

天弘中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

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:国泰海通证券股份有限公司

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。

基金托管人国泰海通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	7
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	8
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	9
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	16
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	17
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	17
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	17
6.1 资产负债表	17
6.2 利润表	19
6.3 净资产变动表	21
6.4 报表附注	22
§7 投资组合报告	50
7.1 期末基金资产组合情况	50
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	51
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	52
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	68
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	70
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	71
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	71
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	71
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	71
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细	71
7.11 本基金投资股指期货的投资政策	71
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	72
7.13 投资组合报告附注	72
§8 基金份额持有人信息	73
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	73

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	74
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	74
§9 开放式基金份额变动	75
§10 重大事件揭示	75
10.1 基金份额持有人大会决议	75
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	75
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	75
10.4 基金投资策略的改变	75
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	76
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	76
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	76
10.8 其他重大事件	79
§11 影响投资者决策的其他重要信息	80
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	80
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	80
§12 备查文件目录	81
12.1 备查文件目录	81
12.2 存放地点	81
12.3 查阅方式	81

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金		
基金简称	天弘中证500ETF联接		
基金主代码	000962		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2015年01月20日		
基金管理人	天弘基金管理有限公司		
基金托管人	国泰海通证券股份有限公司		
报告期末基金份额总额	1,126,875,121.31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500 ETF联接A	天弘中证500 ETF联接C	天弘中证500 ETF联接Y
下属分级基金的交易代码	000962	005919	022961
报告期末下属分级基金的份额总额	713,898,315.7 4份	393,101,785.4 6份	19,875,020.11 份

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	159820
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2020年08月07日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2020年08月24日
基金管理人名称	天弘基金管理有限公司
基金托管人名称	国泰海通证券股份有限公司

2.2 基金产品说明

投资目标	通过投资于目标ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
------	--------------------------------------

投资策略	本基金为目标ETF的联接基金，目标ETF是采用完全复制法实现对标的指数紧密跟踪的全被动指数基金。本基金通过把全部或接近全部的基金资产投资于目标ETF、标的指数成份股和备选成份股进行被动式指数化投资，实现对业绩比较基准的紧密跟踪。正常情况下，本基金投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%，日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%。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。
业绩比较基准	中证500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。

2.2.1 目标基金产品说明

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

	投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、参与融资及转融通证券出借业务策略、存托凭证投资策略等。
业绩比较基准	中证500指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		天弘基金管理有限公司	国泰海通证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	童建林	帅芳
	联系电话	022-83310208	021-38677947
	电子邮箱	service@thfund.com.cn	tgrxp@tg.gtht.com
客户服务电话		400-986-8888	021-38917599-5
传真		022-83865564	021-50872603
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	中国（上海）自由贸易试验区商城路618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	上海市静安区新闻路669号博华广场19楼
邮政编码		300203	200041
法定代表人		黄辰立	朱健

2.4 信息披露方式

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

基金中期报告置备地点	基金管理人及基金托管人的办公地址
------------	------------------

2.5 其他相关资料

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2026年01月01日-2026年06月30日)		
	天弘中证500ETF联接A	天弘中证500ETF联接C	天弘中证500ETF联接Y
本期已实现收益	81,781,984.43	45,466,866.41	1,860,757.69
本期利润	247,138,051.04	129,441,363.32	4,379,405.27
加权平均基金份额本期利润	0.3157	0.2807	0.2566
本期加权平均净值利润率	19.54%	17.22%	15.84%
本期基金份额净值增长率	21.20%	21.08%	21.23%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2026年06月30日)		
	天弘中证500ETF联接A	天弘中证500ETF联接C	天弘中证500ETF联接Y
期末可供分配利润	93,978,635.36	172,495,178.12	2,628,340.02
期末可供分配基金份额利润	0.1316	0.4388	0.1322
期末基金资产净值	1,264,672,327.68	702,122,877.90	35,222,461.91
期末基金份额净值	1.7715	1.7861	1.7722
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	77.15%	78.61%	54.45%
-------------	--------	--------	--------

- 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500ETF联接A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	18.69%	1.56%	17.61%	1.56%	1.08%	0.00%
过去六个月	21.20%	1.57%	19.93%	1.58%	1.27%	-0.01%
过去一年	52.73%	1.35%	49.68%	1.35%	3.05%	0.00%
过去三年	55.37%	1.40%	48.15%	1.41%	7.22%	-0.01%
过去五年	44.04%	1.29%	31.61%	1.30%	12.43%	-0.01%
过去七年	109.57%	1.28%	78.59%	1.29%	30.98%	-0.01%
过去十年	77.84%	1.27%	46.44%	1.28%	31.40%	-0.01%
自基金合同 生效日起至 今	77.15%	1.53%	69.68%	1.52%	7.47%	0.01%

天弘中证500ETF联接C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	18.62%	1.56%	17.61%	1.56%	1.01%	0.00%
过去六个月	21.08%	1.58%	19.93%	1.58%	1.15%	0.00%

过去一年	52.42%	1.35%	49.68%	1.35%	2.74%	0.00%
过去三年	54.43%	1.40%	48.15%	1.41%	6.28%	-0.01%
过去五年	42.60%	1.29%	31.61%	1.30%	10.99%	-0.01%
过去七年	106.65%	1.28%	78.59%	1.29%	28.06%	-0.01%
自基金份额 首次确认日 起至今	78.61%	1.33%	50.11%	1.34%	28.50%	-0.01%

天弘中证500ETF联接Y

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	18.69%	1.56%	17.61%	1.56%	1.08%	0.00%
过去六个月	21.23%	1.57%	19.93%	1.58%	1.30%	-0.01%
过去一年	52.78%	1.35%	49.68%	1.35%	3.10%	0.00%
自基金份额 首次确认日 起至今	54.45%	1.33%	49.85%	1.33%	4.60%	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500ETF联接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
(2015年01月20日-2026年06月30日)



天弘中证500ETF联接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
(2018年04月25日-2026年06月30日)





注：1、本基金合同于2015年01月20日生效。

2、本报告期内，本基金的各项投资比例达到基金合同约定的各项比例要求。

3、本基金自2018年04月24日起增设天弘中证500ETF联接C基金份额。天弘中证500ETF联接C基金份额的首次确认日为2018年04月25日。本基金自2024年12月13日起增设天弘中证500ETF联接Y基金份额。天弘中证500ETF联接Y基金份额的首次确认日为2024年12月17日。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

截至2026年06月30日，公司共管理运作267只公募基金，公司业务范围涵盖二级市场股票投资、债券投资、现金管理、衍生品投资等。公司始终秉承“稳健理财，值得信赖”的理念，坚持为投资者带来优质的基金产品和理财服务。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金 经理（助理） 期限		证券 从业 年限	说明
		任职 日期	离任 日期		
陈瑶	指数投资部总经理 助理、本基金基金经 理	2020 年08 月08 日	-	15年	女，金融学硕士。2011年7月加盟本公司，历任交易员、交易主管，从事交易管理、程序化交易策略、基差交易策略、融资融券交易策略等研究工作。
尤聪	本基金基金经理助 理	2024 年08 月02 日	-	13年	女，计算金融与风险管理专业硕士。历任华盛顿大学资产管理公司量化研究员、北美信托银行信用风险管理顾问、北美信托资产管理公司股票量化投资经理。2021年10月加盟本公司。

注：1、上述任职日期/离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。
2、基金经理助理协助基金经理进行投资、研究、头寸管理等日常工作。
3、证券从业的含义遵从《证券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

本基金由原天弘中证500指数型发起式证券投资基金转型而来。

截至本报告期末，本基金主要持有天弘中证500ETF及指数成分股，仍采用被动复制策略，其目标为跟踪效果与直接持有指数成分股的效果一致。

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

出于基金充分投资、减少交易成本、降低跟踪误差的需要，基于谨慎原则，报告期内本基金运用股指期货工具对基金投资组合进行管理。根据风险管理的原则，本基金在报告期内运用股指期货工具旨在提高投资效率，控制基金投资组合风险水平，力求更好地实现本基金的投资目标。

控制联接基金跟踪误差的前提是控制ETF基金的跟踪误差。报告期内，本基金跟踪误差的来源主要是申购赎回、打新、成分股调整以及ETF对指数的跟踪误差。当由于申赎等情况可能对指数跟踪效果带来影响时，本基金坚持既定的指数化投资策略，对指数基金采取被动复制与组合优化相结合的方式跟踪指数。在ETF的跟踪误差管理上，我们坚持指数化投资原则，同时紧密跟踪成分股的权息事件，及时有效处理，避免权重偏离造成跟踪误差的扩大，争取保障联接基金的跟踪效果。

报告期内，本联接基金整体运行平稳。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2026年06月30日，天弘中证500ETF联接A基金份额净值为1.7715元，天弘中证500ETF联接C基金份额净值为1.7861元，天弘中证500ETF联接Y基金份额净值为1.7722元。报告期内份额净值增长率天弘中证500ETF联接A为21.20%，同期业绩比较基准增长率为19.93%；天弘中证500ETF联接C为21.08%，同期业绩比较基准增长率为19.93%；天弘中证500ETF联接Y为21.23%，同期业绩比较基准增长率为19.93%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

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

有限。投资端结构性分化特征明显。上半年房地产投资持续下行，专项债发行节奏偏慢，拖累基建整体增速表现平淡。下半年随着专项债发行提速，叠加超长期特别国债、政策性金融工具落地见效，基建投资将持续发挥托底经济的作用。制造业投资延续分化格局，传统产能持续出清，高技术产业投资保持高增，成为制造业投资的核心支撑，该结构性趋势预计下半年延续。

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

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金管理人设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构，负责制定公司所管理基金的基本估值政策，对公司旗下基金已采用的估值政策、方法、流程的执行情况进行审核监督，确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益。

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，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，国泰海通证券股份有限公司（以下称"本托管人"）在天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金（以下称"本基金"）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、利润分配等情况进行了复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核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，认为其真实、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500交易型开放式指数证券投资基金联接基金
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	118,503,595.38	94,201,340.66
结算备付金		12,060,953.02	9,571,458.32
存出保证金		3,193,347.36	2,242,800.59
交易性金融资产	6.4.7.2	1,877,418,429.92	1,827,850,417.23
其中：股票投资		34,535,158.81	28,674,551.49
基金投资		1,842,877,270.83	1,789,772,123.60
债券投资		6,000.28	9,403,742.14
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		2,742,155.56	11,256,816.77
应收股利		-	-
应收申购款		4,347,615.57	4,285,910.16
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		2,018,266,096.81	1,949,408,743.73
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		797.00	2,792,206.70
应付赎回款		15,891,265.83	14,112,139.90
应付管理人报酬		63,360.53	51,655.33
应付托管费		12,716.66	10,336.57
应付销售服务费		112,367.62	106,822.40
应付投资顾问费		-	-
应交税费		32,582.24	7,259.21
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	135,339.44	236,413.39
负债合计		16,248,429.32	17,316,833.50
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	1,126,875,121.31	1,317,836,798.26

未分配利润	6.4.7.8	875,142,546.18	614,255,111.97
净资产合计		2,002,017,667.49	1,932,091,910.23
负债和净资产总计		2,018,266,096.81	1,949,408,743.73

注：报告截止日2026年06月30日，天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金A类基金份额净值1.7715元，天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金C类基金份额净值1.7861元，天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金Y类基金份额净值1.7722元；基金份额总额1,126,875,121.31份，其中天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金A类基金份额713,898,315.74份，天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金C类基金份额393,101,785.46份，天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金Y类基金份额19,875,020.11份。

6.2 利润表

会计主体：天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026年01月01日至 2026年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至202 5年06月30日
一、营业总收入		382,288,009.75	99,649,022.85
1.利息收入		875,775.42	816,152.41
其中：存款利息收入	6.4.7.9	875,775.42	816,152.41
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息 收入		-	-
买入返售金融资产 收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-” 填列）		129,465,280.02	-3,366,146.85
其中：股票投资收益	6.4.7.10	4,530,081.65	-453,421.80
基金投资收益	6.4.7.11	122,044,305.33	-3,670,105.28
债券投资收益	6.4.7.12	11,979.51	63,557.48

资产支持证券投资 收益	6.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	2,609,084.17	-
股利收益	6.4.7.16	269,829.36	693,822.75
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	6.4.7.17	251,849,211.10	102,171,463.60
4.汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.18	97,743.21	27,553.69
减：二、营业总支出		1,329,190.12	1,432,215.64
1.管理人报酬		394,250.35	466,960.66
2.托管费		79,065.18	93,402.62
3.销售服务费		746,710.87	772,078.16
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	6.4.7.19	-	-
7.税金及附加		9,405.28	-
8.其他费用	6.4.7.20	99,758.44	99,774.20
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		380,958,819.63	98,216,807.21
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		380,958,819.63	98,216,807.21
五、其他综合收益的税后 净额		-	-
六、综合收益总额		380,958,819.63	98,216,807.21

6.3 净资产变动表

会计主体：天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金

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	1,317,836,798.26	614,255,111.97	1,932,091,910.23
二、本期期初净资产	1,317,836,798.26	614,255,111.97	1,932,091,910.23
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-190,961,676.95	260,887,434.21	69,925,757.26
（一）、综合收益总额	-	380,958,819.63	380,958,819.63
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	-190,961,676.95	-120,071,385.42	-311,033,062.37
其中：1.基金申购款	666,931,803.39	414,075,349.51	1,081,007,152.90
2.基金赎回款	-857,893,480.34	-534,146,734.93	-1,392,040,215.27
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	1,126,875,121.31	875,142,546.18	2,002,017,667.49
项 目	上年度可比期间		
	2025年01月01日至2025年06月30日		

	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	2,108,309,333.73	247,819,431.93	2,356,128,765.66
二、本期期初净资产	2,108,309,333.73	247,819,431.93	2,356,128,765.66
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-232,108,775.60	59,672,972.35	-172,435,803.25
（一）、综合收益总额	-	98,216,807.21	98,216,807.21
（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）	-232,108,775.60	-38,543,834.86	-270,652,610.46
其中：1.基金申购款	527,776,666.88	65,410,649.40	593,187,316.28
2.基金赎回款	-759,885,442.48	-103,954,484.26	-863,839,926.74
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	1,876,200,558.13	307,492,404.28	2,183,692,962.41

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500交易型开放式指数证券投资基金联接基金（以下简称“本基金”）由天弘中证500指数型发起式证券投资基金变更而来，天弘中证500指数型发起式证券投资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[2014]1364号《关于准予天弘中证500指数型发起式证券投资基金注册的批复》的准许，由基金管理人天弘基金管理有限公司向社会公开发行人募集，基金合同于2015年01月20日生效，首次设立募集规模为10,000,000.00份基金份额。本基金的运作方式为契约型开放式，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，基金托管人为国泰海通证券股份有限公司。

根据基金管理人于2020年08月08日发布的《关于天弘中证500指数型发起式证券投资基金变更为天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金并相应修订基金合同的公告》，原天弘中证500指数型发起式证券投资基金于2020年08月08日变更为天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，以目标ETF、标的指数成份股以及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核准的上市股票）、存托凭证、银行存款、债券、债券回购、权证、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）。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。本基金投资于目标ETF的资产比例不低于基金资产的90%（已申购但尚未确认的目标ETF份额可计入在内）；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。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2026年度上半年财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2026年06月30日的财务状况以及2026年度上半年的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

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

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

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

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

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

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

对投资者从本基金分配中取得的收入,暂不征收企业所得税。

c) 对本基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司(“挂牌公司”)取得的股息红利所得,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂免征收个人所得税。对本基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日
活期存款	118,503,595.38
等于：本金	118,458,016.51
加：应计利息	45,578.87
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	118,503,595.38

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		32,959,871.04	-	34,535,158.81	1,575,287.77
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	6,000.00	0.28	6,000.28	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	6,000.00	0.28	6,000.28	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		1,200,017,936.27	-	1,842,877,270.83	642,859,334.56
其他		-	-	-	-
合计		1,232,983,807.31	0.28	1,877,418,429.92	644,434,622.33

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

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	22,408,360.00	-	-	-
--股指期货	22,408,360.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	22,408,360.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2612	IC2612	8.00	13,667,840.00	547,480.00
IC2609	IC2609	6.00	10,513,680.00	1,225,680.00
合计				1,773,160.00
减：可抵销 期货暂收 款				1,773,160.00
净额				-

注：1、买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

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

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	3,355.22
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	36,736.25
其中：交易所市场	36,736.25
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	95,247.97
合计	135,339.44

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 天弘中证500ETF联接A

金额单位：人民币元

项目 (天弘中证500ETF联接A)	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	869,216,969.11	869,216,969.11
本期申购	199,124,439.11	199,124,439.11
本期赎回（以“-”号填列）	-354,443,092.48	-354,443,092.48
本期末	713,898,315.74	713,898,315.74

6.4.7.7.2 天弘中证500ETF联接C

金额单位：人民币元

项目 (天弘中证500ETF联接C)	本期	
	2026年01月01日至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	443,484,256.19	443,484,256.19
本期申购	443,171,023.04	443,171,023.04
本期赎回（以“-”号填列）	-493,553,493.77	-493,553,493.77
本期末	393,101,785.46	393,101,785.46

6.4.7.7.3 天弘中证500ETF联接Y

金额单位：人民币元

项目 (天弘中证500ETF联接Y)	本期	
	2026年01月01日至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	5,135,572.96	5,135,572.96
本期申购	24,636,341.24	24,636,341.24
本期赎回（以“-”号填列）	-9,896,894.09	-9,896,894.09
本期末	19,875,020.11	19,875,020.11

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500ETF联接A

单位：人民币元

项目 (天弘中证500ETF联接A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	22,704,599.43	378,489,460.63	401,194,060.06
本期期初	22,704,599.43	378,489,460.63	401,194,060.06
本期利润	81,781,984.43	165,356,066.61	247,138,051.04
本期基金份额交易产生的变动数	-10,507,948.50	-87,050,150.66	-97,558,099.16
其中：基金申购款	13,525,353.94	108,582,084.21	122,107,438.15
基金赎回款	-24,033,302.44	-195,632,234.87	-219,665,537.31

本期已分配利润	-	-	-
本期末	93,978,635.36	456,795,376.58	550,774,011.94

6.4.7.8.2 天弘中证500ETF联接C

单位：人民币元

项目 (天弘中证500ETF联接 C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	148,119,119.86	62,569,769.89	210,688,889.75
本期期初	148,119,119.86	62,569,769.89	210,688,889.75
本期利润	45,466,866.41	83,974,496.91	129,441,363.32
本期基金份额交易产 生的变动数	-21,090,808.15	-10,018,352.48	-31,109,160.63
其中：基金申购款	163,774,251.76	113,233,613.86	277,007,865.62
基金赎回款	-184,865,059.91	-123,251,966.34	-308,117,026.25
本期已分配利润	-	-	-
本期末	172,495,178.12	136,525,914.32	309,021,092.44

6.4.7.8.3 天弘中证500ETF联接Y

单位：人民币元

项目 (天弘中证500ETF联接 Y)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	135,782.62	2,236,379.54	2,372,162.16
本期期初	135,782.62	2,236,379.54	2,372,162.16
本期利润	1,860,757.69	2,518,647.58	4,379,405.27
本期基金份额交易产 生的变动数	631,799.71	7,964,074.66	8,595,874.37
其中：基金申购款	1,462,346.63	13,497,699.11	14,960,045.74
基金赎回款	-830,546.92	-5,533,624.45	-6,364,171.37
本期已分配利润	-	-	-
本期末	2,628,340.02	12,719,101.78	15,347,441.80

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	817,204.59
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	57,902.60
其他	668.23
合计	875,775.42

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	3,553,677.61
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	976,404.04
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	4,530,081.65

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	298,132,926.91
减：卖出股票成本总额	294,319,088.34
减：交易费用	260,160.96
买卖股票差价收入	3,553,677.61

6.4.7.10.3 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
申购基金份额总额	81,441,082.19
减：现金支付申购款总额	42,892,796.30
减：申购股票成本总额	37,571,881.85
减：交易费用	-
申购差价收入	976,404.04

6.4.7.11 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
卖出/赎回基金成交总额	419,827,402.52
减：卖出/赎回基金成本总额	297,778,994.42
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	-
减：交易费用	4,102.77
基金投资收益	122,044,305.33

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 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	4,138.48
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	7,841.03
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	11,979.51

6.4.7.12.2 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	9,417,445.76
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	9,301,724.00
减：应计利息总额	107,880.34
减：交易费用	0.39
买卖债券差价收入	7,841.03

6.4.7.13 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。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期未取得贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 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。

6.4.7.15.2 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	2,609,084.17

6.4.7.16 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	269,829.36
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	269,829.36

6.4.7.17 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	250,812,261.10
——股票投资	1,131,860.64
——债券投资	-3,676.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	249,684,076.46
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	1,036,950.00
——权证投资	-
——期货投资	1,036,950.00
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	251,849,211.10

6.4.7.18 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	82,704.10
基金转换费收入	15,039.11

合计	97,743.21
----	-----------

6.4.7.19 信用减值损失

本基金本报告期内未发生信用减值损失。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
审计费用	31,240.60
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行间账户维护费	9,000.00
存托服务费	10.47
合计	99,758.44

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
天弘基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
国泰海通证券股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
内蒙古君正能源化工集团股份有限公司	基金管理人的股东

天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金	本基金是该基金的联接基金
-----------------------	--------------

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日		上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国泰海通证券股份有限公司	-	-	41,196,551.67	19.10%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日		上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日	
	成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例	成交金额	占当期债券买卖成交总额的比例
国泰海通证券股份有限公司	-	-	1,009,692.98	47.21%

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 基金交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日		上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日	
	成交金额	占当期基金成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
国泰海通证券股份有限公司	-	-	4,408,539.30	54.97%

6.4.10.1.6 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
-	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国泰海通证券股份有限公司	8,565.82	19.52%	8,565.82	46.54%

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以未包含印花税、经手费、证管费和过户费等费用的净额列示。

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至20 26年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至20 25年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	394,250.35	466,960.66
其中：应支付销售机构的客户维护费	2,263,211.53	2,155,420.06
应支付基金管理人的净管理费	-1,868,961.18	-1,688,459.40

注:1、本基金基金财产中投资于目标ETF的部分不收取管理费，支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值扣除所持有目标ETF基金份额部分的基金资产后的余额乘以前一日各级基金资产净值占比（若为负数，则取0）的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。天弘中证500ETF联接A约定的管理费年费率为0.50%，天弘中证500ETF联接C约定的管理费年费率为0.50%，天弘中证500ETF联接Y约定的管理费年费率为0.15%。其计算公式为：日管理人报酬=(前一日基金资产净值-前一日所持有目标ETF基金份额部分的基金资产)×前一日各级基金资产净值占比（若为负数，则取0）×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。

3、本基金投资于目标ETF的部分不收取管理费，支付销售机构的客户维护费不因投资于目标ETF而调减，因此应支付基金管理人的净管理费为负。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026 年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至2025 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	79,065.18	93,402.62

注:本基金基金财产中投资于目标ETF的部分不收取托管费,支付基金托管人国泰海通证券股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值扣除所持有目标ETF基金份额部分的基金资产后的余额乘以前一日各级基金资产净值占比(若为负数,则取0)的约定年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。天弘中证500ETF联接A约定的托管费年费率为0.10%,天弘中证500ETF联接C约定的托管费年费率为0.10%,天弘中证500ETF联接Y约定的托管费年费率为0.05%。其计算公式为:日托管费=(前一日基金资产净值-前一日所持有目标ETF基金份额部分的基金资产)×前一日各级基金资产净值占比(若为负数,则取0)×该日适用费率/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售 服务费的 各关联方 名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	天弘中证500ETF联 接A	天弘中证500ETF联 接C	天弘中证500ETF联 接Y	合计
天弘基金 管理有限公司	-	5,197.78	-	5,197.78
国泰海通 证券股份 有限公司	-	48.58	-	48.58
合计	-	5,246.36	-	5,246.36
获得销售 服务费的 各关联方 名称	上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	天弘中证500ETF联 接A	天弘中证500ETF联 接C	天弘中证500ETF联 接Y	合计

天弘基金 管理有限 公司	-	6,796.49	-	6,796.4 9
国泰海通 证券股份 有限公司	-	90.83	-	90.83
合计	-	6,887.32	-	6,887.3 2

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500ETF联接C的销售服务费率为0.20%。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500ETF联接A和天弘中证500ETF联接Y不收取销售服务费。

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

天弘中证500ETF联接A

本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

天弘中证500ETF联接C

本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

天弘中证500ETF联接Y

本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日		上年度可比期间 2025年01月01日至2025年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
国泰海通证券股份有限公司	118,503,595.38	817,204.59	117,837,567.14	807,572.12

注：本基金由基金托管人国泰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

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券交易。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本报告期末，本基金持有1,184,977,669.00份目标ETF基金份额（上年度末：1,408,936,569.00份），占其总份额的比例为93.94%（上年度末：95.43%）。

本报告期末，本基金持有君正集团的股票10,100股（上年度末：10,200股），估值总额为人民币45,046.00元（上年度末：49,164.00元），占基金净资产的比例为0.00%（上年度末：0.00%）。

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
920193	吉和昌	2026-06-18	1个月内（含）	新股未上市	8.52	8.52	300	2,556.00	2,556.00	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
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：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
113704	春风转债	2026-06-10	1个月内（含）	新债未上市	100.00	100.00	60	6,000.00	6,000.28	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为目标ETF的联接基金，目标ETF是采用完全复制法实现对标的指数紧密跟踪的全被动指数基金。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通过投资于目标ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履约责任，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国泰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，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	-	9,403,742.14
合计	-	9,403,742.14

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

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级的同业存单。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
AAA	-	-
AAA以下	6,000.28	-
未评级	-	-
合计	6,000.28	-

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级的同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%（完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制）。

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

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变

现价值。本期末，本基金组合资产中7个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026年06月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	118,503,595.38	-	-	-	118,503,595.38
结算备付金	12,060,953.02	-	-	-	12,060,953.02
存出保证金	291,564.96	-	-	2,901,782.40	3,193,347.36
交易性金融资产	-	-	6,000.28	1,877,412,429.64	1,877,418,429.92
应收清算款	-	-	-	2,742,155.56	2,742,155.56

应收申购款	-	-	-	4,347,615.57	4,347,615.57
资产总计	130,856,113.36	-	6,000.28	1,887,403,983.17	2,018,266,096.81
负债					
应付清算款	-	-	-	797.00	797.00
应付赎回款	-	-	-	15,891,265.83	15,891,265.83
应付管理人报酬	-	-	-	63,360.53	63,360.53
应付托管费	-	-	-	12,716.66	12,716.66
应付销售服务费	-	-	-	112,367.62	112,367.62
应交税费	-	-	-	32,582.24	32,582.24
其他负债	-	-	-	135,339.44	135,339.44
负债总计	-	-	-	16,248,429.32	16,248,429.32
利率敏感度缺口	130,856,113.36	-	6,000.28	1,871,155,553.85	2,002,017,667.49
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	94,201,340.66	-	-	-	94,201,340.66
结算备付金	9,571,458.32	-	-	-	9,571,458.32
存出保证金	488,078.99	-	-	1,754,721.60	2,242,800.59
交易性金融资产	9,403,742.14	-	-	1,818,446,675.09	1,827,850,417.23
应收清算款	-	-	-	11,256,816.77	11,256,816.77
应收申购款	-	-	-	4,285,910.16	4,285,910.16
资产总计	113,664,620.11	-	-	1,835,744,123.62	1,949,408,743.73
负债					
应付清算款	-	-	-	2,792,206.70	2,792,206.70
应付赎回款	-	-	-	14,112,139.90	14,112,139.90
应付管理人报酬	-	-	-	51,655.33	51,655.33
应付托管费	-	-	-	10,336.57	10,336.57
应付销售服务费	-	-	-	106,822.40	106,822.40
应交税费	-	-	-	7,259.21	7,259.21
其他负债	-	-	-	236,413.39	236,413.39
负债总计	-	-	-	17,316,833.50	17,316,833.50

利率敏感度缺口	113,664,620.1 1	-	-	1,818,427,290.1 2	1,932,091,910.2 3
---------	--------------------	---	---	----------------------	----------------------

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2026年06月30日，本基金持有的交易性债券投资占基金净资产的比例为0.00%(2025年12月31日：0.49%)，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。本基金主要投资于能通过股票组合赎回或二级市场交易卖出的目标ETF份额以及证券交易所上市的股票，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。

本基金通过把全部或接近全部的基金资产投资于目标ETF、标的指数成份股和备选成份股进行被动式指数化投资，实现对业绩比较基准的紧密跟踪。本基金的其他价格风险与目标ETF基金类似。本基金管理人通常用敏感性指标来衡量市场价格风险。

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	34,535,158.81	1.73	28,674,551.49	1.48

产—股票投资				
交易性金融资产—基金投资	1,842,877,270.83	92.05	1,789,772,123.60	92.63
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,877,412,429.64	93.78	1,818,446,675.09	94.12

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%	99,996,603.38	96,406,773.58
	业绩比较基准下降5%	-99,996,603.38	-96,406,773.58

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

- 第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。
- 第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。
- 第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
第一层次	1,877,409,873.64	1,818,446,675.09
第二层次	8,556.28	9,403,742.14
第三层次	-	-
合计	1,877,418,429.92	1,827,850,417.23

6.4.14.2 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	34,535,158.81	1.71

	其中：股票	34,535,158.81	1.71
2	基金投资	1,842,877,270.83	91.31
3	固定收益投资	6,000.28	0.00
	其中：债券	6,000.28	0.00
	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	130,564,548.40	6.47
8	其他各项资产	10,283,118.49	0.51
9	合计	2,018,266,096.81	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	117,263.00	0.01
B	采矿业	1,060,351.00	0.05
C	制造业	26,161,567.55	1.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	843,143.00	0.04
E	建筑业	202,999.00	0.01
F	批发和零售业	633,791.00	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	416,969.00	0.02
H	住宿和餐饮业	23,387.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,007,303.98	0.10
J	金融业	1,920,903.60	0.10
K	房地产业	137,755.00	0.01
L	租赁和商务服务业	379,873.00	0.02
M	科学研究和技术服务业	259,244.48	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	122,423.20	0.01

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	83,307.00	0.00
R	文化、体育和娱乐业	164,878.00	0.01
S	综合	-	-
	合计	34,535,158.81	1.73

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

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	300604	长川科技	1,600	546,272.00	0.03
2	688498	源杰科技	253	477,158.00	0.02
3	001309	德明利	500	471,450.00	0.02
4	002281	光迅科技	1,700	436,798.00	0.02
5	002008	大族激光	2,700	405,297.00	0.02
6	688347	华虹宏力	1,188	399,524.40	0.02
7	300136	信维通信	3,300	393,525.00	0.02
8	688120	华海清科	1,147	369,540.46	0.02
9	300857	协创数据	1,060	360,294.00	0.02
10	300223	北京君正	1,300	323,570.00	0.02
11	300475	香农芯创	1,000	300,000.00	0.01
12	002436	兴森科技	5,700	290,415.00	0.01
13	002407	多氟多	5,600	281,288.00	0.01
14	300285	国瓷材料	2,700	278,586.00	0.01
15	300054	鼎龙股份	2,500	264,925.00	0.01
16	300666	江丰电子	700	258,020.00	0.01
17	300757	罗博特科	400	247,600.00	0.01
18	688361	中科飞测	571	245,530.00	0.01
19	000021	深科技	3,700	237,799.00	0.01

20	600105	永鼎股份	3,500	236,180.00	0.01
21	300548	长芯博创	800	222,400.00	0.01
22	002851	麦格米特	1,300	217,334.00	0.01
23	688777	中控技术	1,765	207,387.50	0.01
24	300346	南大光电	2,200	203,830.00	0.01
25	002409	雅克科技	900	202,050.00	0.01
26	300751	迈为股份	700	197,722.00	0.01
27	002138	顺络电子	2,700	197,370.00	0.01
28	002185	华天科技	8,800	196,328.00	0.01
29	300567	精测电子	600	190,560.00	0.01
30	300620	光库科技	500	189,100.00	0.01
31	688200	华峰测控	360	189,036.00	0.01
32	300395	菲利华	1,400	187,222.00	0.01
33	300390	天华新能	1,900	177,669.00	0.01
34	301526	国际复材	3,800	177,346.00	0.01
35	600498	烽火通信	2,400	176,640.00	0.01
36	300373	扬杰科技	1,100	172,953.00	0.01
37	600879	航天电子	7,900	168,191.00	0.01
38	300037	新宙邦	1,800	167,130.00	0.01
39	688002	睿创微纳	1,077	166,601.13	0.01
40	001389	广合科技	700	166,075.00	0.01
41	601869	长飞光纤	300	163,770.00	0.01
42	300058	蓝色光标	11,900	163,744.00	0.01
43	002273	水晶光电	4,600	163,208.00	0.01
44	688469	芯联集成	15,065	159,839.65	0.01
45	688037	芯源微	348	152,789.40	0.01
46	300570	太辰光	600	148,026.00	0.01
47	688313	仕佳光子	795	146,796.75	0.01
48	688172	燕东微	1,697	141,971.02	0.01
49	000960	锡业股份	3,300	140,877.00	0.01
50	002126	银轮股份	2,800	139,440.00	0.01

51	000831	中国稀土	2,500	138,725.00	0.01
52	002738	中矿资源	2,300	135,677.00	0.01
53	603256	宏和科技	500	132,665.00	0.01
54	605358	立昂微	1,700	131,920.00	0.01
55	600988	赤峰黄金	5,000	131,600.00	0.01
56	688019	安集科技	380	128,994.80	0.01
57	301358	湖南裕能	1,700	128,979.00	0.01
58	600885	宏发股份	3,700	127,613.00	0.01
59	605589	圣泉集团	2,000	127,140.00	0.01
60	002812	恩捷股份	1,900	127,129.00	0.01
61	000703	恒逸石化	9,300	126,201.00	0.01
62	600392	盛和资源	4,200	125,034.00	0.01
63	688099	晶晨股份	1,212	124,714.80	0.01
64	600601	方正科技	9,000	124,560.00	0.01
65	002195	岩山科技	19,000	124,260.00	0.01
66	002261	拓维信息	4,200	117,642.00	0.01
67	600141	兴发集团	2,500	117,425.00	0.01
68	002850	科达利	600	113,580.00	0.01
69	002821	凯莱英	700	113,400.00	0.01
70	601179	中国西电	7,600	113,392.00	0.01
71	600378	昊华科技	1,500	113,070.00	0.01
72	002340	格林美	17,000	112,370.00	0.01
73	688234	天岳先进	646	112,087.46	0.01
74	600497	驰宏锌锗	9,100	110,201.00	0.01
75	301377	鼎泰高科	200	110,180.00	0.01
76	300017	网宿科技	8,400	109,284.00	0.01
77	003031	中瓷电子	600	108,180.00	0.01
78	301611	珂玛科技	600	108,042.00	0.01
79	002131	利欧股份	22,700	107,825.00	0.01
80	002203	海亮股份	4,700	107,395.00	0.01
81	000783	长江证券	10,900	106,275.00	0.01

82	600157	永泰能源	65,600	105,616.00	0.01
83	002966	苏州银行	15,000	104,400.00	0.01
84	688629	华丰科技	548	102,755.48	0.01
85	300759	康龙化成	3,500	101,255.00	0.01
86	300339	润和软件	2,600	100,126.00	0.01
87	600909	华安证券	9,000	99,990.00	0.00
88	600711	盛屯矿业	9,100	99,827.00	0.00
89	600143	金发科技	6,400	98,880.00	0.00
90	300001	特锐德	2,500	94,575.00	0.00
91	600352	浙江龙盛	7,800	94,458.00	0.00
92	002517	恺英网络	5,800	94,250.00	0.00
93	601555	东吴证券	11,900	94,248.00	0.00
94	300207	欣旺达	4,900	93,051.00	0.00
95	688220	翱捷科技	747	92,867.04	0.00
96	603659	璞泰来	3,200	92,576.00	0.00
97	002601	龙佰集团	5,600	92,288.00	0.00
98	002797	第一创业	14,000	91,980.00	0.00
99	002472	双环传动	2,200	91,322.00	0.00
100	601233	桐昆股份	4,200	90,930.00	0.00
101	688213	思特威	833	89,189.31	0.00
102	300458	全志科技	2,240	88,390.40	0.00
103	002155	湖南黄金	3,700	88,319.00	0.00
104	300115	长盈精密	3,100	86,614.00	0.00
105	300454	深信服	900	86,580.00	0.00
106	688017	绿的谐波	207	86,497.02	0.00
107	603308	应流股份	1,400	84,560.00	0.00
108	688122	西部超导	1,343	84,353.83	0.00
109	002465	海格通信	6,600	84,282.00	0.00
110	601108	财通证券	9,700	83,905.00	0.00
111	002056	横店东磁	2,700	82,296.00	0.00
112	601958	金钼股份	2,900	81,519.00	0.00

113	300623	捷捷微电	1,800	80,982.00	0.00
114	688411	海博思创	278	80,953.60	0.00
115	000060	中金岭南	10,500	79,485.00	0.00
116	300024	机器人	4,100	79,253.00	0.00
117	688702	盛科通信	203	79,167.97	0.00
118	002429	兆驰股份	7,600	78,964.00	0.00
119	601198	东兴证券	5,800	78,822.00	0.00
120	688322	奥比中光	603	78,721.65	0.00
121	601991	大唐发电	11,100	78,588.00	0.00
122	002130	沃尔核材	4,100	77,736.00	0.00
123	300012	华测检测	5,600	77,616.00	0.00
124	688387	信科移动	3,912	77,614.08	0.00
125	002402	和而泰	3,000	77,490.00	0.00
126	002335	科华数据	1,820	77,259.00	0.00
127	301536	星宸科技	600	77,226.00	0.00
128	603129	春风动力	300	76,740.00	0.00
129	688385	复旦微电	1,075	76,636.75	0.00
130	600563	法拉电子	400	76,320.00	0.00
131	000878	云南铜业	4,800	76,224.00	0.00
132	002025	航天电器	1,000	76,220.00	0.00
133	002271	东方雨虹	6,400	75,968.00	0.00
134	002414	高德红外	5,700	75,582.00	0.00
135	603179	新泉股份	1,500	74,475.00	0.00
136	601665	齐鲁银行	12,900	74,433.00	0.00
137	300496	中科创达	1,200	74,148.00	0.00
138	000034	神州数码	2,660	73,815.00	0.00
139	603156	养元饮品	1,500	73,605.00	0.00
140	000893	亚钾国际	1,800	73,602.00	0.00
141	600884	杉杉股份	5,400	73,170.00	0.00
142	600707	彩虹股份	4,300	72,627.00	0.00
143	300474	景嘉微	1,200	72,576.00	0.00

144	300763	锦浪科技	800	72,280.00	0.00
145	301200	大族数控	200	72,130.00	0.00
146	300073	当升科技	1,500	72,060.00	0.00
147	002444	巨星科技	2,300	71,530.00	0.00
148	601162	天风证券	21,200	71,444.00	0.00
149	688301	奕瑞科技	576	71,424.00	0.00
150	002078	太阳纸业	5,700	71,193.00	0.00
151	002432	九安医疗	1,000	70,680.00	0.00
152	688676	金盘科技	829	70,166.56	0.00
153	300142	沃森生物	5,400	70,146.00	0.00
154	300919	中伟新材	1,600	70,000.00	0.00
155	002487	大金重工	1,200	69,564.00	0.00
156	002157	正邦科技	24,700	69,407.00	0.00
157	601099	太平洋	20,400	68,748.00	0.00
158	603650	彤程新材	700	68,586.00	0.00
159	600109	国金证券	7,800	68,484.00	0.00
160	300432	富临精工	3,400	68,306.00	0.00
161	603379	三美股份	900	68,301.00	0.00
162	000423	东阿阿胶	1,500	68,040.00	0.00
163	002756	永兴材料	1,200	67,968.00	0.00
163	000733	振华科技	1,200	67,968.00	0.00
164	300748	金力永磁	2,200	67,870.00	0.00
165	688578	艾力斯	615	67,158.00	0.00
166	300953	震裕科技	500	66,850.00	0.00
167	002252	上海莱士	15,400	66,836.00	0.00
168	000661	长春高新	1,000	66,600.00	0.00
169	603688	石英股份	800	66,088.00	0.00
170	688266	泽璟制药	559	65,212.94	0.00
171	600256	广汇能源	13,200	65,208.00	0.00
172	000728	国元证券	8,700	65,163.00	0.00
173	600298	安琪酵母	1,800	65,160.00	0.00

174	603979	金诚信	1,100	64,933.00	0.00
175	600060	海信视像	2,300	64,101.00	0.00
176	601128	常熟银行	10,930	63,612.60	0.00
177	300724	捷佳伟创	900	63,540.00	0.00
178	600021	上海电力	4,200	63,294.00	0.00
179	601696	中银证券	5,000	63,250.00	0.00
180	688728	格科微	2,988	62,867.52	0.00
181	601577	长沙银行	7,200	62,712.00	0.00
182	600699	均胜电子	2,900	62,669.00	0.00
183	002064	华峰化学	6,600	62,634.00	0.00
184	601615	明阳智能	5,400	62,478.00	0.00
185	000786	北新建材	3,400	61,506.00	0.00
186	603606	东方电缆	1,460	60,604.60	0.00
187	689009	九号公司	1,581	60,315.15	0.00
188	001203	大中矿业	2,000	59,900.00	0.00
189	002831	裕同科技	1,683	59,847.48	0.00
190	300383	光环新网	4,800	59,712.00	0.00
191	000519	中兵红箭	2,800	58,996.00	0.00
192	300677	英科医疗	1,500	58,755.00	0.00
193	300558	贝达药业	900	58,563.00	0.00
194	688331	荣昌生物	444	57,835.44	0.00
195	002673	西部证券	8,900	57,761.00	0.00
196	688052	纳芯微	200	57,662.00	0.00
197	603920	世运电路	1,200	57,648.00	0.00
198	002624	完美世界	4,600	57,132.00	0.00
199	688599	天合光能	4,032	56,931.84	0.00
200	000559	万向钱潮	4,400	56,892.00	0.00
201	603087	甘李药业	1,000	56,760.00	0.00
202	001696	宗申动力	2,700	56,187.00	0.00
203	688375	国博电子	537	56,009.10	0.00
204	000983	山西焦煤	9,500	55,100.00	0.00

205	000623	吉林敖东	3,100	54,963.00	0.00
206	000750	国海证券	14,900	54,832.00	0.00
207	002739	儒意电影	5,700	54,720.00	0.00
208	300699	光威复材	1,900	54,435.00	0.00
209	002085	万丰奥威	4,900	54,341.00	0.00
210	600171	上海贝岭	1,700	54,298.00	0.00
211	002065	东华软件	7,600	54,264.00	0.00
212	300679	电连技术	900	53,991.00	0.00
213	688180	君实生物	1,575	53,266.50	0.00
214	002266	浙富控股	10,500	53,130.00	0.00
215	603119	浙江荣泰	800	53,072.00	0.00
216	002044	美年健康	10,500	52,815.00	0.00
217	002318	久立特材	2,200	52,580.00	0.00
218	300002	神州泰岳	6,700	52,327.00	0.00
219	000629	钒钛股份	15,600	52,104.00	0.00
220	603806	福斯特	3,100	52,049.00	0.00
221	600177	雅戈尔	6,900	51,957.00	0.00
222	600516	方大炭素	8,400	51,828.00	0.00
223	688343	云天励飞	633	51,690.78	0.00
224	002223	鱼跃医疗	2,000	51,320.00	0.00
225	300627	华测导航	1,800	51,120.00	0.00
226	600642	申能股份	5,800	50,634.00	0.00
227	000415	渤海租赁	12,400	50,468.00	0.00
228	688235	百济神州	198	50,412.78	0.00
229	000155	川能动力	4,200	50,316.00	0.00
230	000683	博源化工	8,700	50,112.00	0.00
231	601699	XD潞安环	3,500	49,980.00	0.00
232	000400	许继电气	2,300	49,910.00	0.00
233	000032	深桑达 A	2,000	49,900.00	0.00
234	600637	东方明珠	6,000	49,860.00	0.00
235	300003	乐普医疗	4,200	49,770.00	0.00

236	002430	杭氧股份	1,600	49,536.00	0.00
237	000039	中集集团	6,100	49,471.00	0.00
238	603160	汇顶科技	800	49,368.00	0.00
239	603225	新凤鸣	2,500	49,125.00	0.00
240	688169	石头科技	517	49,099.49	0.00
241	688065	凯赛生物	1,024	48,998.40	0.00
242	603345	安井食品	600	48,114.00	0.00
243	600369	西南证券	11,900	47,838.00	0.00
244	000729	燕京啤酒	4,700	47,611.00	0.00
245	000050	深天马 A	4,800	47,568.00	0.00
246	000967	盈峰环境	4,500	47,385.00	0.00
247	600100	同方股份	6,900	47,265.00	0.00
248	300487	蓝晓科技	800	47,080.00	0.00
249	600499	科达制造	3,400	46,920.00	0.00
250	600595	中孚实业	8,300	46,646.00	0.00
251	000887	中鼎股份	2,600	46,514.00	0.00
252	603596	伯特利	1,868	46,401.12	0.00
253	603290	斯达半导	300	45,882.00	0.00
254	601016	节能风电	11,800	45,784.00	0.00
255	000830	鲁西化工	3,800	45,600.00	0.00
256	688187	时代电气	663	45,521.58	0.00
257	603699	纽威股份	900	45,270.00	0.00
258	601212	白银有色	8,900	45,212.00	0.00
259	601997	贵阳银行	8,800	45,144.00	0.00
260	600862	中航高科	2,500	45,075.00	0.00
261	601216	君正集团	10,100	45,046.00	0.00
262	002939	长城证券	5,400	45,036.00	0.00
263	600536	中国软件	1,600	44,992.00	0.00
264	600985	淮北矿业	3,200	44,960.00	0.00
265	688772	珠海冠宇	2,288	44,913.44	0.00
266	002841	视源股份	1,300	44,889.00	0.00

267	002410	广联达	5,500	44,880.00	0.00
268	600521	华海药业	3,100	44,640.00	0.00
269	601717	中创智领	3,200	44,512.00	0.00
270	688568	XD中科星	1,073	44,497.31	0.00
271	600704	物产中大	9,400	44,368.00	0.00
272	600863	华能蒙电	9,400	44,180.00	0.00
273	603766	隆鑫通用	3,700	44,141.00	0.00
274	002683	广东宏大	1,500	43,935.00	0.00
275	002007	华兰生物	3,600	43,884.00	0.00
276	601001	晋控煤业	2,500	43,475.00	0.00
277	600873	梅花生物	5,900	43,365.00	0.00
278	601990	南京证券	6,600	43,362.00	0.00
279	688538	和辉光电	16,540	43,004.00	0.00
280	603077	和邦生物	18,500	42,920.00	0.00
281	002926	华西证券	5,200	42,484.00	0.00
282	600312	平高电气	2,400	42,384.00	0.00
283	600332	白云山	2,100	42,084.00	0.00
284	002603	以岭药业	2,800	42,000.00	0.00
285	603605	珀莱雅	700	41,944.00	0.00
286	000591	太阳能	9,100	41,860.00	0.00
287	000528	柳 工	5,500	41,525.00	0.00
288	000062	深圳华强	1,300	41,366.00	0.00
289	600765	中航重机	3,200	41,344.00	0.00
290	600166	福田汽车	14,200	41,322.00	0.00
291	600348	华阳股份	5,400	41,310.00	0.00
292	600153	建发股份	5,200	41,236.00	0.00
293	688297	中无人机	989	41,092.95	0.00
294	000737	北方铜业	3,100	40,982.00	0.00
295	000921	海信家电	1,500	40,980.00	0.00
296	601611	中国核建	3,600	40,140.00	0.00
297	000932	华菱钢铁	11,500	39,905.00	0.00

298	600901	江苏金租	6,900	39,675.00	0.00
299	600737	中粮糖业	3,200	39,456.00	0.00
300	600363	联创光电	1,100	39,358.00	0.00
301	688582	芯动联科	603	39,195.00	0.00
302	000987	越秀资本	5,000	39,100.00	0.00
303	600578	京能电力	6,000	38,700.00	0.00
304	002152	广电运通	4,100	38,458.00	0.00
305	000738	航发控制	2,100	38,409.00	0.00
306	600398	海澜之家	7,200	37,656.00	0.00
307	603568	伟明环保	2,440	37,527.20	0.00
308	002262	恩华药业	2,000	37,500.00	0.00
309	000997	新大陆	2,300	37,490.00	0.00
310	000009	中国宝安	6,000	37,380.00	0.00
311	000951	中国重汽	1,900	37,069.00	0.00
312	601000	唐山港	8,900	36,935.00	0.00
313	002500	山西证券	7,100	36,636.00	0.00
314	603728	鸣志电器	600	36,552.00	0.00
315	688617	惠泰医疗	200	36,312.00	0.00
316	601799	星宇股份	400	36,248.00	0.00
317	600208	衢州发展	12,700	35,941.00	0.00
318	600008	首创环保	13,200	35,904.00	0.00
319	603444	吉比特	100	35,842.00	0.00
320	603298	杭叉集团	1,500	35,790.00	0.00
321	688018	乐鑫科技	278	35,561.76	0.00
322	600170	上海建工	16,000	35,520.00	0.00
323	600486	扬农化工	700	35,490.00	0.00
324	000582	北部湾港	3,300	35,409.00	0.00
325	600998	九州通	7,500	35,175.00	0.00
326	002312	川发龙蟒	3,800	34,846.00	0.00
327	600435	北方导航	3,100	34,720.00	0.00
328	300972	万辰集团	200	34,682.00	0.00

329	000723	美锦能源	10,300	34,505.00	0.00
330	600995	南网储能	2,800	34,440.00	0.00
331	600820	隧道股份	6,600	34,386.00	0.00
332	603341	龙旗科技	800	33,992.00	0.00
333	601106	中国一重	10,300	33,990.00	0.00
334	600282	南钢股份	7,400	33,966.00	0.00
335	003022	联泓新科	1,300	33,670.00	0.00
336	600483	福能股份	3,300	33,627.00	0.00
337	600161	天坛生物	2,900	33,582.00	0.00
338	600316	洪都航空	1,200	33,528.00	0.00
339	688608	恒玄科技	200	33,438.00	0.00
340	600583	海油工程	6,600	33,198.00	0.00
341	688114	华大智造	647	33,048.76	0.00
342	603885	吉祥航空	3,200	32,928.00	0.00
343	603939	益丰药房	1,800	32,364.00	0.00
344	688615	合合信息	284	32,120.40	0.00
345	688778	厦钨新能	590	32,096.00	0.00
346	000513	丽珠集团	1,100	31,779.00	0.00
347	600546	山煤国际	2,900	31,697.00	0.00
348	000739	普洛药业	1,900	31,654.00	0.00
349	300676	华大基因	900	31,554.00	0.00
350	601666	XD平煤股	4,400	31,460.00	0.00
351	000598	兴蓉环境	4,900	31,458.00	0.00
352	601567	三星电气	2,100	31,374.00	0.00
353	603816	顾家家居	1,400	31,304.00	0.00
354	688166	博瑞医药	891	31,193.91	0.00
355	002244	滨江集团	4,100	31,160.00	0.00
356	600380	健康元	3,300	31,086.00	0.00
357	601156	东航物流	1,900	30,628.00	0.00
358	300100	双林股份	1,100	30,558.00	0.00
359	600602	云赛智联	1,900	30,552.00	0.00

359	600390	五矿资本	6,700	30,552.00	0.00
360	600685	中船防务	1,200	30,528.00	0.00
360	002120	韵达股份	4,800	30,528.00	0.00
361	601880	辽港股份	22,100	30,498.00	0.00
362	600763	通策医疗	900	30,492.00	0.00
363	300718	长盛轴承	500	30,485.00	0.00
364	603486	科沃斯	600	30,450.00	0.00
365	603565	中谷物流	3,100	30,411.00	0.00
366	600038	中直股份	1,200	30,348.00	0.00
367	002299	圣农发展	2,000	30,320.00	0.00
368	000883	湖北能源	7,000	30,240.00	0.00
369	300144	宋城演艺	5,200	30,212.00	0.00
370	601399	国机重装	8,600	30,100.00	0.00
371	300146	汤臣倍健	3,300	29,832.00	0.00
372	600329	达仁堂	800	29,776.00	0.00
373	603338	浙江鼎力	700	29,750.00	0.00
374	600562	国睿科技	1,400	29,708.00	0.00
375	300735	光弘科技	1,300	29,562.00	0.00
376	601865	福莱特	2,800	29,428.00	0.00
377	000800	一汽解放	4,900	29,155.00	0.00
378	000027	深圳能源	4,700	29,140.00	0.00
379	600535	天士力	2,200	29,106.00	0.00
380	600906	财达证券	3,900	29,094.00	0.00
381	600132	重庆啤酒	700	28,910.00	0.00
382	600816	建元信托	11,800	28,792.00	0.00
383	002568	百润股份	1,700	28,764.00	0.00
384	601236	红塔证券	4,200	28,644.00	0.00
384	600511	国药股份	1,100	28,644.00	0.00
385	600977	中国电影	2,200	28,424.00	0.00
386	000088	盐田港	6,900	28,221.00	0.00
387	600970	中材国际	3,900	27,807.00	0.00

388	601155	新城控股	2,700	27,702.00	0.00
389	002583	海能达	3,600	27,684.00	0.00
390	600967	内蒙一机	2,500	27,125.00	0.00
391	688278	特宝生物	493	26,819.20	0.00
392	000709	河钢股份	13,800	26,772.00	0.00
393	688248	南网科技	386	26,703.48	0.00
394	600131	国网信通	1,800	26,280.00	0.00
395	601608	中信重工	5,500	26,235.00	0.00
396	002984	森麒麟	2,000	26,140.00	0.00
397	000825	太钢不锈	7,600	25,916.00	0.00
398	601866	中远海发	11,600	25,636.00	0.00
399	600095	湘财股份	3,400	25,602.00	0.00
400	001286	陕西能源	2,500	25,350.00	0.00
401	601118	海南橡胶	5,100	25,092.00	0.00
402	600801	华新建材	1,600	24,960.00	0.00
403	600871	石化油服	12,200	24,766.00	0.00
404	002423	中粮资本	3,000	24,690.00	0.00
405	002773	康弘药业	1,200	24,540.00	0.00
406	600126	杭钢股份	4,000	24,520.00	0.00
407	600566	XD济川药	1,100	24,409.00	0.00
408	301606	绿联科技	400	24,408.00	0.00
409	600517	国网英大	5,100	23,868.00	0.00
410	600655	豫园股份	5,800	23,838.00	0.00
411	688281	华秦科技	472	23,708.56	0.00
412	603000	人民网	1,600	23,664.00	0.00
413	603737	三棵树	980	23,618.00	0.00
414	002508	老板电器	1,600	23,392.00	0.00
415	600754	锦江酒店	1,300	23,387.00	0.00
416	000429	粤高速 A	1,700	23,205.00	0.00
417	688318	财富趋势	321	22,890.51	0.00
418	601598	中国外运	4,600	22,816.00	0.00

419	600598	北大荒	2,100	22,764.00	0.00
420	603899	晨光股份	1,100	22,693.00	0.00
421	600004	白云机场	3,100	22,506.00	0.00
422	601966	玲珑轮胎	2,200	22,418.00	0.00
423	603589	口子窖	1,200	22,416.00	0.00
424	300888	稳健医疗	800	22,392.00	0.00
425	600350	山东高速	2,000	22,260.00	0.00
426	003035	南网能源	3,800	22,116.00	0.00
427	300957	贝泰妮	700	22,057.00	0.00
428	600663	陆家嘴	3,500	21,980.00	0.00
429	603858	步长制药	1,500	21,900.00	0.00
430	688709	成都华微	574	21,863.66	0.00
431	600582	天地科技	4,900	21,805.00	0.00
432	600848	上海临港	2,800	20,972.00	0.00
433	002670	国盛证券	1,900	20,900.00	0.00
434	688363	华熙生物	582	20,818.14	0.00
435	601098	中南传媒	2,100	20,664.00	0.00
436	688295	中复神鹰	341	20,644.14	0.00
437	688336	三生国健	383	20,337.30	0.00
438	600968	海油发展	6,100	20,313.00	0.00
439	002032	苏泊尔	500	19,800.00	0.00
440	000539	粤电力A	2,900	19,749.00	0.00
441	000537	绿发电力	2,700	19,737.00	0.00
442	688561	奇安信	818	19,615.64	0.00
443	603233	大参林	1,300	19,539.00	0.00
444	002153	石基信息	2,700	19,521.00	0.00
445	601928	凤凰传媒	2,200	19,338.00	0.00
445	600688	上海石化	6,600	19,338.00	0.00
446	600062	华润双鹤	1,200	19,248.00	0.00
447	688425	铁建重工	4,629	18,608.58	0.00
448	688349	三一重能	1,223	18,565.14	0.00

449	601808	中海油服	1,700	18,377.00	0.00
450	600098	广州发展	3,100	18,321.00	0.00
451	600295	鄂尔多斯	1,700	18,224.00	0.00
452	600808	马钢股份	7,200	18,000.00	0.00
453	000959	首钢股份	5,100	17,901.00	0.00
454	003021	兆威机电	200	17,470.00	0.00
455	301301	川宁生物	2,200	17,468.00	0.00
456	002265	建设工业	1,000	17,400.00	0.00
457	002608	江苏国信	2,500	17,250.00	0.00
458	688192	迪哲医药	428	17,090.04	0.00
459	600292	电投水电	1,400	16,856.00	0.00
460	000785	居然智家	8,300	16,600.00	0.00
461	301498	乖宝宠物	400	16,236.00	0.00
462	600377	宁沪高速	1,400	16,198.00	0.00
463	601298	青岛港	2,000	16,100.00	0.00
464	600339	中油工程	5,000	15,350.00	0.00
465	688708	佳驰科技	302	15,341.60	0.00
466	600606	绿地控股	12,600	15,246.00	0.00
467	000937	冀中能源	3,800	15,124.00	0.00
468	603833	欧派家居	500	15,055.00	0.00
469	300140	节能环保	3,000	14,910.00	0.00
470	600032	浙江新能	2,100	14,805.00	0.00
471	000898	鞍钢股份	7,900	14,773.00	0.00
472	603658	安图生物	500	14,510.00	0.00
473	688520	神州细胞	420	14,368.20	0.00
474	601139	深圳燃气	2,500	14,150.00	0.00
475	600764	中国海防	800	13,944.00	0.00
476	603529	爱玛科技	700	13,657.00	0.00
477	601228	广州港	4,500	12,690.00	0.00
478	603786	科博达	300	12,273.00	0.00
479	002945	华林证券	900	12,087.00	0.00

480	601019	山东出版	1,800	11,520.00	0.00
481	688563	航材股份	222	11,373.06	0.00
482	002461	珠江啤酒	1,500	11,355.00	0.00
483	600927	永安期货	800	9,960.00	0.00
484	600299	安迪苏	1,200	9,420.00	0.00
485	601112	振石股份	500	9,115.00	0.00
486	603049	中策橡胶	200	8,962.00	0.00
487	603175	超颖电子	100	8,909.00	0.00
488	688475	萤石网络	275	7,521.25	0.00
489	001386	马可波罗	400	5,664.00	0.00
490	603092	德力佳	100	5,397.00	0.00
491	688819	天能股份	221	4,906.20	0.00
492	001221	悍高集团	100	4,022.00	0.00
493	920193	吉和昌	300	2,556.00	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	600487	亨通光电	909,527.00	0.05
2	300136	信维通信	892,780.25	0.05
3	002202	金风科技	861,375.00	0.04
4	300058	蓝色光标	852,331.00	0.04
5	000426	兴业银锡	819,338.00	0.04
6	301308	江波龙	763,236.00	0.04
7	002195	岩山科技	743,358.00	0.04
8	300450	先导智能	740,989.00	0.04
9	688498	源杰科技	715,525.42	0.04
10	002353	杰瑞股份	703,103.00	0.04

11	002558	巨人网络	690,484.00	0.04
12	300604	长川科技	689,606.00	0.04
13	300857	协创数据	684,866.00	0.04
14	002837	英维克	671,079.00	0.03
15	600988	赤峰黄金	670,826.00	0.03
16	002156	通富微电	668,079.00	0.03
17	600879	航天电子	662,463.00	0.03
18	600549	厦门钨业	656,660.00	0.03
19	002738	中矿资源	656,177.00	0.03
20	688525	佰维存储	654,183.54	0.03

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	301308	江波龙	4,248,202.00	0.22
2	300604	长川科技	4,235,976.00	0.22
3	002008	大族激光	3,594,341.00	0.19
4	002281	光迅科技	3,477,408.00	0.18
5	300857	协创数据	3,365,191.00	0.17
6	300136	信维通信	3,303,793.00	0.17
7	300751	迈为股份	2,974,185.00	0.15
8	002353	杰瑞股份	2,837,622.00	0.15
9	000426	兴业银锡	2,626,318.00	0.14
10	300058	蓝色光标	2,591,190.00	0.13
11	002202	金风科技	2,570,576.00	0.13
12	300450	先导智能	2,477,215.00	0.13
13	002156	通富微电	2,450,576.00	0.13

14	002837	英维克	2,434,019.40	0.13
15	002436	兴森科技	2,376,662.00	0.12
16	300054	鼎龙股份	2,293,558.00	0.12
17	002195	岩山科技	2,268,083.00	0.12
18	002850	科达利	2,186,027.00	0.11
19	002131	利欧股份	2,130,294.00	0.11
20	002738	中矿资源	2,075,482.00	0.11

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	115,881,618.87
卖出股票收入（成交）总额	298,132,926.91

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	-	-
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)	6,000.28	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	6,000.28	0.00

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	113704	春风转债	60	6,000.28	0.00

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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金	股票型	交易型开放式	天弘基金管理有限公司	1,842,877,270.83	92.05

7.11 本基金投资股指期货的投资政策

本指数基金的股指期货买入套保主要为应对基金组合申购的资金未到位造成基金组合的股票仓位过低的风险，股指期货在买入时总持仓量采用双限制策略，一是限制基金组合中总的股指期货持仓量不能超过向中金所申请并获批的套保总量；二是限制基金组合持有的股指期货合约价值加上基金组合中其他有价证券市值占基金净资产的比例不能超过法规规定的上限。并在股指期货的交易过程中严格遵守基金合同的约束和中金所的规定。根据本基金的基金合同、投资范围、投资目标、投资策略以及对市场走势研

判的基础上，结合基金日常的申购赎回情况，制定套期保值交易的合理期限。套期保值的期限一般不超过股指期货当前的最远到期日合约，即次季合约。按照交易月份相近的原则，综合考虑并动态跟踪不同到期日的期货合约的流动性、价差状况和展期风险等因素，选择合适月份的期货合约进行开仓和展期交易来实现远期套保的目的。另外对于交割月的股指期货，通常情况下，最晚在合约交割日进行平仓，尽量避免进行交割。在未来的股指期货交易过程中，本基金将严格遵守《证券投资基金参与股指期货交易指引》，以及中国金融期货交易所颁布的《中国金融期货交易所交易规则》、《中国金融期货交易所套期保值与套利交易管理办法》等相关规定，以套期保值为主要目的参与股指期货，严格控制交易中的各种风险。

7.12 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。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 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。

7.13.2 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。

7.13.3 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	3,193,347.36
2	应收清算款	2,742,155.56
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	4,347,615.57
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	10,283,118.49

7.13.4 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。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.13.6 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5 00ET F联接 A	26 7,0 51	2,673.27	428,795.57	0.06%	713,469,520.17	99.94%
天弘 中证5 00ET F联接 C	59, 999	6,551.81	1,243,789.58	0.32%	391,857,995.88	99.68%
天弘 中证5 00ET F联接 Y	4,5 99	4,321.60	-	-	19,875,020.11	100.00%
合计	32 9,4 22	3,420.76	1,672,585.15	0.15%	1,125,202,536.16	99.85%

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500ETF 联接A	110,633.09	0.02%
	天弘中证500ETF 联接C	15,367.90	0.00%
	天弘中证500ETF 联接Y	75,714.00	0.38%
	合计	201,714.99	0.02%

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500ETF联 接A	0
	天弘中证500ETF联 接C	0
	天弘中证500ETF联 接Y	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基 金	天弘中证500ETF联 接A	0~10
	天弘中证500ETF联 接C	0
	天弘中证500ETF联 接Y	0
	合计	0~10

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	天弘中证500ETF联接A	天弘中证500ETF联接C	天弘中证500ETF联接Y
基金合同生效日(2015年01月20日)基金份额总额	10,000,000.00	-	-
本报告期期初基金份额总额	869,216,969.11	443,484,256.19	5,135,572.96
本报告期基金总申购份额	199,124,439.11	443,171,023.04	24,636,341.24
减：本报告期基金总赎回份额	354,443,092.48	493,553,493.77	9,896,894.09
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	713,898,315.74	393,101,785.46	19,875,020.11

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，宋永明先生担任公司副总经理，具体信息请参见基金管理人在规定媒介披露的《天弘基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

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。

本报告期内，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，本基金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，本基金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	交	股票交易	应支付该券商的佣金	备
----	---	------	-----------	---

名称	易单元数量	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	注
东方财富证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	5	132,197,347.84	31.93%	25,949.30	30.69%	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	3	145,692,755.69	35.19%	30,289.85	35.83%	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国泰海通证券	10	-	-	-	-	-
国投证券	2	40,426,915.03	9.76%	8,405.16	9.94%	-
江海证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
西南证券	1	45,903,080.69	11.09%	9,547.61	11.29%	-

信达 证券	1	-	-	-	-	-
中国 银河 证券	2	-	-	-	-	-
中国 中金 财富 证券	1	-	-	-	-	-
中金 公司	2	-	-	-	-	-
中信 建投 证券	2	-	-	-	-	-
中信 证券	2	49,791,890.53	12.03%	10,351.94	12.24%	-

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

2、交易单元的选择程序：本基金管理人根据上述标准进行考察后，确定选用交易单元的证券公司，再和被选用的证券公司签订证券交易单元租用协议和综合服务协议。

3、本基金报告期内新租用交易单元：西南证券上海交易单元1个。

4、本基金报告期内停止租用交易单元：西部证券深圳交易单元1个，信达证券上海交易单元1个。

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	-	-	-	-	-	-	-	-

东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	19,758,983.00	100.00%
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	2,642.64	27.63%	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	6,923.12	72.37%	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中国银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中国中金财富 证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

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500交易型开放式指数证券投资基金联接基金2025年第4季度报告	中国证监会规定媒介	2026-01-22
2	天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金2025年年度报告	中国证监会规定媒介	2026-03-31
3	天弘基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025年度）	中国证监会规定媒介	2026-03-31
4	天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金2026年第1季度报告	中国证监会规定媒介	2026-04-22
5	天弘基金管理有限公司关于	中国证监会规定媒介	2026-04-27

	高级管理人员变更的公告		
6	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
7	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
8	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
9	天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金（A类份额）基金产品资料概要（更新）	中国证监会规定媒介	2026-06-26
10	天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金（C类份额）基金产品资料概要（更新）	中国证监会规定媒介	2026-06-26
11	天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金（Y类份额）基金产品资料概要（更新）	中国证监会规定媒介	2026-06-26

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

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

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层

12.3 查阅方式

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

公司网站：www.thfund.com.cn

天弘基金管理有限公司
二〇二六年八月三十一日