

天弘中证软件服务交易型开放式指数证券投资基金发起式
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:招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商银行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	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	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	13
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）	14
6.1 资产负债表	14
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	46
7.1 期末基金资产组合情况	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	47
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	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	50
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	52
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	52
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	52
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	52
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	52
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	52
7.11 本基金投资股指期货的投资政策	53
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	53
7.13 投资组合报告附注	53
§8 基金份额持有人信息	54
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	54

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55
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	55
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	55
§9 开放式基金份额变动	56
§10 重大事件揭示	56
10.1 基金份额持有人大会决议	56
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	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	56
10.4 基金投资策略的改变	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	57
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	57
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	58
10.8 其他重大事件	59
§11 影响投资者决策的其他重要信息	60
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	61
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	61
§12 备查文件目录	61
12.1 备查文件目录	61
12.2 存放地点	61
12.3 查阅方式	61

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	天弘中证软件服务交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	
基金简称	天弘中证软件服务ETF发起联接	
基金主代码	021535	
基金运作方式	契约型开放式、发起式	
基金合同生效日	2024年07月02日	
基金管理人	天弘基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	377,986,685.74份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	天弘中证软件服务ETF发起联接A	天弘中证软件服务ETF发起联接C
下属分级基金的交易代码	021535	021536
报告期末下属分级基金的份额总额	55,542,262.06份	322,444,423.68份

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	天弘中证软件服务交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	159035
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2026年05月06日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2026年05月15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	招商银行股份有限公司

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的最小化。
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 E TF、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 的资产比例不低于基金资产净值的 90%，因法律法规的规定而受限制的情形除外。 本基金的投资策略包括：目标ETF投资策略、股票投资策略、存托凭证投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、股票期权投资策略、参与融资及转融通证券出借业务策略。
业绩比较基准	中证软件服务指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为ETF联接基金，且目标ETF为股票型指数基金，因此本基金的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。本基金主要通过投资于目标ETF实现对标的指数的紧密跟踪，具有与标的指数相似的风险收益特征。

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。 本基金的投资策略包括：股票投资策略、存托凭证投

	资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、股票期权投资策略、参与融资及转融通证券出借业务策略。
业绩比较基准	中证软件服务指数收益率
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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	童建林	张姗
	联系电话	022-83310208	400-61-95555
	电子邮箱	service@thfund.com.cn	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		400-986-8888	400-61-95555
传真		022-83865564	0755-83195201
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	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
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	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码		300203	518040
法定代表人		黄辰立	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告的	www.thfund.com.cn

管理人互联网网址	
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)	
	天弘中证软件服务ETF发起联接A	天弘中证软件服务ETF发起联接C
本期已实现收益	-5,564,962.77	-37,081,296.11
本期利润	-18,275,001.68	-133,110,824.05
加权平均基金份额本期利润	-0.4211	-0.4105
本期加权平均净值利润率	-29.20%	-28.25%
本期基金份额净值增长率	-18.92%	-19.00%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2026年06月30日)	
期末可供分配利润	-4,588,897.42	-28,252,953.26
期末可供分配基金份额利润	-0.0826	-0.0876
期末基金资产净值	67,465,426.53	390,150,605.81
期末基金份额净值	1.2147	1.2100
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	21.47%	21.00%

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

天弘中证软件服务ETF发起联接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	-9.46%	2.15%	-10.57%	2.15%	1.11%	0.00%
过去六个月	-18.92%	2.22%	-19.78%	2.22%	0.86%	0.00%
过去一年	-13.82%	1.95%	-14.79%	1.94%	0.97%	0.01%
自基金合同 生效日起至 今	21.47%	2.21%	25.69%	2.30%	-4.22%	-0.09%

天弘中证软件服务ETF发起联接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	-9.51%	2.15%	-10.57%	2.15%	1.06%	0.00%
过去六个月	-19.00%	2.22%	-19.78%	2.22%	0.78%	0.00%
过去一年	-13.99%	1.95%	-14.79%	1.94%	0.80%	0.01%
自基金合同 生效日起至 今	21.00%	2.21%	25.69%	2.30%	-4.69%	-0.09%

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



- 注：1、本基金合同于2024年07月02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		
张戈	本基金基金经理	2026年05月29日	-	13年	男，管理科学与工程专业博士。历任建信基金管理有限责任公司研究员、投资经理，大家保险资产管理公司投资经理。2022年9月加盟本公司。

注：1、上述任职日期/离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。
2、证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

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

本报告期内，本基金运作合法合规，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公平交易的执行情况包括：建立统一的研究平台和公共信息平台，保证各组合得到公平的投资资讯；公平对待不同投资组合，禁止各投资组合之间进行以利益输送为目的的投资交易活动；在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，严格执行授权审批程序；实行集中交易制度和公平交易分配制度；建立不同投资组合投资信息的管理及保密制度，保证不同投资组合经理之间的重大非公开投资信息的相互隔离；加强对投资交易行为的监察稽核力度，建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估体系等。

报告期内，公司公平交易程序运作良好，未出现异常情况；场外、网下业务公平交易制度执行情况良好，未出现异常情况。

公司对旗下各投资组合的交易行为进行监控和分析，对各投资组合不同时间窗口（1日、3日、5日）内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验，未发现违反公平交易原则的异常交易。

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易次数为0次，未发生不公平交易和利益输送。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026年一季度A股冲高回落、结构分化。1月"春季躁动"沪指突破4100点创10年新高，3月受美伊冲突、通胀与加息预期扰动快速回调。中观层面盈利筑底修复构成支撑，但内需偏弱、居民缩表、社融不及预期仍制约上行空间，两会"十五五"定调积极财政+宽

松货币托底；外部扰动较大，市场先定价美联储降息，随后沃什获提名偏鹰、美伊冲突推高油价，全球流动性预期从"降息"反转至"加息担忧"，风险偏好与无风险利率双杀，成长承压、防御占优。

二季度市场逐步进入地缘冲突与产业机遇交织的关键窗口。尽管面临美伊局势等外部变量带来的短期扰动，但随着美伊和平谅解备忘录签署、霍尔木兹海峡通航预期恢复，全球通胀和加息担忧明显降温，叠加海外市场率先反弹，A股市场风险偏好正在迎来修复，因此短期波动不掩盖结构性机会。

报告期内，基金管理人坚持以被动指数化投资为原则进行基金的投资运作，将基金的跟踪误差及跟踪偏离度控制在合理水平。日度偏离主要源于申赎资金及打新收益等。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2026年06月30日，天弘中证软件服务ETF发起联接A基金份额净值为1.2147元，天弘中证软件服务ETF发起联接C基金份额净值为1.2100元。报告期内份额净值增长率天弘中证软件服务ETF发起联接A为-18.92%，同期业绩比较基准增长率为-19.78%；天弘中证软件服务ETF发起联接C为-19.00%，同期业绩比较基准增长率为-19.78%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从中长期来看，旺盛的产业发展趋势才是决定板块定价的核心锚点，短期地缘消息、市场情绪和大盘整体波动终究只是次要变量，难以扭转高景气赛道的上行大方向。AI产业革命仍处于早期而非末期，具备通用技术变革属性，绝不能简单套用传统周期股的产能扩张、需求饱和、估值见顶框架来定价，而应将其视为跨越数年的成长赛道。软件行业作为AI产业链下游应用环节，未来订单有广阔增量空间。

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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，招商银行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§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：天弘中证软件服务交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金

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	34,292,160.94	26,976,077.80

结算备付金		479,538.60	277,882.57
存出保证金		146,815.76	254,885.89
交易性金融资产	6.4.7.2	434,809,647.57	370,054,070.53
其中：股票投资		398,509,647.57	370,054,070.53
基金投资		36,300,000.00	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		3,183,953.89	1,729,562.80
应收股利		-	-
应收申购款		4,768,912.20	4,133,398.35
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		477,681,028.96	403,425,877.94
负债和净资产	附注号	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		19,654,353.09	13,034,426.11
应付管理人报酬		154,873.44	144,168.37
应付托管费		38,718.38	36,042.12
应付销售服务费		70,798.14	66,022.90
应付投资顾问费		-	-

应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	146,253.57	254,890.47
负债合计		20,064,996.62	13,535,549.97
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	377,986,685.74	260,930,818.52
未分配利润	6.4.7.8	79,629,346.60	128,959,509.45
净资产合计		457,616,032.34	389,890,327.97
负债和净资产总计		477,681,028.96	403,425,877.94

注：报告截止日2026年06月30日，天弘中证软件服务交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金A类基金份额净值1.2147元，天弘中证软件服务交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金C类基金份额净值1.2100元；基金份额总额377,986,685.74份，其中天弘中证软件服务交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金A类基金份额55,542,262.06份，天弘中证软件服务交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金C类基金份额322,444,423.68份。

6.2 利润表

会计主体：天弘中证软件服务交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金

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		-149,510,920.89	-12,952,818.79
1.利息收入		68,466.07	24,703.34
其中：存款利息收入	6.4.7.9	68,466.07	24,703.34
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）		-42,170,940.80	-6,040,046.57
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-43,941,708.82	-6,655,325.29
基金投资收益	6.4.7.11	-237.71	-
债券投资收益	6.4.7.12	-	7,345.98
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	-	-
股利收益	6.4.7.16	1,771,005.73	607,932.74
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	-108,739,566.85	-7,385,881.80
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	1,331,120.69	448,406.24
减：二、营业总支出		1,874,904.84	633,801.73
1.管理人报酬		1,051,939.72	335,136.94
2.托管费		262,984.98	83,784.22
3.销售服务费		468,821.09	148,318.45
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		-	-
8.其他费用	6.4.7.20	91,159.05	66,562.12
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-151,385,825.73	-13,586,620.52

减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-151,385,825.73	-13,586,620.52
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-151,385,825.73	-13,586,620.52

6.3 净资产变动表

会计主体：天弘中证软件服务交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金

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	260,930,818.52	128,959,509.45	389,890,327.97
二、本期期初净资产	260,930,818.52	128,959,509.45	389,890,327.97
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	117,055,867.22	-49,330,162.85	67,725,704.37
（一）、综合收益总额	-	-151,385,825.73	-151,385,825.73
（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）	117,055,867.22	102,055,662.88	219,111,530.10
其中：1.基金申购款	1,046,037,325.45	562,330,931.77	1,608,368,257.22
2.基金赎回款	-928,981,458.23	-460,275,268.89	-1,389,256,727.12
（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	377,986,685.74	79,629,346.60	457,616,032.34
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	47,058,576.01	16,972,840.94	64,031,416.95
二、本期期初净资产	47,058,576.01	16,972,840.94	64,031,416.95
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	81,628,119.18	35,416,926.37	117,045,045.55
（一）、综合收益总额	-	-13,586,620.52	-13,586,620.52
（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）	81,628,119.18	49,003,546.89	130,631,666.07
其中：1.基金申购款	544,716,873.16	263,112,094.95	807,828,968.11
2.基金赎回款	-463,088,753.98	-214,108,548.06	-677,197,302.04
（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	128,686,695.19	52,389,767.31	181,076,462.50

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

天弘中证软件服务交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（以下简称“本基金”）由天弘中证软件服务指数型发起式证券投资基金变更而来，天弘中证软件服务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[2024]787号《关于准予天弘中证软件服务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募集，基金合同于2024年07月02日生效，首次设立募集规模为10,033,550.67份基金份额。本基金的运作方式为契约型开放式、发起式，存续期限不定。本基金的基金管理人为天弘基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

根据基金管理人于2026年05月28日发布的《关于天弘中证软件服务指数型发起式证券投资基金变更为天弘中证软件服务交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金并相应修订基金合同等法律文件的公告》，原天弘中证软件服务指数型发起式证券投资基金于2026年05月29日变更为天弘中证软件服务交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金。

本基金主要投资于目标ETF基金份额、标的指数的成份股和备选成份股（含存托凭证）。为更好地实现投资目标，本基金可能会少量投资于依法发行上市的非成份股（包括科创板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债的纯债部分）、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、金融衍生工具（包括国债期货、股指期货、股票期权等）、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、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。本基金投资于目标ETF的资产比例不低于基金资产净值的90%，因法律法规的规定而受限制的情形除外；本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权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。股指期货、国债期货、股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定

执行。如法律法规或中国证监会变更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	34,292,160.94
等于：本金	34,289,078.92
加：应计利息	3,082.02
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	34,292,160.94

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	522,594,938.68	-	398,509,647.57	-124,085,291.11
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债 交易所市场	-	-	-	-

券	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		39,770,236.49	-	36,300,000.00	-3,470,236.49
其他		-	-	-	-
合计		562,365,175.17	-	434,809,647.57	-127,555,527.60

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,267.28
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	65,643.13
其中：交易所市场	65,643.13
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	79,343.16
合计	146,253.57

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 天弘中证软件服务ETF发起联接A

金额单位：人民币元

项目 (天弘中证软件服务ETF发起 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	24,313,054.81	24,313,054.81
本期申购	76,266,762.08	76,266,762.08
本期赎回（以“-”号填列）	-45,037,554.83	-45,037,554.83
本期末	55,542,262.06	55,542,262.06

6.4.7.7.2 天弘中证软件服务ETF发起联接C

金额单位：人民币元

项目 (天弘中证软件服务ETF发起 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	236,617,763.71	236,617,763.71
本期申购	969,770,563.37	969,770,563.37
本期赎回（以“-”号填列）	-883,943,903.40	-883,943,903.40
本期末	322,444,423.68	322,444,423.68

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 天弘中证软件服务ETF发起联接A

单位：人民币元

项目 (天弘中证软件服务ET F发起联接A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	619,295.43	11,492,042.53	12,111,337.96
本期期初	619,295.43	11,492,042.53	12,111,337.96
本期利润	-5,564,962.77	-12,710,038.91	-18,275,001.68

本期基金份额交易产生的变动数	356,769.92	17,730,058.27	18,086,828.19
其中：基金申购款	539,940.48	39,595,996.80	40,135,937.28
基金赎回款	-183,170.56	-21,865,938.53	-22,049,109.09
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-4,588,897.42	16,512,061.89	11,923,164.47

6.4.7.8.2 天弘中证软件服务ETF发起联接C

单位：人民币元

项目 (天弘中证软件服务ETF发起联接C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	5,090,046.44	111,758,125.05	116,848,171.49
本期期初	5,090,046.44	111,758,125.05	116,848,171.49
本期利润	-37,081,296.11	-96,029,527.94	-133,110,824.05
本期基金份额交易产生的变动数	3,738,296.41	80,230,538.28	83,968,834.69
其中：基金申购款	6,209,431.58	515,985,562.91	522,194,994.49
基金赎回款	-2,471,135.17	-435,755,024.63	-438,226,159.80
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-28,252,953.26	95,959,135.39	67,706,182.13

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	67,022.12
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	1,023.45
其他	420.50
合计	68,466.07

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	-39,129,356.82
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-4,812,352.00
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-43,941,708.82

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	315,103,459.22
减：卖出股票成本总额	353,849,407.50
减：交易费用	383,408.54
买卖股票差价收入	-39,129,356.82

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	39,770,236.49
减：现金支付申购款总额	14,888,482.64
减：申购股票成本总额	29,694,105.85
减：交易费用	-
申购差价收入	-4,812,352.00

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	-
减：卖出/赎回基金成本总额	-
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	-
减：交易费用	237.71
基金投资收益	-237.71

6.4.7.12 债券投资收益

本基金本报告期未取得债券投资收益。

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

本基金本报告期未取得其他衍生工具投资收益。

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	1,771,005.73
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	1,771,005.73

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	-108,739,566.85
——股票投资	-105,269,330.36
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-3,470,236.49
——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	-108,739,566.85

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	1,209,610.51
基金转换费收入	121,510.18
合计	1,331,120.69

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	19,835.79
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	11,815.89
合计	91,159.05

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
招商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
天弘中证软件服务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

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至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	1,051,939.72	335,136.94
其中：应支付销售机构的客户维护费	510,861.39	129,240.47
应支付基金管理人的净管理费	541,078.33	205,896.47

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(若为负数，则取0)0.40%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-前一日所持有目标ETF基金份额部分的基金资产)×该日适用费率/当年天数。

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026	上年度可比期间 2025年01月01日至2025
----	------------------------	-----------------------------

	年06月30日	年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	262,984.98	83,784.22

注:本基金基金财产中投资于目标ETF的部分不收取托管费,支付基金托管人招商银行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(若为负数,则取0)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-前一日所持有目标ETF基金份额部分的基金资产)×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		
	天弘中证软件服务ETF发起联接A	天弘中证软件服务ETF发起联接C	合计
天弘基金管理有限公司	-	8,914.42	8,914.42
招商银行股份有限公司	-	26,136.57	26,136.57
合计	-	35,050.99	35,050.99
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		
	天弘中证软件服务ETF发起联接A	天弘中证软件服务ETF发起联接C	合计
天弘基金管理有限公司	-	8,022.55	8,022.55
招商银行股份有限公司	-	166.91	166.91

公司			
合计	-	8,189.46	8,189.46

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。天弘中证软件服务ETF发起联接C的销售服务费率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、天弘中证软件服务ETF发起联接A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

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2026年01月01日至2026年06月30日	2025年01月01日至2025年06月30日

	天弘中证软件 服务ETF发起 联接A	天弘中证软件 服务ETF发起 联接C	天弘中证软件 服务ETF发起 联接A	天弘中证软件 服务ETF发起 联接C
报告期初持有的基 金份额	5,000,111.13	5,000,111.11	5,000,111.13	5,000,111.11
报告期间申购/买入 总份额	-	-	-	-
报告期间因拆分变 动份额	-	-	-	-
减：报告期间赎回/ 卖出总份额	-	-	-	-
报告期末持有的基 金份额	5,000,111.13	5,000,111.11	5,000,111.13	5,000,111.11
报告期末持有的基 金份额占基金总份 额比例	9.00%	1.55%	35.26%	4.37%

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

天弘中证软件服务ETF发起联接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。

天弘中证软件服务ETF发起联接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。

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
招商银行	34,292,160.94	67,022.12	19,349,835.13	23,502.72

股份有限 公司				
------------	--	--	--	--

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

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44,000,000.00份目标ETF基金份额（上年度末：0.00份），占其总份额的比例为12.72%（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
3016 66	大普 微	2026 -04-0 8	6个月	新股 流通 受限	46.08	463.3 3	671	30,91 9.68	310,8 94.43	-
6887 81	视涯 科技	2026 -03-1 8	9个月	新股 流通 受限	22.68	42.16	4,797	108,7 95.96	202,2 41.52	-
6888 08	联讯 仪器	2026 -04-1 6	6个月	新股 流通 受限	81.88	1,58 4.33	116	9,49 8.08	183,7 82.28	-
0012 48	华润 新能 源	2026 -06-2 4	6个月	新股 流通 受限	10.11	10.11	13,541	136,8 99.51	136,8 99.51	-

688820	盛合晶微	2026-04-13	6个月	新股流通受限	19.68	141.49	636	12,516.48	89,987.64	-
688818	电科蓝天	2026-02-03	6个月	新股流通受限	9.47	70.14	1,162	11,004.14	81,502.68	-
301682	宏明电子	2026-03-18	6个月	新股流通受限	69.66	160.06	480	33,436.80	76,828.80	-
001248	华润新能源	2026-06-24	1个月内(含)	新股未上市	10.11	10.11	5,802	58,658.22	58,658.22	-
688712	北芯生命	2026-01-28	6个月	新股流通受限	17.52	35.92	1,500	26,280.00	53,880.00	-
688785	恒运昌	2026-01-20	6个月	新股流通受限	92.18	463.15	103	9,494.54	47,704.45	-
688813	泰金新能	2026-03-24	6个月	新股流通受限	26.28	172.09	234	6,149.52	40,269.06	-
688635	长进光子	2026-05-20	6个月	新股流通受限	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	-
001257	盛龙股份	2026-03-24	6个月	新股流通受限	7.82	20.74	1,743	13,630.26	36,149.82	-
603459	红板科技	2026-03-31	6个月	新股流通受限	17.70	84.32	287	5,079.90	24,199.84	-
688811	有研复材	2026-04-01	6个月	新股流通受限	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-

301696	三瑞智能	2026-03-31	6个月	新股流通受限	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-
001365	天海电子	2026-05-11	6个月	新股流通受限	27.19	31.31	523	14,220.37	16,375.13	-
301669	高特电子	2026-06-02	6个月	新股流通受限	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-
301687	新广益	2025-12-24	6个月	新股流通受限	21.93	77.78	195	4,276.35	15,167.10	-
301531	春光集团	2026-04-28	6个月	新股流通受限	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	-
001393	维通利	2026-05-08	6个月	新股流通受限	30.38	38.99	371	11,270.98	14,465.29	-
301599	理奇智能	2026-04-22	6个月	新股流通受限	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	-
301680	固德电材	2026-02-27	6个月	新股流通受限	58.00	112.16	117	6,786.00	13,122.72	-
001237	惠康科技	2026-05-15	6个月	新股流通受限	53.26	58.74	222	11,823.72	13,040.28	-
301683	慧谷新材	2026-03-24	6个月	新股流通受限	78.38	121.77	96	7,524.48	11,689.92	-
603407	长裕集团	2026-04-29	6个月	新股流通受限	13.86	73.46	137	1,898.82	10,064.02	-

688816	易思维	2026-02-04	6个月	新股流通受限	55.95	57.10	172	9,623.40	9,821.20	-
301513	尚水智能	2026-04-10	6个月	新股流通受限	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-
601112	振石股份	2026-01-21	6个月	新股流通受限	11.18	17.59	372	4,158.96	6,543.48	-
603435	嘉德利	2026-05-15	6个月	新股流通受限	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603352	至信股份	2026-01-08	6个月	新股流通受限	21.88	25.52	112	2,450.56	2,858.24	-
603293	埃泰克	2026-04-09	6个月	新股流通受限	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-
001312	福恩股份	2026-04-14	6个月	新股流通受限	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	-
603284	林平发展	2026-02-03	6个月	新股流通受限	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	-
001220	世盟股份	2026-01-27	6个月	新股流通受限	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级的债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级的同业存单。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级的债券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级的同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险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	34,292,160.94	-	-	-	34,292,160.94
结算备付金	479,538.60	-	-	-	479,538.60
存出保证金	146,815.76	-	-	-	146,815.76
交易性金融资产	-	-	-	434,809,647.57	434,809,647.57
应收清算款	-	-	-	3,183,953.89	3,183,953.89
应收申购款	-	-	-	4,768,912.20	4,768,912.20

资产总计	34,918,515.30	-	-	442,762,513.66	477,681,028.96
负债					
应付赎回款	-	-	-	19,654,353.09	19,654,353.09
应付管理人报酬	-	-	-	154,873.44	154,873.44
应付托管费	-	-	-	38,718.38	38,718.38
应付销售服务费	-	-	-	70,798.14	70,798.14
其他负债	-	-	-	146,253.57	146,253.57
负债总计	-	-	-	20,064,996.62	20,064,996.62
利率敏感度缺口	34,918,515.30	-	-	422,697,517.04	457,616,032.34
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	26,976,077.80	-	-	-	26,976,077.80
结算备付金	277,882.57	-	-	-	277,882.57
存出保证金	254,885.89	-	-	-	254,885.89
交易性金融资产	-	-	-	370,054,070.53	370,054,070.53
应收清算款	-	-	-	1,729,562.80	1,729,562.80
应收申购款	-	-	-	4,133,398.35	4,133,398.35
资产总计	27,508,846.26	-	-	375,917,031.68	403,425,877.94
负债					
应付赎回款	-	-	-	13,034,426.11	13,034,426.11
应付管理人报酬	-	-	-	144,168.37	144,168.37
应付托管费	-	-	-	36,042.12	36,042.12
应付销售服务费	-	-	-	66,022.90	66,022.90
其他负债	-	-	-	254,890.47	254,890.47
负债总计	-	-	-	13,535,549.97	13,535,549.97
利率敏感度缺口	27,508,846.26	-	-	362,381,481.71	389,890,327.97

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

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

6.4.13.4.2 外汇风险

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

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于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 (%)
交易性金融资产—股票投资	398,509,647.57	87.08	370,054,070.53	94.91
交易性金融资产—基金投资	36,300,000.00	7.93	-	-
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	434,809,647.57	95.02	370,054,070.53	94.91
----	----------------	-------	----------------	-------

注：由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位：人民币元)	
		本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
	业绩比较基准上升5%	23,170,017.74	19,898,279.99
	业绩比较基准下降5%	-23,170,017.74	-19,898,279.99

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

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

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
第一层次	433,210,892.81	368,966,048.18
第二层次	195,557.73	-
第三层次	1,403,197.03	1,088,022.35
合计	434,809,647.57	370,054,070.53

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2026年06月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2025年12月31日：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	398,509,647.57	83.43
	其中：股票	398,509,647.57	83.43
2	基金投资	36,300,000.00	7.60
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-

7	银行存款和结算备付金合计	34,771,699.54	7.28
8	其他各项资产	8,099,681.85	1.70
9	合计	477,681,028.96	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	-	-
B	采矿业	36,149.82	0.01
C	制造业	1,365,463.75	0.30
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	195,557.73	0.04
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,583.46	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	335,091,034.00	73.23
J	金融业	61,819,858.81	13.51
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	398,509,647.57	87.08

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	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资
---	------	------	-------	---------	------

号					产净值比例(%)
1	002230	科大讯飞	1,119,396	45,716,132.64	9.99
2	300033	同花顺	175,440	42,281,040.00	9.24
3	688111	金山办公	134,952	28,751,523.60	6.28
4	002261	拓维信息	733,800	20,553,738.00	4.49
5	300803	指南针	213,143	19,538,818.81	4.27
6	600570	恒生电子	882,300	18,695,937.00	4.09
7	300339	润和软件	463,800	17,860,938.00	3.90
8	601360	三六零	2,038,600	17,715,434.00	3.87
9	301236	软通动力	361,800	15,358,410.00	3.36
10	300454	深信服	150,820	14,508,884.00	3.17
11	300496	中科创达	215,229	13,298,999.91	2.91
12	688343	云天励飞	146,633	11,974,050.78	2.62
13	600588	用友网络	1,194,300	10,963,674.00	2.40
14	300383	光环新网	837,500	10,418,500.00	2.28
15	688568	XD中科星	235,283	9,757,186.01	2.13
16	002065	东华软件	1,307,000	9,331,980.00	2.04
17	300170	汉得信息	605,900	9,233,916.00	2.02
18	600536	中国软件	326,490	9,180,898.80	2.01
19	002405	四维图新	1,381,000	8,935,070.00	1.95
20	600845	宝信软件	500,300	8,319,989.00	1.82
21	688692	达梦数据	32,984	8,057,661.36	1.76
22	002410	广联达	962,000	7,849,920.00	1.72
23	688615	合合信息	68,498	7,747,123.80	1.69
24	300253	卫宁健康	1,025,400	6,900,942.00	1.51
25	688318	财富趋势	83,538	5,957,094.78	1.30
26	300682	朗新科技	439,700	4,353,030.00	0.95
27	688561	奇安信	158,879	3,809,918.42	0.83
28	301638	南网数字	148,100	3,561,805.00	0.78
29	002153	石基信息	477,030	3,448,926.90	0.75

30	603171	税友股份	71,000	2,829,350.00	0.62
31	301666	大普微	671	310,894.43	0.07
32	688781	视涯科技	4,797	202,241.52	0.04
33	001248	华润新能源	19,343	195,557.73	0.04
34	688808	联讯仪器	116	183,782.28	0.04
35	688820	盛合晶微	636	89,987.64	0.02
36	688818	电科蓝天	1,162	81,502.68	0.02
37	301682	宏明电子	480	76,828.80	0.02
38	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.01
39	688785	恒运昌	103	47,704.45	0.01
40	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.01
41	688635	长进光子	128	39,448.32	0.01
42	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.01
43	603459	红板科技	287	24,199.84	0.01
44	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
45	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
46	001365	天海电子	523	16,375.13	0.00
47	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
48	301687	新广益	195	15,167.10	0.00
49	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
50	001393	维通利	371	14,465.29	0.00
51	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
52	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
53	001237	惠康科技	222	13,040.28	0.00
54	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
55	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
56	688816	易思维	172	9,821.20	0.00
57	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
58	601112	振石股份	372	6,543.48	0.00
59	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
60	603352	至信股份	112	2,858.24	0.00

61	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
62	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00
63	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
64	001220	世盟股份	57	1,583.46	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	69,057,510.51	17.71
2	300033	同花顺	41,634,582.72	10.68
3	688111	金山办公	37,577,173.87	9.64
4	600570	恒生电子	23,603,989.12	6.05
5	300803	指南针	23,326,692.13	5.98
6	002261	拓维信息	23,123,405.00	5.93
7	601360	三六零	22,004,090.00	5.64
8	300339	润和软件	21,797,242.00	5.59
9	300454	深信服	19,320,612.46	4.96
10	301236	软通动力	16,641,903.78	4.27
11	600588	用友网络	15,389,593.00	3.95
12	300496	中科创达	14,727,652.32	3.78
13	688568	XD中科星	14,570,788.40	3.74
14	600536	中国软件	12,885,438.61	3.30
15	002405	四维图新	12,773,812.08	3.28
16	300383	光环新网	11,936,593.55	3.06
17	300170	汉得信息	11,680,370.00	3.00
18	002410	广联达	11,549,479.00	2.96
19	002065	东华软件	11,049,151.00	2.83
20	688615	合合信息	10,818,605.89	2.77

21	688343	云天励飞	10,808,491.85	2.77
22	300253	卫宁健康	10,361,893.60	2.66
23	600845	宝信软件	10,239,586.04	2.63
24	688692	达梦数据	8,246,428.66	2.12

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	002230	科大讯飞	46,683,719.85	11.97
2	300033	同花顺	22,994,072.00	5.90
3	688111	金山办公	21,896,175.60	5.62
4	600570	恒生电子	14,401,930.44	3.69
5	002261	拓维信息	13,723,538.00	3.52
6	601360	三六零	13,519,163.00	3.47
7	300803	指南针	12,846,421.40	3.29
8	300339	润和软件	11,895,023.74	3.05
9	301236	软通动力	10,609,776.66	2.72
10	603613	国联股份	10,275,321.76	2.64
11	300454	深信服	9,597,509.51	2.46
12	600588	用友网络	8,809,120.73	2.26
13	688088	虹软科技	8,703,183.19	2.23
14	002439	启明星辰	8,627,019.50	2.21
15	688568	XD中科星	8,210,031.70	2.11
16	300496	中科创达	8,036,941.16	2.06
17	600536	中国软件	7,660,510.44	1.96
18	002405	四维图新	7,319,409.50	1.88
19	688343	云天励飞	7,102,675.64	1.82

20	300383	光环新网	6,963,442.00	1.79
----	--------	------	--------------	------

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	517,268,420.75
卖出股票收入（成交）总额	315,103,459.22

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 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	股票型	交易型开	天弘基金	36,300,000.00	7.93

	软件服务 交易型开 放式指数 证券投资 基金		放式	管理有限 公司		
--	------------------------------------	--	----	------------	--	--

7.11 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。

7.12 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	146,815.76
2	应收清算款	3,183,953.89
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	4,768,912.20
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	8,099,681.85

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 软件 服务E TF发 起联 接A	6,267	8,862.66	5,000,111.13	9.00%	50,542,150.93	91.00%
天弘 中证 软件 服务E TF发 起联 接C	43,286	7,449.16	6,534,941.81	2.03%	315,909,481.87	97.97%
合计	49,179	7,685.94	11,535,052.94	3.05%	366,451,632.80	96.95%

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	天弘中证软件服务ETF发起联接A	-	-
	天弘中证软件服务ETF发起联接C	48,224.18	0.01%
	合计	48,224.18	0.01%

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	天弘中证软件服务ETF发起联接A	0
	天弘中证软件服务ETF发起联接C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	天弘中证软件服务ETF发起联接A	0
	天弘中证软件服务ETF发起联接C	0
	合计	0

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	10,000,222.24	2.65%	10,000,222.24	2.65%	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	10,000,222.24	2.65%	10,000,222.24	2.65%	-

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	天弘中证软件服务ETF 发起联接A	天弘中证软件服务ETF 发起联接C
基金合同生效日(2024年07月02 日)基金份额总额	5,009,223.66	5,024,327.01
本报告期期初基金份额总额	24,313,054.81	236,617,763.71
本报告期基金总申购份额	76,266,762.08	969,770,563.37
减：本报告期基金总赎回份额	45,037,554.83	883,943,903.40
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	55,542,262.06	322,444,423.68

§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，基金托管人无重大人事变动。

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。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，基金管理人根据法律法规及《基金合同》等法律文件的相关规定，与基金托管人协商一致，决定自2026年5月29日起，将天弘中证软件服务指数型发起式证券投资基金变更为天弘中证软件服务交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金并相应修订法律文件，具体信息请参见基金管理人在规定媒介披露的《关于天弘中证软件服务指数型发起式证券投资基金变更为天弘中证软件服务交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金并相应修订基金合同等法律文件的公告》。

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，基金托管人没有受到监管部门调查或处罚。

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，基金托管人相关从业人员没有受到监管部门调查或处罚。

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

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	
广发证券	2	-	-	-	-	-
国投证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	-	-	-	-	-
华创证券	1	-	-	-	-	-
华西证券	2	101,849,388.37	12.27%	21,175.91	12.27%	-
山西证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
中信建投证券	4	728,422,865.37	87.73%	151,444.05	87.73%	-

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：山西证券上海交易单元1个，西部证券深圳交易单元1个，中信建投证券上海交易单元1个，中信建投证券深圳交易单元1个。

4、本基金报告期内停止租用交易单元：无。

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	天弘中证软件服务指数型发起式证券投资基金2025年第4季度报告	中国证监会规定媒介	2026-01-22
2	天弘中证软件服务指数型发起式证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会规定媒介	2026-03-07
3	天弘中证软件服务指数型发起式证券投资基金2025年年度报告	中国证监会规定媒介	2026-03-31
4	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
5	天弘中证软件服务指数型发起式证券投资基金2026年第1季度报告	中国证监会规定媒介	2026-04-22
6	天弘基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定媒介	2026-04-27
7	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
8	关于天弘中证软件服务指数型发起式证券投资基金变更为天弘中证软件服务交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金并相应修订基金合同等法律文件的公告	中国证监会规定媒介	2026-05-28
9	天弘中证软件服务交易型开放式指数证券投资基金发起	中国证监会规定媒介	2026-05-29

	式联接基金基金合同		
10	天弘中证软件服务交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金托管协议	中国证监会规定媒介	2026-05-29
11	天弘中证软件服务交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金招募说明书（更新）	中国证监会规定媒介	2026-05-29
12	天弘中证软件服务交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（A类份额）基金产品资料概要（更新）	中国证监会规定媒介	2026-05-29
13	天弘中证软件服务交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（C类份额）基金产品资料概要（更新）	中国证监会规定媒介	2026-05-29
14	天弘基金管理有限公司关于终止中证金牛（北京）基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会规定媒介	2026-05-29
15	天弘基金管理有限公司关于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
16	天弘中证软件服务交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（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
17	天弘中证软件服务交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金（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 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