

天弘中证 A500 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:平安银行股份有限公司

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。

基金托管人平安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	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
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	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	18
6.3 净资产变动表	19
6.4 报表附注	21
§7 投资组合报告	48
7.1 期末基金资产组合情况	48
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	49
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	49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	66
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	68
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	68
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	68
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	68
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	68
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	69
7.11 本基金投资股指期货的投资政策	69
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	69
7.13 投资组合报告附注	69
§8 基金份额持有人信息	70
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	70

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	71
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	71
§9 开放式基金份额变动	72
§10 重大事件揭示	72
10.1 基金份额持有人大会决议	72
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	72
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	73
10.4 基金投资策略的改变	73
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	73
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	73
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	74
10.8 其他重大事件	76
§11 影响投资者决策的其他重要信息	78
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	78
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	78
§12 备查文件目录	78
12.1 备查文件目录	78
12.2 存放地点	78
12.3 查阅方式	78

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	天弘中证A500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A500ETF联接		
基金主代码	022428		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2024年11月07日		
基金管理人	天弘基金管理有限公司		
基金托管人	平安银行股份有限公司		
报告期末基金份额总额	1,111,114,286.25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A500ETF联接A	天弘中证A500ETF联接C	天弘中证A500ETF联接Y
下属分级基金的交易代码	022428	022429	022966
报告期末下属分级基金的份额总额	491,097,023.36份	595,895,733.57份	24,121,529.32份

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	天弘中证A500交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	159360
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2024年11月20日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2024年11月28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	平安银行股份有限公司

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的资产比例不低于基金资产净值的90%。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A500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，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A500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	平安银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	童建林	潘琦
	联系电话	022-83310208	0755-22168257
	电子邮箱	service@thfund.com.cn	PANQI003@pingan.com.cn
客户服务电话		400-986-8888	95511-3
传真		022-83865564	0755-82080387
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	广东省深圳市罗湖区深南东路5047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	广东省深圳市福田区益田路5023号平安金融中心B座
邮政编码		300203	518001
法定代表人		黄辰立	谢永林

2.4 信息披露方式

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

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	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A500ETF联接A	天弘中证A500ETF联接C	天弘中证A500ETF联接Y
本期已实现收益	51,711,557.54	60,623,813.49	1,932,893.57
本期利润	98,697,511.90	100,253,061.36	3,213,866.43
加权平均基金份额本期利润	0.1799	0.1499	0.1550
本期加权平均净值利润率	13.98%	11.69%	12.03%
本期基金份额净值增长率	12.59%	12.48%	12.59%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2026年06月30日)		
	天弘中证A500ETF联接A	天弘中证A500ETF联接C	天弘中证A500ETF联接Y
期末可供分配利润	74,978,770.49	88,559,036.88	3,682,492.71
期末可供分配基金份额利润	0.1527	0.1486	0.1527
期末基金资产净值	676,846,327.56	818,578,789.75	33,244,763.41
期末基金份额净值	1.3782	1.3737	1.3782
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	37.82%	37.37%	39.34%

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A500ETF联接A

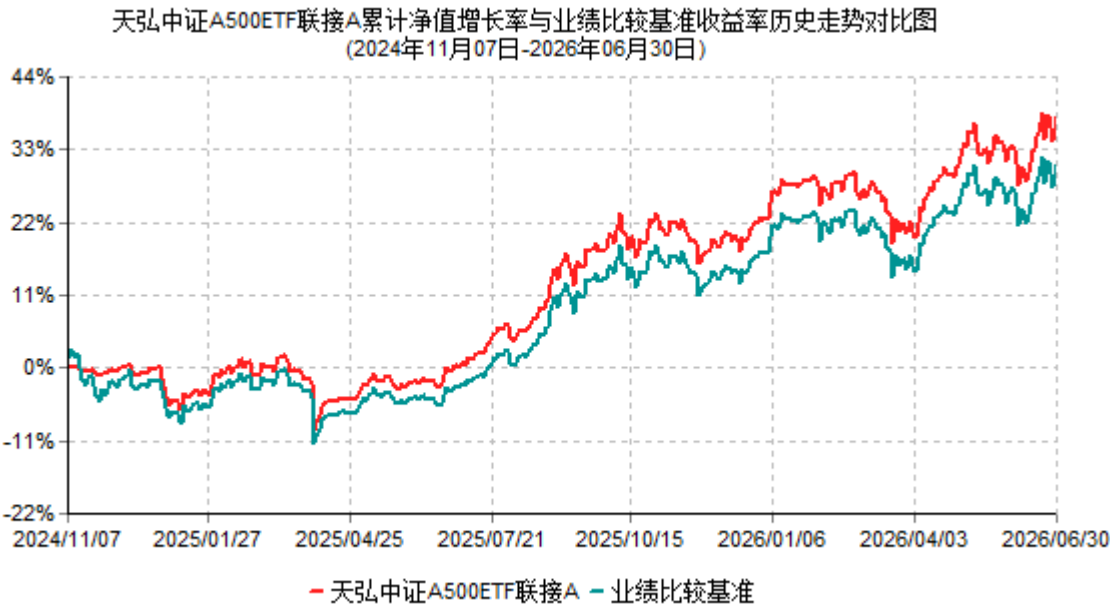
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	14.61%	1.33%	13.54%	1.34%	1.07%	-0.01%
过去六个月	12.59%	1.22%	11.34%	1.22%	1.25%	0.00%
过去一年	37.44%	1.09%	34.41%	1.09%	3.03%	0.00%
自基金合同 生效日起至 今	37.82%	1.03%	30.60%	1.08%	7.22%	-0.05%

天弘中证A500ETF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	14.56%	1.33%	13.54%	1.34%	1.02%	-0.01%
过去六个月	12.48%	1.22%	11.34%	1.22%	1.14%	0.00%
过去一年	37.16%	1.09%	34.41%	1.09%	2.75%	0.00%
自基金合同 生效日起至	37.37%	1.03%	30.60%	1.08%	6.77%	-0.05%

今						
天弘中证A500ETF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	14.61%	1.33%	13.54%	1.34%	1.07%	-0.01%
过去六个月	12.59%	1.22%	11.34%	1.22%	1.25%	0.00%
过去一年	37.45%	1.09%	34.41%	1.09%	3.04%	0.00%
自基金份额 首次确认日 起至今	39.34%	1.06%	34.83%	1.06%	4.51%	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A500ETF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
(2024年11月07日-2026年06月30日)天弘中证A500ETF联接Y累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2024年12月17日-2026年06月30日)

注：1、本基金合同于2024年11月07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2024年12月13日起增设天弘中证A500ETF联接Y基金份额。天弘中证A500ETF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	2024年11月25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	2025年03月07	-	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

		日			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遵规守信情况的说明

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A500指数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A500ETF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。

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A500ETF联接A基金份额净值为1.3782元，天弘中证A500ETF联接C基金份额净值为1.3737元，天弘中证A500ETF联接Y基金份额净值为1.3782元。报告期内份额净值增长率天弘中证A500ETF联接A为12.59%，同期业绩比较基准增长率为11.34%；天弘中证A500ETF联接C为12.48%，同期业绩比较基准增长率为11.34%；天弘中证A500ETF联接Y为12.59%，同期业绩比较基准增长率为11.34%。

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

本基金本报告期末未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内本基金管理人无应说明预警信息。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，平安银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本报告期，本托管人复核的财务指标、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真实、准确、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A500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	84,738,776.43	91,658,617.74
结算备付金		32,992.70	400,134.99
存出保证金		794,367.62	964,273.27
交易性金融资产	6.4.7.2	1,449,096,346.02	1,661,710,828.86
其中：股票投资		61,540,661.13	68,258,021.03
基金投资		1,387,552,684.75	1,587,689,223.94
债券投资		3,000.14	5,763,583.89
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		-	2,114,197.31
应收股利		-	-
应收申购款		6,474,961.86	9,712,830.25
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		1,541,137,444.63	1,766,560,882.42
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		12,178,140.85	21,063,394.27
应付管理人报酬		15,507.89	17,624.98
应付托管费		5,169.28	5,874.99
应付销售服务费		130,836.86	155,342.52
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	137,909.03	196,696.54
负债合计		12,467,563.91	21,438,933.30
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	1,111,114,286.25	1,427,279,740.25
未分配利润	6.4.7.8	417,555,594.47	317,842,208.87

净资产合计		1,528,669,880.72	1,745,121,949.12
负债和净资产总计		1,541,137,444.63	1,766,560,882.42

注：报告截止日2026年06月30日，天弘中证A500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1.3782元，天弘中证A500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1.3737元，天弘中证A500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1.3782元；基金份额总额1,111,114,286.25份，其中天弘中证A500交易型开放式指数证券投资基金联接基金A类基金份额491,097,023.36份，天弘中证A500交易型开放式指数证券投资基金联接基金C类基金份额595,895,733.57份，天弘中证A500交易型开放式指数证券投资基金联接基金Y类基金份额24,121,529.32份。

6.2 利润表

会计主体：天弘中证A500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		203,224,687.99	59,443,093.57
1.利息收入		162,719.28	311,489.33
其中：存款利息收入	6.4.7.9	162,719.28	311,489.33
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）		115,083,251.04	363,717.52
其中：股票投资收益	6.4.7.10	8,312,711.66	-1,956,366.47
基金投资收益	6.4.7.11	106,370,241.32	978,067.73
债券投资收益	6.4.7.12	6,633.25	5,863.22
资产支持证券投资	6.4.7.13	-	-

收益			
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	393,664.81	1,336,153.04
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	87,896,175.09	58,650,200.98
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	82,542.58	117,685.74
减：二、营业总支出		1,060,248.30	2,229,328.44
1.管理人报酬		88,515.63	203,382.00
2.托管费		29,505.18	67,794.01
3.销售服务费		851,479.52	1,912,035.44
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	90,747.97	46,116.99
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		202,164,439.69	57,213,765.13
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		202,164,439.69	57,213,765.13
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		202,164,439.69	57,213,765.13

6.3 净资产变动表

会计主体：天弘中证A500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	1,427,279,740.25	317,842,208.87	1,745,121,949.12
二、本期期初净资产	1,427,279,740.25	317,842,208.87	1,745,121,949.12
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-316,165,454.00	99,713,385.60	-216,452,068.40
（一）、综合收益总额	-	202,164,439.69	202,164,439.69
（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）	-316,165,454.00	-102,451,054.09	-418,616,508.09
其中：1.基金申购款	838,213,711.22	233,502,532.62	1,071,716,243.84
2.基金赎回款	-1,154,379,165.22	-335,953,586.71	-1,490,332,751.93
（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	1,111,114,286.25	417,555,594.47	1,528,669,880.72
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	3,583,081,468.57	-49,501,748.58	3,533,579,719.99
二、本期期初净资产	3,583,081,468.57	-49,501,748.58	3,533,579,719.99
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-969,980,420.91	54,613,902.98	-915,366,517.93
（一）、综合收益总额	-	57,213,765.13	57,213,765.13
（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）	-969,980,420.91	-2,599,862.15	-972,580,283.06
其中：1.基金申购款	1,143,627,756.73	-29,471,839.37	1,114,155,917.36
2.基金赎回款	-2,113,608,177.64	26,871,977.22	-2,086,736,200.42
（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	2,613,101,047.66	5,112,154.40	2,618,213,202.06

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

高阳

迟哲

薄贺龙

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

天弘中证A500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A500指数证券投资基金变更而来，天弘中证A500指数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]1443号《关于准予天弘中证A500指数证券投资基金注册的批复》的准许，由基金管理人天弘基金管理有限公司向社会公开发行人募集，基金合同于2024年11月07日生效，首次设立募集规模为3,895,790,609.34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，基金托管人为平安银行股份有限公司。

根据基金管理人于2024年11月23日发布的《关于天弘中证A500指数证券投资基金变更为天弘中证A500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A500指数证券投资基金于2024年11月25日变更为天弘中证A500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基金份额、标的指数成份股、备选成份股（含存托凭证）为主要投资对象。此外，为更好地实现基金的投资目标，本基金还可以投资于国内依法发行上市的非成份股（包括主板、科创板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票）、存托凭证、债券（包括国债、央行票据、地方政府债、政府支持债券、政府支持机构债券、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、货币市场工具、同业存单、债券回购、资产支持证券、银行存款、金融衍生工具（国债期货、股指期货、股票期权等）以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。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；每个交易日日终在扣除国债期货、股指期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，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。国债期货、股指期货、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。如法律法规或监管机构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	84,738,776.43

等于：本金	84,729,718.45
加：应计利息	9,057.98
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	84,738,776.43

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		59,590,163.53	-	61,540,661.13	1,950,497.60
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	3,000.00	0.14	3,000.14	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	3,000.00	0.14	3,000.14	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		1,029,090,311.88	-	1,387,552,684.75	358,462,372.87
其他		-	-	-	-

合计	1,088,683,475.41	0.14	1,449,096,346.02	360,412,870.47
----	------------------	------	------------------	----------------

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	-
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	47,161.06
其中：交易所市场	47,161.06
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	90,747.97
合计	137,909.03

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 天弘中证A500ETF联接A

金额单位：人民币元

项目 (天弘中证A500ETF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	697,535,370.09	697,535,370.09
本期申购	346,967,259.67	346,967,259.67
本期赎回（以“-”号填列）	-553,405,606.40	-553,405,606.40
本期末	491,097,023.36	491,097,023.36

6.4.7.7.2 天弘中证A500ETF联接C

金额单位：人民币元

项目 (天弘中证A500ETF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	716,971,753.14	716,971,753.14
本期申购	473,202,784.39	473,202,784.39
本期赎回（以“-”号填列）	-594,278,803.96	-594,278,803.96
本期末	595,895,733.57	595,895,733.57

6.4.7.7.3 天弘中证A500ETF联接Y

金额单位：人民币元

项目 (天弘中证A500ETF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	12,772,617.02	12,772,617.02
本期申购	18,043,667.16	18,043,667.16
本期赎回（以“-”号填列）	-6,694,754.86	-6,694,754.86
本期末	24,121,529.32	24,121,529.32

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A500ETF联接A

单位：人民币元

项目 (天弘中证A500ETF联接A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	40,754,989.86	115,568,101.64	156,323,091.50
本期期初	40,754,989.86	115,568,101.64	156,323,091.50
本期利润	51,711,557.54	46,985,954.36	98,697,511.90
本期基金份额交易产生的变动数	-17,487,776.91	-51,783,522.29	-69,271,299.20
其中：基金申购款	35,113,004.44	59,420,941.96	94,533,946.40
基金赎回款	-52,600,781.35	-111,204,464.25	-163,805,245.60
本期已分配利润	-	-	-
本期末	74,978,770.49	110,770,533.71	185,749,304.20

6.4.7.8.2 天弘中证A500ETF联接C

单位：人民币元

项目 (天弘中证A500ETF联接C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	40,080,874.97	118,576,019.95	158,656,894.92
本期期初	40,080,874.97	118,576,019.95	158,656,894.92
本期利润	60,623,813.49	39,629,247.87	100,253,061.36
本期基金份额交易产生的变动数	-12,145,651.58	-24,081,248.52	-36,226,900.10
其中：基金申购款	45,462,390.86	88,445,450.40	133,907,841.26
基金赎回款	-57,608,042.44	-112,526,698.92	-170,134,741.36
本期已分配利润	-	-	-
本期末	88,559,036.88	134,124,019.30	222,683,056.18

6.4.7.8.3 天弘中证A500ETF联接Y

单位：人民币元

项目 (天弘中证A500ETF联	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
---------------------	-------	-------	---------

接Y)			
上年度末	746,072.47	2,116,149.98	2,862,222.45
本期期初	746,072.47	2,116,149.98	2,862,222.45
本期利润	1,932,893.57	1,280,972.86	3,213,866.43
本期基金份额交易产生的变动数	1,003,526.67	2,043,618.54	3,047,145.21
其中：基金申购款	1,722,461.92	3,338,283.04	5,060,744.96
基金赎回款	-718,935.25	-1,294,664.50	-2,013,599.75
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,682,492.71	5,440,741.38	9,123,234.09

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	160,117.67
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	1,243.05
其他	1,358.56
合计	162,719.28

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	7,862,732.28
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	449,979.38
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	8,312,711.66

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	387,080,725.51
减：卖出股票成本总额	378,877,665.92
减：交易费用	340,327.31
买卖股票差价收入	7,862,732.28

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	35,299,664.36
减：现金支付申购款总额	18,319,512.59
减：申购股票成本总额	16,530,172.39
减：交易费用	-
申购差价收入	449,979.38

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	484,952,253.64
减：卖出/赎回基金成本总额	378,577,708.85
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	-
减：交易费用	4,303.47
基金投资收益	106,370,241.32

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	2,536.25
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	4,097.00
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	6,633.25

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	5,766,120.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	5,695,903.00
减：应计利息总额	66,120.00
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	4,097.00

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	393,664.81
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	393,664.81

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	87,896,175.09
——股票投资	1,000,220.09
——债券投资	-4,097.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	86,900,052.00
——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	87,896,175.09

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	74,926.36
基金转换费收入	7,616.22
合计	82,542.58

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	-
合计	90,747.97

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
平安银行股份有限公司	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
天弘创新资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司
天弘中证A500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	88,515.63	203,382.00
其中：应支付销售机构的客户维护费	497,614.12	939,944.81

应支付基金管理人的净管理费	-409,098.49	-736,562.81
---------------	-------------	-------------

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)0.15%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。

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	29,505.18	67,794.01

注:本基金基金财产中投资于目标ETF的部分不收取托管费，支付基金托管人平安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)0.05%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A500ETF 联接A	天弘中证A500ETF 联接C	天弘中证A500ETF 联接Y	合计
	天弘基金	-	2,326.46	-

管理有限公司				
平安银行股份有限公司	-	531,792.48	-	531,792.48
合计	-	534,118.94	-	534,118.94
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A500ETF 联接A	天弘中证A500ETF 联接C	天弘中证A500ETF 联接Y	合计
天弘基金管理有限公司	-	17,853.65	-	17,853.65
平安银行股份有限公司	-	1,451,053.24	-	1,451,053.24
合计	-	1,468,906.89	-	1,468,906.89

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A500ETF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A500ETF联接A和天弘中证A500ETF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

份额单位：份

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		
	天弘中证A500ETF联接A	天弘中证A500ETF联接C	天弘中证A500ETF联接Y	天弘中证A500ETF联接A	天弘中证A500ETF联接C	天弘中证A500ETF联接Y
报告期初持有的基金份额	51,812,435.23	-	-	-	-	-
报告期间申购/买入总份额	-	-	-	51,812,435.23	-	-
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	51,812,435.23	-	-	51,812,435.23	-	-
报告期末持有的基金份额占基金	10.55%	-	-	5.25%	-	-

总份额比例						
-------	--	--	--	--	--	--

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A500ETF联接A

份额单位：份

关联方名称	本期末 2026年06月30日		上年度末 2025年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
天弘创新资产管理有限公司	38,005,091.98	7.74%	38,005,091.98	5.45%

注：1、除基金管理人之外的其他关联方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。

天弘中证A500ETF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A500ETF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
平安银行股份有限公司	84,738,776.43	160,117.67	149,582,886.21	293,592.44

公司				
----	--	--	--	--

注：本基金由基金托管人平安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963,310,667.00份目标ETF基金份额（上年度末：1,250,542,867.00份），占其总份额的比例为81.97%（上年度末：85.64%）。

本报告期末，本基金持有平安银行的股票17,900股（上年度末：23,100股），估值总额为人民币179,895.00元（上年度末：263,571.00元），占基金净资产的比例为0.01%（上年度末：0.02%）；本报告期末，本基金持有君正集团的股票6,200股（上年度末：8,000股），估值总额为人民币27,652.00元（上年度末：38,560.00元），占基金净资产的比例为0.00%（上年度末：0.00%）；本报告期末，本基金持有托管人的重要关联方中国平安的股票19,700股（上年度末：25,400股），估值总额为人民币940,478.00元（上年度末：1,737,360.00元），占基金净资产的比例为0.06%（上年度末：0.10%）。

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：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	30	3,000.00	3,000.14	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
688072	拓荆科技	2026-06-29	重大事项	879.53	2026-07-13	890.99	404	268,350.80	355,330.12	-

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平安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

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	-	5,763,583.89
合计	-	5,763,583.89

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	3,000.14	-
未评级	-	-
合计	3,000.14	-

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同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（净资产）无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注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	84,738,776.43	-	-	-	84,738,776.43
结算备付金	32,992.70	-	-	-	32,992.70
存出保证金	794,367.62	-	-	-	794,367.62
交易性金融资产	-	-	3,000.14	1,449,093,345.88	1,449,096,346.02
应收申购款	-	-	-	6,474,961.86	6,474,961.86
资产总计	85,566,136.75	-	3,000.14	1,455,568,307.74	1,541,137,444.63
负债					
应付赎回款	-	-	-	12,178,140.85	12,178,140.85
应付管理人报酬	-	-	-	15,507.89	15,507.89
应付托管费	-	-	-	5,169.28	5,169.28
应付销售服务费	-	-	-	130,836.86	130,836.86

其他负债	-	-	-	137,909.03	137,909.03
负债总计	-	-	-	12,467,563.91	12,467,563.91
利率敏感度缺口	85,566,136.75	-	3,000.14	1,443,100,743.83	1,528,669,880.72
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	91,658,617.74	-	-	-	91,658,617.74
结算备付金	400,134.99	-	-	-	400,134.99
存出保证金	964,273.27	-	-	-	964,273.27
交易性金融资产	5,763,583.89	-	-	1,655,947,244.97	1,661,710,828.86
应收清算款	-	-	-	2,114,197.31	2,114,197.31
应收申购款	-	-	-	9,712,830.25	9,712,830.25
资产总计	98,786,609.89	-	-	1,667,774,272.53	1,766,560,882.42
负债					
应付赎回款	-	-	-	21,063,394.27	21,063,394.27
应付管理人报酬	-	-	-	17,624.98	17,624.98
应付托管费	-	-	-	5,874.99	5,874.99
应付销售服务费	-	-	-	155,342.52	155,342.52
其他负债	-	-	-	196,696.54	196,696.54
负债总计	-	-	-	21,438,933.30	21,438,933.30
利率敏感度缺口	98,786,609.89	-	-	1,646,335,339.23	1,745,121,949.12

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：0.33%)，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	61,540,661.13	4.03	68,258,021.03	3.91
交易性金融资产—基金投资	1,387,552,684.75	90.77	1,587,689,223.94	90.98
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	1,449,093,345.88	94.79	1,655,947,244.97	94.89

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%	76,480,580.97	87,449,474.70
	业绩比较基准下降5%	-76,480,580.97	-87,449,474.70

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	1,448,738,015.76	1,655,643,017.97
第二层次	358,330.26	6,067,810.89
第三层次	-	-
合计	1,449,096,346.02	1,661,710,828.86

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	61,540,661.13	3.99
	其中：股票	61,540,661.13	3.99
2	基金投资	1,387,552,684.75	90.03
3	固定收益投资	3,000.14	0.00
	其中：债券	3,000.14	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	84,771,769.13	5.50

8	其他各项资产	7,269,329.48	0.47
9	合计	1,541,137,444.63	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	194,283.00	0.01
B	采矿业	2,508,657.00	0.16
C	制造业	43,460,481.62	2.84
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,327,890.73	0.09
E	建筑业	746,641.00	0.05
F	批发和零售业	483,291.00	0.03
G	交通运输、仓储和邮政业	1,358,517.20	0.09
H	住宿和餐饮业	27,496.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,592,333.98	0.23
J	金融业	5,939,029.00	0.39
K	房地产业	340,654.00	0.02
L	租赁和商务服务业	442,186.40	0.03
M	科学研究和技术服务业	718,958.00	0.05
N	水利、环境和公共设施管理业	105,254.20	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	20,520.00	0.00
Q	卫生和社会工作	120,035.00	0.01
R	文化、体育和娱乐业	47,373.00	0.00
S	综合	107,060.00	0.01
	合计	61,540,661.13	4.03

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	300308	中际旭创	2,100	2,667,000.00	0.17
2	300750	宁德时代	4,800	1,886,448.00	0.12
3	300502	新易盛	2,588	1,570,916.00	0.10
4	600519	贵州茅台	1,200	1,422,588.00	0.09
5	688256	寒武纪	708	1,129,649.40	0.07
6	603986	兆易创新	1,200	978,000.00	0.06
7	601318	中国平安	19,700	940,478.00	0.06
8	600036	招商银行	22,800	809,400.00	0.05
9	002371	北方华创	900	796,104.00	0.05
10	601899	紫金矿业	30,500	766,770.00	0.05
11	688008	澜起科技	2,256	699,134.40	0.05
12	688041	海光信息	1,869	692,090.70	0.05
13	000333	美的集团	8,900	672,217.00	0.04
14	002475	立讯精密	9,500	668,800.00	0.04
15	688012	中微公司	1,349	632,006.50	0.04
16	002384	东山精密	2,400	629,640.00	0.04
17	600900	长江电力	22,559	597,136.73	0.04
18	000725	京东方 A	67,400	585,032.00	0.04
19	688981	中芯国际	3,593	570,640.26	0.04
20	603259	药明康德	4,500	560,295.00	0.04
21	601166	兴业银行	31,300	518,328.00	0.03
22	600030	中信证券	18,000	517,140.00	0.03
23	300059	东方财富	23,400	476,892.00	0.03
24	600183	生益科技	2,700	468,180.00	0.03
25	688525	佰维存储	878	434,372.94	0.03
26	300274	阳光电源	2,700	429,354.00	0.03
27	600276	恒瑞医药	8,240	428,809.60	0.03
28	601398	工商银行	59,700	422,079.00	0.03
29	300408	三环集团	2,500	417,250.00	0.03
30	300476	胜宏科技	1,200	415,716.00	0.03

31	002594	比亚迪	5,100	406,470.00	0.03
32	600487	亨通光电	3,600	393,624.00	0.03
33	300394	天孚通信	1,280	387,430.40	0.03
34	002463	沪电股份	2,500	382,000.00	0.02
35	601211	国泰海通	20,800	378,560.00	0.02
36	688072	拓荆科技	404	355,330.12	0.02
37	000988	华工科技	1,900	350,759.00	0.02
38	601288	农业银行	53,100	322,317.00	0.02
39	600176	中国巨石	4,400	320,672.00	0.02
40	601328	交通银行	49,200	316,356.00	0.02
41	688347	华虹宏力	929	312,422.70	0.02
42	000651	格力电器	8,200	307,500.00	0.02
43	600522	中天科技	5,000	303,400.00	0.02
44	603019	中科曙光	2,700	289,521.00	0.02
45	603993	洛阳钼业	16,200	284,310.00	0.02
46	600150	中国船舶	8,362	282,551.98	0.02
47	301308	江波龙	400	281,520.00	0.02
48	600887	伊利股份	11,700	280,332.00	0.02
49	300604	长川科技	800	273,136.00	0.02
50	000338	潍柴动力	9,900	269,775.00	0.02
51	600584	长电科技	2,600	269,230.00	0.02
52	000858	五粮液	3,600	266,400.00	0.02
53	601816	京沪高铁	54,300	245,979.00	0.02
54	688120	华海清科	760	244,856.80	0.02
55	002008	大族激光	1,600	240,176.00	0.02
56	600309	万华化学	3,400	232,594.00	0.02
57	300124	汇川技术	3,500	232,155.00	0.02
58	002281	光迅科技	900	231,246.00	0.02
59	002415	海康威视	6,700	229,140.00	0.01
60	002916	深南电路	500	228,950.00	0.01
61	688521	芯原股份	607	225,281.98	0.01

62	000100	TCL科技	38,600	224,652.00	0.01
63	600111	北方稀土	4,600	221,030.00	0.01
64	000063	中兴通讯	6,000	217,140.00	0.01
65	300136	信维通信	1,800	214,650.00	0.01
66	600000	浦发银行	24,600	211,806.00	0.01
67	300475	香农芯创	700	210,000.00	0.01
68	600089	特变电工	9,300	209,250.00	0.01
69	601857	中国石油	23,900	207,452.00	0.01
70	300857	协创数据	600	203,940.00	0.01
71	300433	蓝思科技	3,700	198,542.00	0.01
72	601088	中国神华	5,000	195,200.00	0.01
73	002028	思源电气	1,100	190,300.00	0.01
74	600031	三一重工	11,000	190,080.00	0.01
75	300014	亿纬锂能	2,900	188,587.00	0.01
76	300757	罗博特科	300	185,700.00	0.01
77	002353	杰瑞股份	1,200	183,000.00	0.01
78	000001	平安银行	17,900	179,895.00	0.01
79	002050	三花智控	4,100	179,703.00	0.01
80	601601	中国太保	6,300	179,676.00	0.01
81	002714	牧原股份	5,100	178,449.00	0.01
82	000792	盐湖股份	5,800	175,102.00	0.01
83	300223	北京君正	700	174,230.00	0.01
84	600549	厦门钨业	2,000	170,400.00	0.01
85	600406	XD国电南	7,400	169,090.00	0.01
86	002156	通富微电	2,200	166,914.00	0.01
87	601668	中国建筑	38,200	165,788.00	0.01
88	002436	兴森科技	3,200	163,040.00	0.01
89	000657	中钨高新	1,700	162,724.00	0.01
90	002602	世纪华通	10,900	153,690.00	0.01
91	601919	中远海控	11,570	153,418.20	0.01
92	002080	中材科技	1,700	153,000.00	0.01

93	601988	中国银行	26,400	151,008.00	0.01
94	300760	迈瑞医疗	1,100	149,413.00	0.01
95	601728	中国电信	28,700	148,953.00	0.01
96	300054	鼎龙股份	1,400	148,358.00	0.01
97	002230	科大讯飞	3,600	147,024.00	0.01
98	601012	隆基绿能	11,200	146,944.00	0.01
99	600941	中国移动	1,700	146,421.00	0.01
100	600660	福耀玻璃	2,900	146,276.00	0.01
101	300033	同花顺	600	144,600.00	0.01
102	601225	陕西煤业	7,100	144,485.00	0.01
103	603501	豪威集团	1,500	142,275.00	0.01
104	600690	海尔智家	6,900	140,829.00	0.01
105	000977	浪潮信息	2,000	140,000.00	0.01
106	002352	顺丰控股	4,400	137,544.00	0.01
107	601985	中国核电	15,200	137,256.00	0.01
108	002938	鹏鼎控股	1,300	136,994.00	0.01
109	603799	华友钴业	2,800	135,128.00	0.01
110	002851	麦格米特	800	133,744.00	0.01
111	002709	天赐材料	2,600	133,718.00	0.01
112	688777	中控技术	1,136	133,480.00	0.01
113	600160	巨化股份	2,500	132,525.00	0.01
114	002460	赣锋锂业	2,000	130,800.00	0.01
115	300567	精测电子	400	127,040.00	0.01
116	688126	沪硅产业	3,173	126,570.97	0.01
117	300442	润泽科技	1,500	124,605.00	0.01
118	002202	金风科技	5,200	124,280.00	0.01
119	688002	睿创微纳	799	123,597.31	0.01
120	000425	徐工机械	15,200	122,968.00	0.01
121	000938	紫光股份	4,200	121,212.00	0.01
122	600028	中国石化	27,000	120,420.00	0.01
123	601600	中国铝业	14,600	120,012.00	0.01

124	600938	中国海油	4,400	119,460.00	0.01
125	601766	中国中车	22,500	117,000.00	0.01
126	002466	天齐锂业	1,900	116,508.00	0.01
127	002600	领益智造	6,700	116,178.00	0.01
128	600050	中国联通	28,900	115,600.00	0.01
129	002407	多氟多	2,300	115,529.00	0.01
130	002049	紫光国微	1,300	115,375.00	0.01
131	600460	士兰微	2,100	114,786.00	0.01
132	300661	圣邦股份	800	114,784.00	0.01
133	688396	华润微	1,176	114,718.80	0.01
134	300751	迈为股份	400	112,984.00	0.01
135	002837	英维克	1,410	112,179.60	0.01
136	002185	华天科技	5,000	111,550.00	0.01
137	300346	南大光电	1,200	111,180.00	0.01
138	002138	顺络电子	1,500	109,650.00	0.01
139	000568	泸州老窖	1,400	108,528.00	0.01
140	300395	菲利华	800	106,984.00	0.01
141	002179	中航光电	2,300	106,260.00	0.01
142	601628	中国人寿	3,000	106,050.00	0.01
143	600879	航天电子	4,900	104,321.00	0.01
144	000408	藏格矿业	1,500	103,980.00	0.01
145	601872	招商轮船	5,900	103,663.00	0.01
146	002241	歌尔股份	4,600	103,638.00	0.01
147	601006	大秦铁路	22,100	101,881.00	0.01
148	688235	百济神州	400	101,844.00	0.01
149	601658	邮储银行	20,400	100,572.00	0.01
150	603288	海天味业	3,000	99,480.00	0.01
151	688469	芯联集成	9,331	99,001.91	0.01
152	600905	三峡能源	26,400	97,944.00	0.01
153	605117	德业股份	916	97,260.88	0.01
154	002625	光启技术	3,200	97,024.00	0.01

155	601100	恒立液压	900	96,804.00	0.01
156	601888	中国中免	1,800	96,678.00	0.01
157	600489	中金黄金	5,300	95,665.00	0.01
158	000630	铜陵有色	14,900	94,764.00	0.01
159	688271	联影医疗	928	93,941.44	0.01
160	300390	天华新能	1,000	93,510.00	0.01
161	688111	金山办公	438	93,315.90	0.01
162	600010	包钢股份	41,800	93,214.00	0.01
163	002273	水晶光电	2,600	92,248.00	0.01
164	600893	航发动力	2,400	92,016.00	0.01
165	601127	赛力斯	1,500	91,875.00	0.01
166	300058	蓝色光标	6,640	91,366.40	0.01
167	600673	东阳光	2,700	90,666.00	0.01
168	002027	分众传媒	18,700	90,508.00	0.01
169	601689	拓普集团	1,600	90,272.00	0.01
170	000426	兴业银锡	2,700	88,992.00	0.01
171	600019	宝钢股份	16,100	87,423.00	0.01
172	600362	江西铜业	2,000	86,600.00	0.01
173	300450	先导智能	2,100	85,512.00	0.01
174	000807	云铝股份	3,800	84,132.00	0.01
175	300037	新宙邦	900	83,565.00	0.01
176	688017	绿的谐波	199	83,154.14	0.01
177	600104	上汽集团	8,500	82,960.00	0.01
178	605589	圣泉集团	1,300	82,641.00	0.01
179	002001	新 和 成	2,900	82,418.00	0.01
180	688099	晶晨股份	800	82,320.00	0.01
181	600760	中航沈飞	2,000	82,200.00	0.01
182	600118	中国卫星	1,000	82,050.00	0.01
183	600667	XD太极实	2,800	81,704.00	0.01
184	601168	西部矿业	3,000	81,420.00	0.01
185	600989	宝丰能源	4,000	81,320.00	0.01

186	601727	上海电气	11,600	81,200.00	0.01
187	000960	锡业股份	1,900	81,111.00	0.01
188	600875	东方电气	2,800	80,556.00	0.01
189	002126	银轮股份	1,600	79,680.00	0.01
190	600988	赤峰黄金	3,000	78,960.00	0.01
191	601390	中国中铁	18,900	78,813.00	0.01
192	300316	晶盛机电	1,300	78,520.00	0.01
193	000831	中国稀土	1,400	77,686.00	0.01
194	002422	科伦药业	2,000	77,040.00	0.01
195	300782	卓胜微	700	76,706.00	0.01
196	002738	中矿资源	1,300	76,687.00	0.01
197	600795	国电电力	16,400	76,588.00	0.01
198	600547	山东黄金	3,300	76,197.00	0.00
199	600885	宏发股份	2,200	75,878.00	0.00
200	301358	湖南裕能	1,000	75,870.00	0.00
201	000538	云南白药	1,600	75,792.00	0.00
202	002648	卫星化学	3,200	75,168.00	0.00
203	600141	兴发集团	1,600	75,152.00	0.00
204	600418	江淮汽车	2,900	74,907.00	0.00
205	601669	中国电建	15,900	74,730.00	0.00
206	600585	海螺水泥	4,400	74,580.00	0.00
207	600392	盛和资源	2,500	74,425.00	0.00
208	002129	TCL中环	6,000	72,120.00	0.00
209	300015	爱尔眼科	8,600	71,036.00	0.00
210	601179	中国西电	4,700	70,124.00	0.00
211	600096	云天化	2,300	69,920.00	0.00
212	605499	东鹏饮料	560	69,120.80	0.00
213	600346	恒力石化	3,900	69,069.00	0.00
214	601868	中国能建	25,800	68,886.00	0.00
215	600482	中国动力	2,100	68,880.00	0.00
216	300418	昆仑万维	1,700	68,612.00	0.00

217	002195	岩山科技	10,400	68,016.00	0.00
218	600497	驰宏锌锗	5,600	67,816.00	0.00
219	002812	恩捷股份	1,000	66,910.00	0.00
220	000066	中国长城	3,500	66,675.00	0.00
221	600580	卧龙电驱	2,000	66,200.00	0.00
222	002558	巨人网络	2,400	66,144.00	0.00
223	000625	长安汽车	9,200	65,964.00	0.00
224	688578	艾力斯	603	65,847.60	0.00
225	600436	片仔癀	600	65,568.00	0.00
226	600157	永泰能源	40,300	64,883.00	0.00
227	002821	凯莱英	400	64,800.00	0.00
228	600426	华鲁恒升	2,700	64,584.00	0.00
229	002532	天山铝业	6,000	64,380.00	0.00
230	600066	宇通客车	2,400	64,344.00	0.00
231	688213	思特威	600	64,242.00	0.00
232	300803	指南针	700	64,169.00	0.00
233	600221	海航控股	47,500	64,125.00	0.00
234	000157	中联重科	9,200	64,124.00	0.00
235	000933	神火股份	3,000	63,600.00	0.00
236	600895	张江高科	1,700	63,325.00	0.00
237	688036	传音控股	1,070	63,076.50	0.00
238	002340	格林美	9,500	62,795.00	0.00
239	600711	盛屯矿业	5,700	62,529.00	0.00
240	688047	龙芯中科	402	62,177.34	0.00
241	600048	XD保利发	13,300	61,579.00	0.00
242	600011	华能国际	8,100	61,479.00	0.00
243	002236	大华股份	3,700	61,013.00	0.00
244	600438	通威股份	5,000	60,550.00	0.00
245	600143	金发科技	3,900	60,255.00	0.00
246	002493	荣盛石化	5,600	60,200.00	0.00
247	688188	柏楚电子	561	59,858.70	0.00

248	300017	网宿科技	4,600	59,846.00	0.00
249	600115	中国东航	15,700	59,817.00	0.00
250	002131	利欧股份	12,500	59,375.00	0.00
251	002456	欧菲光	6,200	58,652.00	0.00
252	600886	国投电力	4,400	58,564.00	0.00
253	600352	浙江龙盛	4,800	58,128.00	0.00
254	603659	璞泰来	2,000	57,860.00	0.00
255	002074	国轩高科	2,100	57,771.00	0.00
256	600570	恒生电子	2,700	57,213.00	0.00
257	003816	中国广核	14,500	56,695.00	0.00
258	601233	桐昆股份	2,600	56,290.00	0.00
259	000301	东方盛虹	4,900	56,105.00	0.00
260	601360	三六零	6,400	55,616.00	0.00
261	601058	赛轮轮胎	4,800	55,344.00	0.00
262	300759	康龙化成	1,900	54,967.00	0.00
263	300339	润和软件	1,400	53,914.00	0.00
264	600026	中远海能	3,000	53,820.00	0.00
265	300207	欣旺达	2,800	53,172.00	0.00
266	600009	上海机场	2,300	53,130.00	0.00
267	002555	三七互娱	2,800	52,836.00	0.00
268	000975	山金国际	3,100	52,700.00	0.00
269	688331	荣昌生物	402	52,364.52	0.00
270	601111	中国国航	8,600	52,030.00	0.00
271	600029	南方航空	10,000	51,800.00	0.00
272	600196	复星医药	2,300	51,681.00	0.00
273	000768	中航西飞	2,500	51,200.00	0.00
274	002601	龙佰集团	3,100	51,088.00	0.00
275	600674	川投能源	3,600	51,012.00	0.00
276	301236	软通动力	1,200	50,940.00	0.00
277	600415	小商品城	5,000	50,800.00	0.00
278	600219	南山铝业	12,700	50,673.00	0.00

279	601186	中国铁建	8,500	50,575.00	0.00
280	002517	恺英网络	3,100	50,375.00	0.00
281	300115	长盈精密	1,800	50,292.00	0.00
282	002155	湖南黄金	2,100	50,127.00	0.00
283	002472	双环传动	1,200	49,812.00	0.00
284	300438	鹏辉能源	600	49,710.00	0.00
285	002432	九安医疗	700	49,476.00	0.00
286	601117	中国化学	6,700	49,245.00	0.00
287	300001	特锐德	1,300	49,179.00	0.00
288	603650	彤程新材	500	48,990.00	0.00
289	600233	圆通速递	3,100	48,825.00	0.00
290	002128	电投能源	2,100	48,552.00	0.00
291	300454	深信服	500	48,100.00	0.00
292	000963	华东医药	1,700	47,804.00	0.00
293	600372	中航机载	4,400	47,740.00	0.00
294	601877	正泰电器	1,900	47,633.00	0.00
295	600839	四川长虹	6,800	47,464.00	0.00
296	300458	全志科技	1,200	47,352.00	0.00
297	002465	海格通信	3,700	47,249.00	0.00
298	688266	泽璟制药	404	47,130.64	0.00
299	000547	航天发展	2,400	45,960.00	0.00
300	002595	豪迈科技	980	45,668.00	0.00
301	002130	沃尔核材	2,400	45,504.00	0.00
302	000733	振华科技	800	45,312.00	0.00
303	300763	锦浪科技	500	45,175.00	0.00
304	600741	华域汽车	2,900	45,008.00	0.00
305	300568	星源材质	2,400	44,928.00	0.00
306	300024	机器人	2,300	44,459.00	0.00
307	688390	固德威	400	43,404.00	0.00
308	300347	泰格医药	900	43,200.00	0.00
309	300012	华测检测	3,100	42,966.00	0.00

310	688676	金盘科技	507	42,912.48	0.00
311	000878	云南铜业	2,700	42,876.00	0.00
312	002497	雅化集团	2,100	42,777.00	0.00
313	001979	招商蛇口	6,600	42,438.00	0.00
314	002414	高德红外	3,200	42,432.00	0.00
315	300724	捷佳伟创	600	42,360.00	0.00
316	300474	景嘉微	700	42,336.00	0.00
317	300083	创世纪	3,100	42,222.00	0.00
318	688122	西部超导	670	42,082.70	0.00
319	002271	东方雨虹	3,500	41,545.00	0.00
320	000034	神州数码	1,480	41,070.00	0.00
321	601021	春秋航空	900	41,022.00	0.00
322	002920	德赛西威	500	40,750.00	0.00
323	002444	巨星科技	1,300	40,430.00	0.00
324	300748	金力永磁	1,300	40,105.00	0.00
325	002078	太阳纸业	3,200	39,968.00	0.00
326	000661	长春高新	600	39,960.00	0.00
327	601319	中国人保	5,900	39,884.00	0.00
328	600699	均胜电子	1,800	38,898.00	0.00
329	300073	当升科技	800	38,432.00	0.00
330	688065	凯赛生物	800	38,280.00	0.00
331	601615	明阳智能	3,300	38,181.00	0.00
332	601677	明泰铝业	2,300	38,180.00	0.00
333	002025	航天电器	500	38,110.00	0.00
334	688169	石头科技	400	37,988.00	0.00
335	300142	沃森生物	2,900	37,671.00	0.00
336	600039	四川路桥	4,800	37,536.00	0.00
337	603606	东方电缆	900	37,359.00	0.00
338	000002	万科A	12,600	37,296.00	0.00
339	601800	中国交建	6,500	37,115.00	0.00
340	300496	中科创达	600	37,074.00	0.00

341	002252	上海莱士	8,500	36,890.00	0.00
342	301550	斯菱智驱	400	36,572.00	0.00
343	600226	亨通股份	3,800	36,442.00	0.00
344	000423	东阿阿胶	800	36,288.00	0.00
345	300432	富临精工	1,800	36,162.00	0.00
346	688223	晶科能源	7,608	36,138.00	0.00
347	688599	天合光能	2,528	35,695.36	0.00
348	002831	裕同科技	1,000	35,560.00	0.00
349	603979	金诚信	600	35,418.00	0.00
350	002064	华峰化学	3,700	35,113.00	0.00
351	002294	信立泰	1,100	35,079.00	0.00
352	300919	中伟新材	800	35,000.00	0.00
353	302132	中航成飞	600	34,992.00	0.00
354	601633	长城汽车	2,300	34,707.00	0.00
355	603087	甘李药业	600	34,056.00	0.00
356	002756	永兴材料	600	33,984.00	0.00
357	600588	用友网络	3,700	33,966.00	0.00
358	001965	招商公路	3,700	33,892.00	0.00
359	603260	合盛硅业	700	33,782.00	0.00
360	000519	中兵红箭	1,600	33,712.00	0.00
361	688180	君实生物	993	33,583.26	0.00
362	688608	恒玄科技	200	33,438.00	0.00
363	300342	天银机电	700	32,900.00	0.00
364	000786	北新建材	1,800	32,562.00	0.00
365	300558	贝达药业	500	32,535.00	0.00
366	600177	雅戈尔	4,300	32,379.00	0.00
367	601618	中国中冶	13,200	32,208.00	0.00
368	600516	方大炭素	5,200	32,084.00	0.00
369	603806	福斯特	1,900	31,901.00	0.00
370	300699	光威复材	1,100	31,515.00	0.00
371	300866	安克创新	300	31,350.00	0.00

372	300677	英科医疗	800	31,336.00	0.00
373	002176	江特电机	3,100	31,031.00	0.00
374	601607	上海医药	2,000	30,800.00	0.00
375	002223	鱼跃医疗	1,200	30,792.00	0.00
376	688114	华大智造	600	30,648.00	0.00
377	688472	阿特斯	2,818	30,490.76	0.00
378	000400	许继电气	1,400	30,380.00	0.00
379	000617	中油资本	4,600	30,314.00	0.00
380	000623	吉林敖东	1,700	30,141.00	0.00
381	002459	晶澳科技	3,700	29,970.00	0.00
382	603605	珀莱雅	500	29,960.00	0.00
383	300251	光线传媒	2,700	29,943.00	0.00
383	002085	万丰奥威	2,700	29,943.00	0.00
384	300832	新产业	700	29,400.00	0.00
385	002266	浙富控股	5,790	29,297.40	0.00
386	002065	东华软件	4,100	29,274.00	0.00
387	600499	科达制造	2,100	28,980.00	0.00
388	600515	海南机场	10,500	28,770.00	0.00
389	002318	久立特材	1,200	28,680.00	0.00
390	002044	美年健康	5,700	28,671.00	0.00
391	603596	伯特利	1,140	28,317.60	0.00
392	688116	XD天奈科	738	28,191.60	0.00
393	000415	渤海租赁	6,900	28,083.00	0.00
394	300409	道氏技术	1,400	27,902.00	0.00
395	002405	四维图新	4,300	27,821.00	0.00
396	600085	同仁堂	1,200	27,732.00	0.00
397	601216	君正集团	6,200	27,652.00	0.00
398	000683	博源化工	4,800	27,648.00	0.00
399	000039	中集集团	3,400	27,574.00	0.00
400	000032	深桑达 A	1,100	27,445.00	0.00
401	600521	华海药业	1,900	27,360.00	0.00

402	300003	乐普医疗	2,300	27,255.00	0.00
403	600862	中航高科	1,500	27,045.00	0.00
404	600704	物产中大	5,700	26,904.00	0.00
405	600803	新奥股份	1,700	26,860.00	0.00
406	000887	中鼎股份	1,500	26,835.00	0.00
407	000999	华润三九	1,190	26,763.10	0.00
408	600312	平高电气	1,500	26,490.00	0.00
409	600018	上港集团	5,600	26,432.00	0.00
410	000830	鲁西化工	2,200	26,400.00	0.00
411	603766	隆鑫通用	2,200	26,246.00	0.00
412	605090	九丰能源	700	26,019.00	0.00
413	600765	中航重机	2,000	25,840.00	0.00
414	300122	智飞生物	2,200	25,718.00	0.00
415	600166	福田汽车	8,800	25,608.00	0.00
416	603129	春风动力	100	25,580.00	0.00
417	600153	建发股份	3,200	25,376.00	0.00
418	000967	盈峰环境	2,400	25,272.00	0.00
419	600323	瀚蓝环境	900	24,714.00	0.00
420	002410	广联达	3,000	24,480.00	0.00
421	002007	华兰生物	2,000	24,380.00	0.00
422	600332	白云山	1,200	24,048.00	0.00
423	603568	伟明环保	1,560	23,992.80	0.00
424	000738	航发控制	1,300	23,777.00	0.00
425	688009	中国通号	4,850	23,086.00	0.00
426	600398	海澜之家	4,400	23,012.00	0.00
427	002603	以岭药业	1,500	22,500.00	0.00
428	688005	容百科技	734	22,460.40	0.00
429	601000	唐山港	5,400	22,410.00	0.00
430	601018	宁波港	7,100	22,365.00	0.00
431	600529	山东药玻	1,200	22,140.00	0.00
432	600208	衢州发展	7,800	22,074.00	0.00

433	600008	首创环保	8,100	22,032.00	0.00
434	000932	华菱钢铁	6,300	21,861.00	0.00
435	600170	上海建工	9,800	21,756.00	0.00
436	600998	九州通	4,600	21,574.00	0.00
437	002389	航天彩虹	1,200	21,324.00	0.00
438	600161	天坛生物	1,800	20,844.00	0.00
439	600820	隧道股份	4,000	20,840.00	0.00
440	603885	吉祥航空	2,000	20,580.00	0.00
441	002607	中公教育	11,400	20,520.00	0.00
442	600763	通策医疗	600	20,328.00	0.00
443	601238	广汽集团	4,000	20,320.00	0.00
444	603486	科沃斯	400	20,300.00	0.00
445	600486	扬农化工	400	20,280.00	0.00
446	600038	中直股份	800	20,232.00	0.00
447	688303	大全能源	1,156	20,149.08	0.00
448	603816	顾家家居	900	20,124.00	0.00
449	300573	兴齐眼药	490	19,972.40	0.00
450	300118	东方日升	1,600	19,920.00	0.00
451	603939	益丰药房	1,100	19,778.00	0.00
452	600316	洪都航空	700	19,558.00	0.00
453	601567	三星电气	1,300	19,422.00	0.00
454	601880	辽港股份	13,700	18,906.00	0.00
455	603392	万泰生物	700	18,879.00	0.00
456	600535	天士力	1,400	18,522.00	0.00
457	601799	星宇股份	200	18,124.00	0.00
458	600816	建元信托	7,200	17,568.00	0.00
459	300676	华大基因	500	17,530.00	0.00
460	002244	滨江集团	2,300	17,480.00	0.00
461	601155	新城控股	1,700	17,442.00	0.00
462	300896	爱美客	200	17,440.00	0.00
463	300144	宋城演艺	3,000	17,430.00	0.00

464	300972	万辰集团	100	17,341.00	0.00
465	002120	韵达股份	2,700	17,172.00	0.00
466	300457	赢合科技	800	16,864.00	0.00
467	300100	双林股份	600	16,668.00	0.00
468	000833	粤桂股份	700	16,394.00	0.00
469	601866	中远海发	7,200	15,912.00	0.00
470	000998	隆平高科	2,100	15,834.00	0.00
471	600064	南京高科	2,200	15,686.00	0.00
472	600511	国药股份	600	15,624.00	0.00
473	300049	福瑞医科	400	15,552.00	0.00
474	600635	大众公用	3,500	14,980.00	0.00
475	600655	豫园股份	3,600	14,796.00	0.00
476	002544	普天科技	800	14,576.00	0.00
477	000035	中国天楹	3,000	14,490.00	0.00
478	603899	晨光股份	700	14,441.00	0.00
479	600754	锦江酒店	800	14,392.00	0.00
480	688166	博瑞医药	403	14,109.03	0.00
481	600004	白云机场	1,900	13,794.00	0.00
482	600859	王府井	1,500	13,770.00	0.00
483	300601	康泰生物	1,200	13,608.00	0.00
484	600663	陆家嘴	2,100	13,188.00	0.00
485	600258	首旅酒店	1,200	13,104.00	0.00
486	002091	江苏国泰	1,800	13,014.00	0.00
487	300070	碧水源	4,000	12,760.00	0.00
488	000069	华侨城 A	7,400	12,136.00	0.00
489	603833	欧派家居	400	12,044.00	0.00
490	600864	哈投股份	2,300	11,937.00	0.00
491	301078	孩子王	1,600	10,816.00	0.00
492	002891	中宠股份	400	10,688.00	0.00
493	688063	派能科技	200	10,654.00	0.00
494	002292	奥飞娱乐	1,600	10,496.00	0.00

495	600325	华发股份	4,000	9,240.00	0.00
496	002572	索菲亚	1,000	7,300.00	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	300750	宁德时代	5,367,721.00	0.31
2	600519	贵州茅台	4,884,375.00	0.28
3	300308	中际旭创	3,712,589.71	0.21
4	601318	中国平安	3,137,083.00	0.18
5	601899	紫金矿业	2,782,136.00	0.16
6	300502	新易盛	2,346,861.00	0.13
7	600036	招商银行	2,335,096.00	0.13
8	000333	美的集团	1,958,712.00	0.11
9	688256	寒武纪	1,762,720.32	0.10
10	600900	长江电力	1,585,199.00	0.09
11	601166	兴业银行	1,552,419.00	0.09
12	002475	立讯精密	1,441,580.16	0.08
13	688041	海光信息	1,411,219.38	0.08
14	002594	比亚迪	1,351,101.36	0.08
15	300059	东方财富	1,342,197.00	0.08
16	688981	中芯国际	1,336,375.79	0.08
17	002371	北方华创	1,328,304.00	0.08
18	603986	兆易创新	1,263,507.00	0.07
19	600030	中信证券	1,262,172.00	0.07
20	600276	恒瑞医药	1,200,528.00	0.07

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	300750	宁德时代	22,000,374.44	1.26
2	300308	中际旭创	13,050,726.40	0.75
3	300502	新易盛	8,596,438.00	0.49
4	000333	美的集团	8,089,564.00	0.46
5	002371	北方华创	7,389,074.00	0.42
6	002475	立讯精密	6,368,548.10	0.36
7	002594	比亚迪	5,602,732.00	0.32
8	300059	东方财富	5,560,775.00	0.32
9	600519	贵州茅台	5,324,479.00	0.31
10	300274	阳光电源	4,493,313.00	0.26
11	300476	胜宏科技	4,342,964.00	0.25
12	000858	五粮液	4,252,919.00	0.24
13	300394	天孚通信	4,098,829.60	0.23
14	002384	东山精密	3,979,056.00	0.23
15	601318	中国平安	3,718,021.00	0.21
16	000651	格力电器	3,523,955.50	0.20
17	000725	京东方 A	3,501,277.00	0.20
18	601899	紫金矿业	3,404,828.00	0.20
19	300124	汇川技术	3,148,369.00	0.18
20	000338	潍柴动力	2,917,759.00	0.17

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	152,507,237.32
卖出股票收入（成交）总额	387,080,725.51

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)	3,000.14	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,000.14	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	30	3,000.14	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A500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	1,387,552,684.75	90.77

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 本基金投资的前十名证券发行主体中，【招商银行股份有限公司】于2025年09月12日收到国家金融监督管理总局出具公开处罚、公开批评的通报。本基金为指数型基金，上述主体所发行的证券系标的指数成份股，对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

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	794,367.62
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-

5	应收申购款	6,474,961.86
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,269,329.48

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A 500ET F联接 A	29, 063	16,897.67	124,492,568.98	25.3 5%	366,604,454.38	74.65%
天弘 中证A 500ET F联接	21, 004	28,370.58	22,593,412.12	3.79%	573,302,321.45	96.21%

C						
天弘 中证A 500ETF 联接 Y	3,960	6,091.30	-	-	24,121,529.32	100.00%
合计	53,291	20,849.94	147,085,981.10	13.24%	964,028,305.15	86.76%

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A500ETF联接A	331,350.43	0.07%
	天弘中证A500ETF联接C	101,950.58	0.02%
	天弘中证A500ETF联接Y	552,066.75	2.29%
	合计	985,367.76	0.09%

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A500ETF联接A	10~50
	天弘中证A500ETF联接C	0
	天弘中证A500ETF联接Y	0~10
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基	天弘中证A500ETF	0

金	联接A	
	天弘中证A500ETF 联接C	0
	天弘中证A500ETF 联接Y	0
	合计	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	天弘中证A500ETF 联接A	天弘中证A500ETF 联接C	天弘中证A500ETF 联接Y
基金合同生效日(2024年11月07日)基金份额总额	1,242,234,437.20	2,653,556,172.14	-
本报告期期初基金份额总额	697,535,370.09	716,971,753.14	12,772,617.02
本报告期基金总申购份额	346,967,259.67	473,202,784.39	18,043,667.16
减：本报告期基金总赎回份额	553,405,606.40	594,278,803.96	6,694,754.86
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	491,097,023.36	595,895,733.57	24,121,529.32

§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》。

2026年6月23日，根据托管人工作安排，聘任宋卓先生为平安银行股份有限公司资产托管部总经理。

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，无涉及本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，本基金托管人的托管业务部门无受到调查或处罚等情况。

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，本基金托管人的托管业务部门相关从业人员无受到调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长城证券	1	12,017,935.00	2.23%	2,498.63	2.23%	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
东方证券	1	7,770,630.00	1.44%	1,615.38	1.44%	-
东海证券	1	-	-	-	-	-
国新证券	1	-	-	-	-	-
国信证券	1	89,513,881.76	16.59%	18,610.76	16.59%	-
华泰证券	1	176,057,973.00	32.63%	36,602.36	32.63%	-
华西证券	2	-	-	-	-	-
民生证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-

西南 证券	3	52,394,853.18	9.71%	10,890.94	9.71%	-
招商 证券	1	-	-	-	-	-
中国 银河 证券	2	180,237,924.67	33.40%	37,470.22	33.40%	-
中金 公司	1	-	-	-	-	-
中信 建投 证券	1	-	-	-	-	-
中信 证券	3	21,588,929.62	4.00%	4,488.45	4.00%	-

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

2、交易单元的选择程序：本基金管理人根据上述标准进行考察后，确定选用交易单元的证券公司，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：西南证券北交所交易单元1个，西南证券深圳交易单元1个。

4、本基金报告期内停止租用交易单元：长城证券深圳交易单元1个，中信建投证券深圳交易单元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
长城证券	-	-	-	-	-	-	3,278,716.40	5.83%
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-

东海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国新证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国信证券	-	-	-	-	-	-	35,860,286.20	63.76%
华泰证券	-	-	-	-	-	-	17,102,450.70	30.41%
华西证券	-	-	-	-	-	-	-	-
民生证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西南证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中国银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
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A500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A500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A500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	2026-04-09
5	天弘中证A500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	中国证监会规定媒介	2026-04-09

	要（更新）		
6	天弘中证A500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	2026-04-09
7	天弘中证A500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
8	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
9	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
10	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
11	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
12	天弘中证A500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
13	天弘中证A500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
14	天弘中证A500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