308,780.04
应付赎回款		2,231,420.22	4,792,023.19
应付管理人报酬		197,322.69	318,723.90
应付托管费		39,464.53	63,744.78
应付销售服务费		63,223.40	109,616.91
应付投资顾问费		-	-
应交税费		5,941.98	4,964.57
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	153,338.76	294,160.19
负债合计		3,895,173.16	5,892,013.58
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	639,099,255.11	913,427,773.94
未分配利润	6.4.7.8	-167,559,129.43	-155,728,771.71
净资产合计		471,540,125.68	757,699,002.23
负债和净资产总计		475,435,298.84	763,591,015.81

注：报告截止日2024年06月30日，天弘中证智能汽车主题指数型发起式证券投资基金A类基金份额净值0.7419元，天弘中证智能汽车主题指数型发起式证券投资基金C类基金份额净值0.7368元；基金份额总额639,099,255.11份，其中天弘中证智能汽车主题指数型发起式证券投资基金A类基金份额126,380,655.50份，天弘中证智能汽车主题指数型发起式证券投资基金C类基金份额512,718,599.61份。

## 6.2 利润表

会计主体：天弘中证智能汽车主题指数型发起式证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日



单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年01月01日至 2024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至202 3年06月30日
<b>一、营业总收入</b>		-102,794,332.69	81,057,359.83
1.利息收入		244,474.98	233,128.93
其中：存款利息收入	6.4.7.9	243,170.60	233,128.93
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		1,304.38	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-” 填列）		-51,649,903.54	-7,792,783.15
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-55,019,716.46	-10,017,641.50
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	211.70	8,127.79
资产支持证券投资 收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	2,732,886.43	1,646,935.32
其他投资收益		636,714.79	569,795.24
3.公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	6.4.7.16	-51,524,749.07	88,539,848.01
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	135,844.94	77,166.04
<b>减：二、营业总支出</b>		2,183,675.18	2,075,308.03
1.管理人报酬		1,331,806.80	1,281,461.99

2.托管费		266,361.28	256,292.43
3.销售服务费		439,078.01	394,566.32
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7.税金及附加		3,649.28	2,468.66
8.其他费用	6.4.7.19	142,779.81	140,518.63
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-104,978,007.87	78,982,051.80
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-104,978,007.87	78,982,051.80
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-104,978,007.87	78,982,051.80

### 6.3 净资产变动表

会计主体：天弘中证智能汽车主题指数型发起式证券投资基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024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	913,427,773.94	-155,728,771.71	757,699,002.23
二、本期期初净资产	913,427,773.94	-155,728,771.71	757,699,002.23
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-274,328,518.83	-11,830,357.72	-286,158,876.55

(一)、综合收益总额	-	-104,978,007.87	-104,978,007.87
(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)	-274,328,518.83	93,147,650.15	-181,180,868.68
其中: 1.基金申购款	518,924,573.20	-133,769,328.05	385,155,245.15
2.基金赎回款	-793,253,092.03	226,916,978.20	-566,336,113.83
(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	639,099,255.11	-167,559,129.43	471,540,125.68
项目	上年度可比期间 2023年01月01日至2023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	594,888,008.41	-149,150,699.80	445,737,308.61
二、本期期初净资产	594,888,008.41	-149,150,699.80	445,737,308.61
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	115,828,344.06	54,923,197.60	170,751,541.66
(一)、综合收益总额	-	78,982,051.80	78,982,051.80
(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)	115,828,344.06	-24,058,854.20	91,769,489.86

列)			
其中：1.基金申购款	614,361,190.75	-109,336,672.57	505,024,518.18
2.基金赎回款	-498,532,846.69	85,277,818.37	-413,255,028.32
(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	710,716,352.47	-94,227,502.20	616,488,850.27

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

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

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

天弘中证智能汽车主题指数型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2020]3117号《关于准予天弘中证智能汽车主题指数型发起式证券投资基金注册的批复》准予注册，由天弘基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘中证智能汽车主题指数型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式、发起式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币755,430,481.00元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2021)第0081号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《天弘中证智能汽车主题指数型发起式证券投资基金基金合同》于2021年1月19日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为755,665,317.78份基金份额，其中认购资金利息折合234,836.78份基金份额。本基金的基金管理人为天弘基金管理有限公司，基金托管人为海通证券股份有限公司。

根据《天弘中证智能汽车主题指数型发起式证券投资基金基金合同》和《天弘中证智能汽车主题指数型发起式证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金根据所收取认购/申购费用、赎回费用、销售服务费用方式的差异，将基金份额分为不同的类别。其中：在投资人认购/申购、赎回基金时收取认购/申购费用、赎回费用，并不再从本类别

基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为A类基金份额。在投资人认购/申购基金时不收取认购/申购费用、赎回时收取赎回费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为C类基金份额。本基金A类和C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算并公布基金份额净值和基金份额累计净值。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘中证智能汽车主题指数型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，以中证智能汽车主题指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于其他股票(非标的指数成份股及其备选成份股，含中小板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票)、存托凭证、银行存款、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、债券回购、股指期货、资产支持证券、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金可以根据相关法律法规的规定参与融资和转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金投资于股票的资产比例不低于基金资产的90%，投资于中证智能汽车主题指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的80%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。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。本基金的业绩比较基准：中证智能汽车主题指数收益率 $\times$ 95%+银行活期存款利率(税后) $\times$ 5%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《天弘中证智能汽车主题指数型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2024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2024年06月30日的财务状况以及2024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

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

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所

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

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

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

## 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 2024年06月30日
活期存款	25,372,949.09
等于：本金	25,361,007.75
加：应计利息	11,941.34
减：坏账准备	-
定期存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
其中：存款期限1个月以内	-
存款期限1-3个月	-
存款期限3个月以上	-
其他存款	-
等于：本金	-
加：应计利息	-
减：坏账准备	-
合计	25,372,949.09

### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	525,107,442.62	-	447,243,102.82	-77,864,339.80	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	500,137.00	7,707.53	507,807.53	-37.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	500,137.00	7,707.53	507,807.53	-37.00
资产支持证券	-	-	-	-	
基金	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	525,607,579.62	7,707.53	447,750,910.35	-77,864,376.80	

**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**

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日
应收利息	-
其他应收款	17,189.85
待摊费用	-
合计	17,189.85



## 6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	338.47
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	39,037.85
其中：交易所市场	39,037.85
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	89,507.60
其他应付款	24,454.84
合计	153,338.76

## 6.4.7.7 实收基金

## 6.4.7.7.1 天弘中证智能汽车A

金额单位：人民币元

项目 (天弘中证智能汽车A)	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	125,201,063.12	125,201,063.12
本期申购	56,858,840.56	56,858,840.56
本期赎回(以“-”号填列)	-55,679,248.18	-55,679,248.18
本期末	126,380,655.50	126,380,655.50

## 6.4.7.7.2 天弘中证智能汽车C

金额单位：人民币元

项目 (天弘中证智能汽车C)	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额

上年度末	788,226,710.82	788,226,710.82
本期申购	462,065,732.64	462,065,732.64
本期赎回（以“-”号填列）	-737,573,843.85	-737,573,843.85
本期末	512,718,599.61	512,718,599.61

注：申购含转换转入份额；赎回含转换转出份额。

#### 6.4.7.8 未分配利润

##### 6.4.7.8.1 天弘中证智能汽车A

单位：人民币元

项目 (天弘中证智能汽车A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-7,912,046.14	-12,902,385.90	-20,814,432.04
本期期初	-7,912,046.14	-12,902,385.90	-20,814,432.04
本期利润	-8,355,500.41	-3,548,698.49	-11,904,198.90
本期基金份额交易产生的变动数	-388,586.35	490,815.08	102,228.73
其中：基金申购款	-6,789,367.45	-7,725,708.34	-14,515,075.79
基金赎回款	6,400,781.10	8,216,523.42	14,617,304.52
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-16,656,132.90	-15,960,269.31	-32,616,402.21

##### 6.4.7.8.2 天弘中证智能汽车C

单位：人民币元

项目 (天弘中证智能汽车C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-53,787,333.31	-81,127,006.36	-134,914,339.67
本期期初	-53,787,333.31	-81,127,006.36	-134,914,339.67
本期利润	-45,097,758.39	-47,976,050.58	-93,073,808.97
本期基金份额交易产生的变动数	28,562,228.23	64,483,193.19	93,045,421.42
其中：基金申购款	-52,463,913.84	-66,790,338.42	-119,254,252.26
基金赎回款	81,026,142.07	131,273,531.61	212,299,673.68

本期已分配利润	-	-	-
本期末	-70,322,863.47	-64,619,863.75	-134,942,727.22

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年01月01日至2024年06月30日	
活期存款利息收入	239,872.62	
定期存款利息收入	-	
其他存款利息收入	-	
结算备付金利息收入	1,271.16	
其他	2,026.82	
合计	243,170.60	

#### 6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2024年01月01日至2024年06月30日	
卖出股票成交总额	257,169,633.28	
减：卖出股票成本总额	311,885,203.20	
减：交易费用	304,146.54	
买卖股票差价收入	-55,019,716.46	

#### 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	
	2024年01月01日至2024年06月30日	
债券投资收益——利息收入	2,702.70	
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-2,491.00	
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	211.70

#### 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 2024年01月01日至2024年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,632,160.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,602,491.00
减：应计利息总额	32,160.00
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-2,491.00

#### 6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期未取得资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期未取得贵金属投资收益。

#### 6.4.7.14 衍生工具收益

##### 6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期未取得买卖权证差价收入。

##### 6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期未取得其他衍生工具投资收益。

#### 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
----	-------------------------------

股票投资产生的股利收益	2,732,886.43
其中：证券出借权益补偿收入	376,962.81
基金投资产生的股利收益	-
合计	2,732,886.43

#### 6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
1.交易性金融资产	-51,524,749.07
——股票投资	-51,527,043.07
——债券投资	2,294.00
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-51,524,749.07

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
基金赎回费收入	129,698.78
基金转换费收入	6,146.16
合计	135,844.94

#### 6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内未发生信用减值损失。

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
审计费用	29,835.26
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
指数使用费	53,272.21
合计	142,779.81

#### 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 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
天弘基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
海通证券股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
海通证券股份有限公司	4,567,619.52	1.32%	-	-

#### 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 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
海通证券股份有限公司	1,122.94	0.73%	1,122.94	2.88%
关联方名称	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
-	-	-	-	-

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

2、本报告期及上年度可比期间，该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

#### 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 2024年01月01日至20 24年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至20 23年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,331,806.80	1,281,461.99
其中：应支付销售机构的客户维护费	597,805.35	441,065.49
应支付基金管理人的净管理费	734,001.45	840,396.50

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 2024年01月01日至2024 年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	266,361.28	256,292.43

注:支付基金托管人海通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。

##### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售	本期



服务费的各关联方名称	2024年01月01日至2024年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	天弘中证智能汽车A	天弘中证智能汽车C	合计
天弘基金管理有限公司	-	28,675.69	28,675.69
海通证券股份有限公司	-	1,210.85	1,210.85
合计	-	29,886.54	29,886.54
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2023年01月01日至2023年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	天弘中证智能汽车A	天弘中证智能汽车C	合计
天弘基金管理有限公司	-	47,951.94	47,951.94
海通证券股份有限公司	-	1,660.99	1,660.99
合计	-	49,612.93	49,612.93

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。天弘中证智能汽车C按0.20%计提销售服务费。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、天弘中证智能汽车A不收取销售服务费。

#### 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**

单位：人民币元

本期 2024年01月01日至2024年06月30日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
-	-	-	-	-
上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
海通证券股份有限公司	13,588,742.00	9,153.50	-	-

**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**

单位：人民币元

本期 2024年01月01日至2024年06月30日						
关联方名称	交易金额	费率区间(%)	加权平均费率(%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
海通证券股份有限公司	443,142,246.00	1.80~4.48	1.80	263,668.87	27,356,112.00	14,059.60
上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日						
关联方名称	交易金额	费率区间(%)	加权平均费率(%)	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
海通证券股份有限公司	48,372,329.00	3.00~4.16	3.85	32,637.44	33,920,729.00	14,762.36

**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**

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2024年01月01日至2024年0	2023年01月01日至2023年0

	6月30日		6月30日	
	天弘中证智能汽车A	天弘中证智能汽车C	天弘中证智能汽车A	天弘中证智能汽车C
报告期初持有的基金份额	5,000,263.94	5,000,263.89	5,000,263.94	5,000,263.89
报告期内申购/买入总份额	-	-	-	-
报告期内因拆分变动份额	-	-	-	-
减：报告期内赎回/卖出总份额	-	-	-	-
报告期末持有的基金份额	5,000,263.94	5,000,263.89	5,000,263.94	5,000,263.89
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	3.96%	0.98%	3.50%	0.88%

注：1、基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

2、报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例，比例的分母分别采用各自级别的份额总额计算。

#### 6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

天弘中证智能汽车A

无

天弘中证智能汽车C

无

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023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
海通证券股份有限公司	25,372,949.09	239,872.62	28,977,686.64	227,689.30

注：本基金由基金托管人海通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 2024年01月01日至2024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
海通证券股份有限公司	603344	星德胜	网下申购	1,813	34,773.34
海通证券股份有限公司	688691	灿芯股份	网下申购	2,461	48,875.46
海通证券股份有限公司	301565	中仑新材	网下申购	7,103	84,383.64
上年度可比期间 2023年01月01日至2023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
海通证券股份有限公司	688515	裕太微	网下申购	2,629	241,868.00
海通证券股份有限公司	001366	播恩集团	网下申购	645	6,011.40
海通证券股份有限公司	603153	上海建科	网下申购	740	8,487.80
海通证券股份有限公司	688531	日联科技	网下申购	1,442	219,731.96

海通证券股份有限公司	688507	索辰科技	网下申购	675	165,753.00
海通证券股份有限公司	688469	中芯集成	网下申购	41,191	234,376.79
海通证券股份有限公司	688443	智翔金泰	网下申购	9,878	374,178.64
海通证券股份有限公司	688620	安凯微	网下申购	10,157	108,476.76

#### 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

天弘中证智能汽车A

本报告期无利润分配事项。

天弘中证智能汽车C

本报告期无利润分配事项。

#### 6.4.12 期末（2024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
301589	诺瓦星云	2024-02-01	6个月	创业板打新限售	126.89	188.01	691	87,680.99	129,914.91	-

301589	诺瓦星云	2024-05-30	3个月	锁定期送股	-	188.01	553	-	103,969.53	-
688692	达梦数据	2024-06-04	6个月	科创板打新限售	86.96	174.93	161	14,000.56	28,163.73	-
603285	键邦股份	2024-06-28	1个月内(含)	新股未上市	18.65	18.65	1,287	24,002.55	24,002.55	-
603350	安乃达	2024-06-26	1个月内(含)	新股未上市	20.56	20.56	1,051	21,608.56	21,608.56	-
688709	成都华微	2024-01-31	6个月	科创板打新限售	15.69	18.79	1,045	16,396.05	19,635.55	-
301536	星辰科技	2024-03-20	6个月	创业板打新限售	16.16	32.27	481	7,772.96	15,521.87	-
601033	永兴股份	2024-01-11	6个月	新股锁定	16.20	15.96	920	14,904.00	14,683.20	-
688584	上海合晶	2024-02-01	6个月	科创板打新限售	22.66	15.89	866	19,623.56	13,760.74	-
301538	骏鼎达	2024-03-13	6个月	创业板打新限售	55.82	91.24	107	5,972.74	9,762.68	-
301538	骏鼎达	2024-05-2	4个月	锁定期送	-	91.24	43	-	3,923.32	-

		2		股							
301565	中仑新材	2024-06-13	6个月	创业板打新限售	11.88	18.98	711	8,446.68	13,494.78	-	
301580	C爱迪特	2024-06-19	6个月	创业板打新限售	44.95	65.93	202	9,079.90	13,317.86	-	
688691	灿芯股份	2024-04-02	6个月	科创板打新限售	19.86	42.51	247	4,905.42	10,499.97	-	
301566	达利凯普	2023-12-22	6个月	创业板打新限售	8.90	16.97	576	5,126.40	9,774.72	-	
301392	汇成真空	2024-05-28	6个月	创业板打新限售	12.20	41.66	219	2,671.80	9,123.54	-	
603341	龙旗科技	2024-02-23	6个月	新股锁定	26.00	37.49	237	6,162.00	8,885.13	-	
301591	肯特股份	2024-02-20	6个月	创业板打新限售	19.43	36.98	219	4,255.17	8,098.62	-	
301587	中瑞股份	2024-03-27	6个月	创业板打新限售	21.73	25.26	306	6,649.38	7,729.56	-	
001389	广合科技	2024-03-2	6个月	新股锁定	17.43	34.56	222	3,869.46	7,672.32	-	

		6								
301539	宏鑫科技	2024-04-03	6个月	创业板打新限售	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	-
688695	中创股份	2024-03-06	6个月	科创板打新限售	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-
688530	欧莱新材	2024-04-29	6个月	科创板打新限售	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-
301588	美新科技	2024-03-06	6个月	创业板打新限售	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-
301502	华阳智能	2024-01-26	6个月	创业板打新限售	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-
603325	博隆技术	2024-01-03	6个月	新股锁定	72.46	68.06	66	4,782.36	4,491.96	-
603381	C永臻	2024-06-19	6个月	新股锁定	23.35	25.13	178	4,156.30	4,473.14	-
603344	星德胜	2024-03-13	6个月	新股锁定	19.18	22.66	182	3,490.76	4,124.12	-
001359	平安电工	2024-03-19	6个月	新股锁定	17.39	20.60	184	3,199.76	3,790.40	-
603312	西典新能	2024-01-0	6个月	新股锁定	29.02	25.36	130	3,772.60	3,296.80	-



		4								
603082	北自科技	2024-01-23	6个月	新股锁定	21.28	29.49	107	2,276.96	3,155.43	-
001379	腾达科技	2024-01-11	6个月	新股锁定	16.98	13.48	213	3,616.74	2,871.24	-
603375	盛景微	2024-01-17	6个月	新股锁定	38.18	38.90	72	2,748.96	2,800.80	-
001387	雪祺电气	2024-01-04	6个月	新股锁定	15.38	15.25	133	2,045.54	2,028.25	-
001387	雪祺电气	2024-06-03	2个月	锁定期送股	-	15.25	40	-	610.00	-

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。

#### 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2024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抵押的债券。

##### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2024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抵押的债券。

#### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值 单价	数量（单 位：股）	期末估值 总额
1	000901	航天科技	2024年07月04日- 2024年07月04日	8.76	24,200	211,992.00
2	002036	联创电子	2024年07月04日- 2024年07月04日	6.75	75,800	511,650.00
3	002138	顺络电子	2024年07月04日- 2024年07月09日	27.46	67,600	1,856,296.0 0
4	002151	北斗星通	2024年07月04日- 2024年07月09日	24.18	30,600	739,908.00
5	002230	科大讯飞	2024年07月04日- 2024年07月09日	42.95	46,700	2,005,765.0 0
6	002273	水晶光电	2024年07月04日- 2024年07月04日	16.98	98,000	1,664,040.0 0
7	002284	亚太股份	2024年07月04日- 2024年07月09日	6.76	35,900	242,684.00
8	002373	千方科技	2024年07月04日- 2024年07月04日	9.07	36,400	330,148.00
9	002405	四维图新	2024年07月09日- 2024年07月09日	6.22	143,600	893,192.00
10	002456	欧菲光	2024年07月04日- 2024年07月04日	7.81	176,200	1,376,122.0 0
11	002463	沪电股份	2024年07月04日- 2024年07月09日	36.50	81,500	2,974,750.0 0
12	002475	立讯精密	2024年07月04日- 2024年07月09日	39.31	71,900	2,826,389.0 0
13	002765	蓝黛科技	2024年07月04日- 2024年07月09日	4.70	41,800	196,460.00
14	002881	美格智能	2024年07月04日- 2024年07月04日	19.84	4,300	85,312.00
15	002906	华阳集团	2024年07月04日- 2024年07月09日	26.76	17,200	460,272.00

16	002920	德赛西威	2024年07月04日- 2024年07月04日	87.09	10,900	949,281.00
17	300088	长信科技	2024年07月04日- 2024年07月09日	4.70	225,100	1,057,970.0 0
18	300098	高新兴	2024年07月04日- 2024年07月04日	4.43	123,500	547,105.00
19	300223	北京君正	2024年07月04日- 2024年07月09日	55.44	25,300	1,402,632.0 0
20	300496	中科创达	2024年07月04日- 2024年07月04日	45.59	9,100	414,869.00
21	300613	富瀚微	2024年07月04日- 2024年07月09日	32.91	10,700	352,137.00
22	300627	华测导航	2024年07月04日- 2024年07月09日	29.85	27,900	832,815.00
23	300638	广和通	2024年07月04日- 2024年07月09日	17.10	43,200	738,720.00
24	300978	东箭科技	2024年07月04日- 2024年07月04日	9.23	8,100	74,763.00
25	301221	光庭信息	2024年07月04日- 2024年07月04日	35.68	3,600	128,448.00
26	301488	豪恩汽电	2024年07月04日- 2024年07月09日	48.10	2,300	110,630.00
27	600699	均胜电子	2024年07月04日- 2024年07月09日	14.82	84,000	1,244,880.0 0
28	600718	东软集团	2024年07月04日- 2024年07月09日	8.27	90,500	748,435.00
29	600741	华域汽车	2024年07月04日- 2024年07月04日	16.38	105,000	1,719,900.0 0
30	600745	闻泰科技	2024年07月04日- 2024年07月09日	28.25	67,800	1,915,350.0 0
31	601633	长城汽车	2024年07月04日- 2024年07月04日	25.30	81,800	2,069,540.0 0

32	601689	拓普集团	2024年07月04日- 2024年07月04日	53.61	19,100	1,023,951.0 0
33	601799	星宇股份	2024年07月04日- 2024年07月09日	112.04	11,900	1,333,276.0 0
34	601965	中国汽研	2024年07月04日- 2024年07月04日	16.89	24,800	418,872.00
35	603005	晶方科技	2024年07月04日- 2024年07月04日	20.38	57,700	1,175,926.0 0
36	603197	保隆科技	2024年07月04日- 2024年07月09日	31.50	14,100	444,150.00
37	603236	移远通信	2024年07月04日- 2024年07月09日	46.73	10,800	504,684.00
38	603297	永新光学	2024年07月04日- 2024年07月04日	60.49	2,100	127,029.00
39	603501	韦尔股份	2024年07月04日- 2024年07月09日	99.37	28,100	2,792,297.0 0
40	603596	伯特利	2024年07月04日- 2024年07月09日	38.90	21,600	840,240.00
41	603786	科博达	2024年07月04日- 2024年07月09日	64.15	3,600	230,940.00
42	688022	瀚川智能	2024年07月04日- 2024年07月09日	13.71	8,900	122,019.00
43	688088	虹软科技	2024年07月04日- 2024年07月09日	28.86	20,900	603,174.00
44	688208	道通科技	2024年07月04日- 2024年07月09日	24.14	17,700	427,278.00
45	688326	经纬恒润	2024年07月04日- 2024年07月04日	57.33	2,300	131,859.00
46	688533	上声电子	2024年07月09日- 2024年07月09日	25.87	1,000	25,870.00
合计	-	-	-	-	2,115,100	40,884,020. 00

## 6.4.13 金融工具风险及管理

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型指数基金，采用指数复制投资策略，按照个股在标的指数中的基准权重构建股票组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应地调整，以复制和跟踪标的指数。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，力争获取高于标的指数的投资收益。本基金的基金管理人奉行全面风险管理理念，建立了以风险委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、内控合规部、风险管理部、内审部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。在全面风险管理体系的框架下，董事会负责监督检查公司的合法合规运营、内部控制、风险管理，从而控制公司的整体运营风险。在董事会下设立风险委员会，负责审议风险管理的宏观政策，指导监督公司风险管理目标的落实等；在管理层层面设立风险管理委员会，主要负责指导、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。在业务操作层面风险管理职责主要由内控合规部和风险管理部负责，内控合规部负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理提供合规控制标准，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标；内控合规部对公司总经理负责，并由督察长分管。风险管理部通过投资交易系统的风控参数设置，保证各投资组合的投资比例合规；参与各投资组合新股申购、一级债申购、银行间交易等场外交易的风险识别与评估，保证各投资组合场外交易的事中合规控制；负责各投资组合投资绩效、大类风险的识别、计量和控制。风险管理部由督察长分管。内审部对公司内部控制和风险管理的有效性，经营效率和效果等方面开展独立评价活动，向总经理和督察长汇报。本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

### 6.4.13.2 信用风险

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

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

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

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

#### 6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	507,807.53	1,631,086.47
合计	507,807.53	1,631,086.47

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

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级的资产支持证券。

#### 6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级的同业存单。

#### 6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

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。

于2024年6月30日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（净资产）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 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期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的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流

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

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

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

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

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元



本期末 2024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	25,372,949.09	-	-	-	25,372,949.09
结算备付金	46,971.60	-	-	-	46,971.60
存出保证金	186,221.08	-	-	-	186,221.08
交易性金融资产	507,807.53	-	-	447,243,102.82	447,750,910.35
应收股利	-	-	-	671.00	671.00
应收申购款	-	-	-	2,060,385.87	2,060,385.87
其他资产	-	-	-	17,189.85	17,189.85
资产总计	26,113,949.30	-	-	449,321,349.54	475,435,298.84
负债					
应付清算款	-	-	-	1,204,461.58	1,204,461.58
应付赎回款	-	-	-	2,231,420.22	2,231,420.22
应付管理人报酬	-	-	-	197,322.69	197,322.69
应付托管费	-	-	-	39,464.53	39,464.53
应付销售服务费	-	-	-	63,223.40	63,223.40
应交税费	-	-	-	5,941.98	5,941.98
其他负债	-	-	-	153,338.76	153,338.76
负债总计	-	-	-	3,895,173.16	3,895,173.16
利率敏感度缺口	26,113,949.30	-	-	445,426,176.38	471,540,125.68
上年度末 2023年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	37,272,265.33	-	-	-	37,272,265.33
结算备付金	133,746.49	-	-	-	133,746.49
存出保证金	396,705.09	-	-	-	396,705.09
交易性金融资产	1,631,086.47	-	-	719,861,891.45	721,492,977.92
应收申购款	-	-	-	4,252,276.82	4,252,276.82
其他资产	-	-	-	43,044.16	43,044.16
资产总计	39,433,803.38	-	-	724,157,212.43	763,591,015.81
负债					
应付清算款	-	-	-	308,780.04	308,780.04

应付赎回款	-	-	-	4,792,023.19	4,792,023.19
应付管理人报酬	-	-	-	318,723.90	318,723.90
应付托管费	-	-	-	63,744.78	63,744.78
应付销售服务费	-	-	-	109,616.91	109,616.91
应交税费	-	-	-	4,964.57	4,964.57
其他负债	-	-	-	294,160.19	294,160.19
负债总计	-	-	-	5,892,013.58	5,892,013.58
利率敏感度缺口	39,433,803.38	-	-	718,265,198.85	757,699,002.23

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2024年06月30日，本基金持有的交易性债券投资占基金净资产的比例为0.11%(2023年12月31日：0.22%)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响(2023年12月31日：同)。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023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	447,243,102.82	94.85	719,861,891.45	95.01
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	447,243,102.82	94.85	719,861,891.45	95.01

#### 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 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
	业绩比较基准上升5%	23,666,363.14	38,034,227.98
	业绩比较基准下降5%	-23,666,363.14	-38,034,227.98

#### 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 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	446,708,674.03	718,761,285.36
第二层次	553,418.64	1,631,086.47
第三层次	488,817.68	1,100,606.09
合计	447,750,910.35	721,492,977.92

##### 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。

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

##### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2024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(2023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	447,243,102.82	94.07
	其中：股票	447,243,102.82	94.07
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	507,807.53	0.11
	其中：债券	507,807.53	0.11
	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	25,419,920.69	5.35
8	其他各项资产	2,264,467.80	0.48
9	合计	475,435,298.84	100.00

注：本报告期末，本基金参与转融通证券出借业务出借证券的公允价值为40,884,020.00元，占基金资产净值的比例为8.67%。

## 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	-	-
C	制造业	365,087,006.95	77.42
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	76,704,988.08	16.27

	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	4,916,679.00	1.04
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	446,708,674.03	94.73

### 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	475,213.59	0.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	44,532.00	0.01
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	14,683.20	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	534,428.79	0.11

### 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	002475	立讯精密	684,957	26,925,659.67	5.71
2	002463	沪电股份	673,419	24,579,793.50	5.21
3	002230	科大讯飞	530,475	22,783,901.25	4.83
4	601633	长城汽车	892,590	22,582,527.00	4.79
5	603501	韦尔股份	220,237	21,884,950.69	4.64
6	600741	华域汽车	1,143,492	18,730,398.96	3.97
7	002456	欧菲光	2,363,200	18,456,592.00	3.91
8	601689	拓普集团	337,432	18,089,729.52	3.84
9	600745	闻泰科技	631,073	17,827,812.25	3.78
10	002920	德赛西威	201,301	17,531,304.09	3.72
11	002273	水晶光电	1,008,816	17,129,695.68	3.63
12	002138	顺络电子	584,926	16,062,067.96	3.41
13	300223	北京君正	244,576	13,559,293.44	2.88
14	300496	中科创达	267,000	12,172,530.00	2.58

15	603596	伯特利	307,992	11,980,888.80	2.54
16	601799	星宇股份	103,600	11,607,344.00	2.46
17	002405	四维图新	1,724,870	10,728,691.40	2.28
18	600699	均胜电子	715,269	10,600,286.58	2.25
19	603005	晶方科技	473,424	9,648,381.12	2.05
20	300088	长信科技	1,780,800	8,369,760.00	1.77
21	300627	华测导航	237,400	7,086,390.00	1.50
22	002151	北斗星通	276,000	6,673,680.00	1.42
23	603236	移远通信	134,363	6,278,782.99	1.33
24	002373	千方科技	687,700	6,237,439.00	1.32
25	688088	虹软科技	206,151	5,949,517.86	1.26
26	600718	东软集团	704,200	5,823,734.00	1.24
27	300638	广和通	333,310	5,699,601.00	1.21
28	300098	高新兴	1,260,500	5,584,015.00	1.18
29	002036	联创电子	775,110	5,231,992.50	1.11
30	601965	中国汽研	291,100	4,916,679.00	1.04
31	688208	道通科技	196,714	4,748,675.96	1.01
32	002906	华阳集团	152,200	4,072,872.00	0.86
33	603786	科博达	58,592	3,758,676.80	0.80
34	000901	航天科技	405,331	3,550,699.56	0.75
35	300552	万集科技	92,770	3,467,742.60	0.74
36	603197	保隆科技	107,700	3,392,550.00	0.72
37	300613	富瀚微	83,391	2,744,397.81	0.58
38	300304	云意电气	381,800	2,485,518.00	0.53
39	300590	移为通信	198,880	2,271,209.60	0.48
40	002284	亚太股份	320,400	2,165,904.00	0.46
41	688326	经纬恒润	34,727	1,990,898.91	0.42
42	603297	永新光学	32,300	1,953,827.00	0.41
43	002881	美格智能	94,500	1,874,880.00	0.40
44	002766	索菱股份	373,500	1,807,740.00	0.38
45	002970	锐明技术	50,000	1,801,500.00	0.38



46	002870	香山股份	57,200	1,706,276.00	0.36
47	688787	海天瑞声	30,690	1,684,267.20	0.36
48	002765	蓝黛科技	331,600	1,558,520.00	0.33
49	688022	瀚川智能	88,874	1,218,462.54	0.26
50	002829	星网宇达	90,040	1,205,635.60	0.26
51	301221	光庭信息	33,492	1,194,994.56	0.25
52	300978	东箭科技	122,100	1,126,983.00	0.24
53	301488	豪恩汽电	19,962	960,172.20	0.20
54	002813	路畅科技	34,700	925,102.00	0.20
55	688533	上声电子	34,589	894,817.43	0.19
56	603390	通达电气	101,600	857,504.00	0.18
57	605005	合兴股份	34,800	555,408.00	0.12

### 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	301589	诺瓦星云	1,244	233,884.44	0.05
2	688692	达梦数据	161	28,163.73	0.01
3	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.01
4	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.00
5	688709	成都华微	1,045	19,635.55	0.00
6	301536	星宸科技	481	15,521.87	0.00
7	601033	永兴股份	920	14,683.20	0.00
8	688584	上海合晶	866	13,760.74	0.00
9	301538	骏鼎达	150	13,686.00	0.00
10	301565	中仑新材	711	13,494.78	0.00
11	301580	C爱迪特	202	13,317.86	0.00
12	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
13	301566	达利凯普	576	9,774.72	0.00

14	301392	汇成真空	219	9,123.54	0.00
15	603341	龙旗科技	237	8,885.13	0.00
16	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
17	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
18	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
19	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
20	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
21	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
22	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
23	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
24	603325	博隆技术	66	4,491.96	0.00
25	603381	C永臻	178	4,473.14	0.00
26	603344	星德胜	182	4,124.12	0.00
27	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00
28	603312	西典新能	130	3,296.80	0.00
29	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
30	001379	腾达科技	213	2,871.24	0.00
31	603375	盛景微	72	2,800.80	0.00
32	001387	雪祺电气	173	2,638.25	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002230	科大讯飞	6,759,686.55	0.89
2	002456	欧菲光	6,129,148.00	0.81
3	600745	闻泰科技	5,180,882.00	0.68
4	002475	立讯精密	4,291,653.00	0.57
5	300223	北京君正	4,043,939.00	0.53

6	002463	沪电股份	3,756,150.60	0.50
7	603501	韦尔股份	3,502,445.00	0.46
8	002920	德赛西威	3,425,051.00	0.45
9	601633	长城汽车	3,406,054.00	0.45
10	601689	拓普集团	3,147,825.00	0.42
11	600741	华域汽车	3,045,219.00	0.40
12	300496	中科创达	2,748,875.00	0.36
13	002138	顺络电子	2,443,475.00	0.32
14	601799	星宇股份	2,185,732.00	0.29
15	002405	四维图新	2,149,565.00	0.28
16	603596	伯特利	2,127,508.00	0.28
17	002273	水晶光电	2,062,011.00	0.27
18	600699	均胜电子	1,917,689.00	0.25
19	300088	长信科技	1,619,250.00	0.21
20	603005	晶方科技	1,494,660.40	0.20

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	002463	沪电股份	21,384,166.80	2.82
2	002475	立讯精密	18,997,233.00	2.51
3	002230	科大讯飞	18,415,086.07	2.43
4	603501	韦尔股份	14,462,466.10	1.91
5	600745	闻泰科技	11,859,547.00	1.57
6	601633	长城汽车	10,657,202.00	1.41
7	002920	德赛西威	10,377,247.00	1.37
8	600741	华域汽车	10,087,694.00	1.33

9	601689	拓普集团	8,169,981.00	1.08
10	002138	顺络电子	7,583,402.56	1.00
11	300496	中科创达	7,419,483.95	0.98
12	002456	欧菲光	7,345,545.00	0.97
13	601799	星宇股份	7,226,263.00	0.95
14	603596	伯特利	6,379,280.00	0.84
15	002405	四维图新	6,331,367.10	0.84
16	002273	水晶光电	6,113,357.00	0.81
17	600699	均胜电子	5,832,212.68	0.77
18	300223	北京君正	5,777,780.00	0.76
19	002373	千方科技	5,132,194.00	0.68
20	300088	长信科技	4,599,820.80	0.61

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	90,793,457.64
卖出股票收入（成交）总额	257,169,633.28

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	507,807.53	0.11
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-

7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	507,807.53	0.11

#### 7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	019709	23国债16	5,000	507,807.53	0.11

#### 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

#### 7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

#### 7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本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，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

#### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	186,221.08
2	应收清算款	-
3	应收股利	671.00
4	应收利息	-
5	应收申购款	2,060,385.87
6	其他应收款	17,189.85
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,264,467.80

#### 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

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	002463	沪电股份	2,974,750.00	0.63	转融通证券出借
2	002475	立讯精密	2,826,389.00	0.60	转融通证券出借
3	603501	韦尔股份	2,792,297.00	0.59	转融通证券出借
4	601633	长城汽车	2,069,540.00	0.44	转融通证券出借
5	002230	科大讯飞	2,005,765.00	0.43	转融通证券出借
6	600745	闻泰科技	1,915,350.00	0.41	转融通证券出借
7	600741	华域汽车	1,719,900.00	0.36	转融通证券出借
8	002456	欧菲光	1,376,122.00	0.29	转融通证券出借
9	601689	拓普集团	1,023,951.00	0.22	转融通证券出借
10	002920	德赛西威	949,281.00	0.20	转融通证券出借

##### 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	301589	诺瓦星云	233,884.44	0.05	创业板打新限售
2	688692	达梦数据	28,163.73	0.01	科创板打新限售
3	603285	键邦股份	24,002.55	0.01	新股未上市
4	603350	安乃达	21,608.56	0.00	新股未上市
5	688709	成都华微	19,635.55	0.00	科创板打新限售

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
天弘中证智能汽车A	15,310	8,254.78	5,000,263.94	3.96%	121,380,391.56	96.04%
天弘中证智能汽车C	76,227	6,726.21	62,108,010.48	12.11%	450,610,589.13	87.89%
合计	90,388	7,070.62	67,108,274.42	10.50%	571,990,980.69	89.50%

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

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比 例
基金管理人所有从业人员持有本基金	天弘中证智能汽车A	187,069.49	0.15%
	天弘中证智能汽车C	201,056.57	0.04%
	合计	388,126.06	0.06%

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区 间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式 基金	天弘中证智能汽车 A	0
	天弘中证智能汽车 C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基 金	天弘中证智能汽车 A	0~10
	天弘中证智能汽车 C	0~10
	合计	0~10

## 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额 占基金总 份额比例	发起份额总数	发起份额 占基金总 份额比例	发起份额 承诺持有 期限
基金管理人固有 资金	10,000,527.83	1.56%	10,000,527.83	1.56%	三年
基金管理人高 级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人	-	-	-	-	-



员					
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,527.83	1.56%	10,000,527.83	1.56%	-

注：本基金成立后有10,000,527.83份为发起份额，发起份额承诺的持有期限为2021年01月19日至2024年01月19日。

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

	天弘中证智能汽车A	天弘中证智能汽车C
基金合同生效日(2021年01月19日)基金份额总额	106,506,090.62	649,159,227.16
本报告期期初基金份额总额	125,201,063.12	788,226,710.82
本报告期基金总申购份额	56,858,840.56	462,065,732.64
减：本报告期基金总赎回份额	55,679,248.18	737,573,843.85
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	126,380,655.50	512,718,599.61

## §10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，聂挺进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》。

本报告期内，无重大人事变动。

### 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、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员未发生受稽查或处罚的情况。

### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内托管人及其高级管理人员无受稽查或处罚等情况。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 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	
长江证券	1	86,184,049.89	24.91%	38,430.44	25.06%	-
东方财富证券	2	-	-	-	-	-
海通证券	6	4,567,619.52	1.32%	1,122.94	0.73%	-
华创证券	3	255,256,122.02	73.77%	113,819.73	74.21%	-
华西证券	1	-	-	-	-	-
天风	1	-	-	-	-	-

证券						
西部 证券	1	-	-	-	-	-

注：1、基金专用交易单元的选择标准为：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、基金专用交易单元的选择程序：本基金管理人根据上述标准进行考察后，确定选用交易席位的证券经营机构。然后基金管理人和被选用的证券经营机构签订交易席位租用协议。

3、本基金报告期内新租用交易单元：华创证券北交所交易单元、华西证券北交所交易单元。

4、本基金报告期内停止租用交易单元：无。

### 10.7.2 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
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华创证券	500,137.00	100.00%	3,000,000.00	100.00%	-	-	-	-
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-

### 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	天弘中证智能汽车主题指数型发起式证券投资基金2023年第4季度报告	中国证监会规定媒介	2024-01-22

2	天弘基金将严格落实《证监会新闻发言人就“两融”融券业务有关情况答记者问》相关要求	中国证监会规定媒介	2024-02-06
3	天弘基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告	中国证监会规定媒介	2024-03-15
4	天弘中证智能汽车主题指数型发起式证券投资基金2023年年度报告	中国证监会规定媒介	2024-03-29
5	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	2024-03-30
6	天弘基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告	中国证监会规定媒介	2024-04-04
7	天弘中证智能汽车主题指数型发起式证券投资基金2024年第1季度报告	中国证监会规定媒介	2024-04-22
8	天弘基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告	中国证监会规定媒介	2024-06-15
9	天弘中证智能汽车主题指数型发起式证券投资基金（A类份额）基金产品资料概要（更新）	中国证监会规定媒介	2024-06-28
10	天弘中证智能汽车主题指数型发起式证券投资基金（C类份额）基金产品资料概要（更新）	中国证监会规定媒介	2024-06-28

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

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

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

## §12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准天弘中证智能汽车主题指数型发起式证券投资基金募集的文件
- 2、天弘中证智能汽车主题指数型发起式证券投资基金基金合同
- 3、天弘中证智能汽车主题指数型发起式证券投资基金托管协议
- 4、天弘中证智能汽车主题指数型发起式证券投资基金招募说明书
- 5、报告期内在指定报刊上披露的各项公告
- 6、中国证监会规定的其他文件

### 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](http://www.thfund.com.cn)

天弘基金管理有限公司  
二〇二四年八月三十日