

# 天弘中证红利低波动 100 指数型发起式证券投资基金

## 2023 年中期报告

2023 年 06 月 30 日

基金管理人:天弘基金管理有限公司

基金托管人:国泰君安证券股份有限公司

送出日期:2023 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，并由董事长签发。

基金托管人国泰君安证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2023年08月29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2023年01月01日起至2023年06月30日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	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（基金净值）变动表	18
6.4 报表附注	21
§7 投资组合报告	57
7.1 期末基金资产组合情况	57
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	58
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	60
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	70
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	71
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	71
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	71
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	71
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	71
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	71
7.12 投资组合报告附注	71
§8 基金份额持有人信息	73
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	73
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	73

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	74
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	74
§9 开放式基金份额变动.....	74
§10 重大事件揭示.....	75
10.1 基金份额持有人大会决议.....	75
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	75
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	75
10.4 基金投资策略的改变.....	75
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	75
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	75
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	76
10.8 其他重大事件.....	78
§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.....	79
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	79
§12 备查文件目录.....	79
12.1 备查文件目录.....	79
12.2 存放地点.....	80
12.3 查阅方式.....	80

## §2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	天弘中证红利低波动100指数型发起式证券投资基金	
基金简称	天弘中证红利低波动100	
基金主代码	008114	
基金运作方式	契约型开放式、发起式	
基金合同生效日	2019年12月10日	
基金管理人	天弘基金管理有限公司	
基金托管人	国泰君安证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	880,728,665.41份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	天弘中证红利低波动100A	天弘中证红利低波动100C
下属分级基金的交易代码	008114	008115
报告期末下属分级基金的份额总额	232,524,476.31份	648,204,189.10份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。
投资策略	本基金采用完全复制标的指数的方法，进行被动指数化投资。股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合复制标的指数，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，以复制和跟踪标的指数。本基金产品投资策略仍包括大类资产配置、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、参与融资及转融通证券出借业务策略、其他金融工具投资策略等策略。
业绩比较基准	中证红利低波动100指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金为指

	数型基金, 主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现, 具有与标的指数相似的风险收益特征。
--	---

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		天弘基金管理有限公司	国泰君安证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	童建林	帅芳
	联系电话	022-83310208	021-38031815
	电子邮箱	service@thfund.com.cn	shuaifang@gtjas.com
客户服务电话		95046	021-38917599-5
传真		022-83865564	021-38677819
注册地址		天津自贸试验区(中心商务区)新华路3678号宝风大厦23层	中国(上海)自由贸易试验区商城路618号
办公地址		天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层	上海市静安区新闸路669号博华广场19楼
邮政编码		300203	200041
法定代表人		韩歆毅	贺青

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.thfund.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公地址

### 2.5 其他相关资料

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

### §3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2023年01月01日-2023年06月30日)	
	天弘中证红利低波动100A	天弘中证红利低波动100C
本期已实现收益	18,201,614.71	38,656,894.52
本期利润	29,951,816.53	16,550,787.14
加权平均基金份额本期利润	0.1346	0.0449
本期加权平均净值利润率	9.37%	3.11%
本期基金份额净值增长率	12.11%	12.00%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2023年06月30日)	
期末可供分配利润	77,363,316.28	209,322,044.36
期末可供分配基金份额利润	0.3327	0.3229
期末基金资产净值	339,743,350.99	940,240,153.79
期末基金份额净值	1.4611	1.4505
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2023年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	46.11%	45.05%

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

## 天弘中证红利低波动100A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	-0.97%	0.74%	-2.38%	0.76%	1.41%	-0.02%
过去三个月	3.20%	0.86%	1.24%	0.87%	1.96%	-0.01%
过去六个月	12.11%	0.75%	9.78%	0.77%	2.33%	-0.02%
过去一年	11.82%	0.79%	5.65%	0.80%	6.17%	-0.01%
过去三年	56.03%	0.94%	28.72%	0.95%	27.31%	-0.01%
自基金合同 生效日起至 今	46.11%	0.96%	21.55%	0.98%	24.56%	-0.02%

## 天弘中证红利低波动100C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	-0.99%	0.74%	-2.38%	0.76%	1.39%	-0.02%
过去三个月	3.15%	0.86%	1.24%	0.87%	1.91%	-0.01%
过去六个月	12.00%	0.75%	9.78%	0.77%	2.22%	-0.02%
过去一年	11.60%	0.79%	5.65%	0.80%	5.95%	-0.01%
过去三年	55.10%	0.94%	28.72%	0.95%	26.38%	-0.01%
自基金合同 生效日起至 今	45.05%	0.96%	21.55%	0.98%	23.50%	-0.02%

### 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



天弘中证红利低波动100A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2019年12月10日-2023年06月30日)



天弘中证红利低波动100C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图  
(2019年12月10日-2023年06月30日)



注：1、本基金合同于2019年12月10日生效。  
2、本报告期内，本基金的各项投资比例达到基金合同约定的各项比例要求。

## §4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

截至2023年6月30日，公司共管理运作180只公募基金，公司业务范围涵盖二级市场股票投资、债券投资、现金管理、衍生品投资等。公司始终秉承“稳健理财，值得信赖”的理念，坚持为投资者带来优质的基金产品和理财服务。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金 经理（助理） 期限		证券 从业 年限	说明
		任职 日期	离任 日期		
刘笑明	本基金基金经理	2021 年06 月	-	9年	男，运筹学硕士。历任建信基金管理有限责任公司量化研究员、北京极至投资管理有限公司投资经理、中国人保资产管理有限公司基金经理，2020年4月加盟本公司。
祁世超	本基金基金经理助理	2022 年02 月	-	8年	男，金融硕士，历任嘉实财富科技（北京）有限公司、嘉实财富管理有限公司产品经理、开发工程师。2015年9

					月加盟本公司，历任智能投资部研究员、指数与数量投资部高级研究员。
--	--	--	--	--	----------------------------------

注：1、上述任职日期/离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2、本基金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及基金合同的相关约定进行操作，不存在违法违规及未履行基金合同承诺的情况。

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

本报告期内，本基金运作合法合规，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况，公司旗下各基金不存在因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3次，投资组合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易，未导致不公平交易和利益输送。

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2023年上半年，市场整体呈现先扬后抑的震荡走势，同时在存量博弈下体现出快速轮动和结构分化的特征。具体来说：中证全指上涨2.17%，沪深300下跌0.75%，中证500上涨2.29%，创业板指下跌5.61%，中证1000上涨5.10%。本基金投资策略所跟踪的中证红利低波动100指数上涨10.29%。报告期内，基金管理人根据基金合同约定，以坚持被动指数化投资为原则进行基金的投资运作，并通过部门自研的指数基金投资管理系统对基金的投资流程进行持续监控及优化，将基金的跟踪误差及跟踪偏离度控制在了合理水平。

投资策略方面，本基金作为一只跟踪中证红利低波动100指数的被动指数产品，基金管理人将运用指数化投资策略，紧密跟踪基准，在严格控制基金的日均跟踪偏离度和年化跟踪误差的前提下，力争获取与业绩基准相似的投资收益。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2023年06月30日，天弘中证红利低波动100A基金份额净值为1.4611元，天弘中证红利低波动100C基金份额净值为1.4505元。报告期内份额净值增长率天弘中证红利低波动100A为12.11%，同期业绩比较基准增长率为9.78%；天弘中证红利低波动100C为12.00%，同期业绩比较基准增长率为9.78%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2023年下半年，我们认为尽管面临全球经济复苏乏力、国内有效需求仍待释放、国际环境依然严峻复杂等诸多挑战，但经济的恢复向好趋势仍将延续，虽然恢复的速度可能不及2022年底时市场的乐观预期，但这仍将是一个斜率大于零的持续改善的过程，并且随着资产负债表和信心的不断修复而最终使经济运行进入投资、生产、消费活动相互促进的正向循环。但应注意到，随着经济转型的不断推进和经济发展中主要矛盾的变化，传统刺激政策和偏总量的货币信用工具可能会逐步让位于更加聚焦于高质量发展、现代化工业体系打造、产业链供应链安全可控等关键领域的结构性政策和工具，这一过程也将孕育出若干中长期大体量的投资机会。

证券市场方面，我们认为A股已具备较好的中长期投资价值：一方面，随着国内经济恢复向好以及海外加息节奏趋缓，资产负债表的修复和风险偏好的提升已可期待，前期制约市场向上运行的不确定因素逐渐边际好转；另一方面，经历过去一年半的调整出

清，市场估值已具备吸引力，投资的收益风险比明显改善，配置价值显现。同时，在国内流动性相对充裕以及海外通胀压力预期好转的背景下，A股料将迎来增量配置资金。总体来说，我们对国内证券市场在2023年下半年的表现持相对乐观的态度。但是，也应看到当市场整体运行在波动率较大的区间时，无论是宽基指数还是细分行业指数，预测其变化的幅度、速率以及时间窗口的难度仍然较大，当未知因素变多时，一套以概率思维为指导的行之有效的应对方法，也许比更依赖单一结果的押注式预测更加具有现实意义。因此，我们亦鼓励投资者一方面以更长期的视角进行基金配置，更多考虑业绩与估值的匹配程度以及收益风险比，同时另一方面在投资时机以及投资品种上进行一定的分散化处理，以更好的进行风险对冲，最终力争实现收益的长期积累并更充分的发挥复利效应。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

公司基金估值委员会下设基金估值工作小组，由具备丰富专业知识、两年以上基金行业相关领域工作经历、熟悉基金投资品种定价及基金估值法律法规、具备较强专业胜任能力的基金经理（投资经理）、股票/债券研究员、基金运营部、风险管理部和内控合规部的相关人员组成。

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

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

报告期内，本基金管理人未与任何第三方签订与估值相关的定价服务协议。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

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

本报告期内本基金管理人无应说明预警信息。

### §5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，国泰君安证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在天弘中证红利低波动100指数型发起式证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况（如有）、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整。

### §6 半年度财务会计报告（未经审计）

#### 6.1 资产负债表

会计主体：天弘中证红利低波动100指数型发起式证券投资基金

报告截止日：2023年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	64,956,057.26	22,353,402.26
结算备付金		2,177,263.53	121,132.72
存出保证金		573,637.91	210,110.55
交易性金融资产	6.4.7.2	1,215,367,589.08	443,698,551.69

其中：股票投资		1,212,241,911.41	441,647,930.42
基金投资		-	-
债券投资		3,125,677.67	2,050,621.27
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	-	-
债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		27,591,518.88	1,356,125.89
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		1,310,666,066.66	467,739,323.11
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2023年06月30日</b>	<b>上年度末 2022年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		24,954,782.88	14.47
应付赎回款		4,050,603.33	1,935,874.87

应付管理人报酬		536,329.08	211,570.50
应付托管费		107,265.81	42,314.08
应付销售服务费		151,261.67	50,330.16
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	882,319.11	335,935.74
负债合计		30,682,561.88	2,576,039.82
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	880,728,665.41	358,204,383.30
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	399,254,839.37	106,958,899.99
净资产合计		1,279,983,504.78	465,163,283.29
负债和净资产总计		1,310,666,066.66	467,739,323.11

注：报告截止日2023年06月30日，天弘中证红利低波动100指数型发起式证券投资基金A类基金份额净值1.4611元，天弘中证红利低波动100指数型发起式证券投资基金C类基金份额净值1.4505元；基金份额总额880,728,665.41份，其中天弘中证红利低波动100指数型发起式证券投资基金A类基金份额232,524,476.31份，天弘中证红利低波动100指数型发起式证券投资基金C类基金份额648,204,189.10份。

## 6.2 利润表

会计主体：天弘中证红利低波动100指数型发起式证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2023年01月01日至 2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至202 2年06月30日
一、营业总收入		49,710,110.12	-476,927.99
1.利息收入		430,341.85	161,107.03
其中：存款利息收入	6.4.7.9	430,341.85	161,107.03
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		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		59,412,075.84	7,797,874.13
其中：股票投资收益	6.4.7.10	32,925,516.15	-112,939.03
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	12,636.09	44,677.93
资产支持证券投资	6.4.7.12	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	26,473,923.60	7,866,135.23
以摊余成本计量的金融资产终止确认产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-10,355,905.56	-8,552,435.89
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	223,597.99	116,526.74
<b>减：二、营业总支出</b>		<b>3,207,506.45</b>	<b>1,267,338.91</b>
1. 管理人报酬		2,093,374.94	773,550.61
2. 托管费		418,675.01	154,710.09
3. 销售服务费		522,461.37	228,792.79
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-

其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		-	0.24
8. 其他费用	6.4.7.19	172,995.13	110,285.18
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		46,502,603.67	-1,744,266.90
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		46,502,603.67	-1,744,266.90
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		46,502,603.67	-1,744,266.90

### 6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：天弘中证红利低波动100指数型发起式证券投资基金

本报告期：2023年01月01日至2023年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	358,204,383.30	-	106,958,899.99	465,163,283.29
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	358,204,383.30	-	106,958,899.99	465,163,283.29

三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	522,524,282.11	-	292,295,939.38	814,820,221.49
（一）、综合收益总额	-	-	46,502,603.67	46,502,603.67
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	522,524,282.11	-	245,793,335.71	768,317,617.82
其中：1.基金申购款	1,231,939,803.80	-	565,412,504.04	1,797,352,307.84
2.基金赎回款	-709,415,521.69	-	-319,619,168.33	-1,029,034,690.02
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产（基金净值）	880,728,665.41	-	399,254,839.37	1,279,983,504.78
项目	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产（基金净值）	141,041,362.66	-	38,879,790.63	179,921,153.29

加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产（基金净值）	141,041,362.66	-	38,879,790.63	179,921,153.29
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	142,649,136.52	-	46,627,631.20	189,276,767.72
（一）、综合收益总额	-	-	-1,744,266.90	-1,744,266.90
（二）、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	142,649,136.52	-	48,371,898.10	191,021,034.62
其中：1.基金申购款	518,123,580.82	-	153,507,791.89	671,631,372.71
2.基金赎回款	-375,474,444.30	-	-105,135,893.79	-480,610,338.09
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-	-
（四）、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产	283,690,499.18	-	85,507,421.83	369,197,921.01

资产（基金净值）				
----------	--	--	--	--

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：

韩歆毅（代）

薄贺龙

薄贺龙

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

天弘中证红利低波动100指数型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]1808号《关于准予天弘中证红利低波动100指数型发起式证券投资基金注册的批复》准予注册，由天弘基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘中证红利低波动100指数型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式、发起式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集98,606,855.52元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2019)第0654号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《天弘中证红利低波动100指数型发起式证券投资基金基金合同》于2019年12月10日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为98,637,738.95份基金份额，其中认购资金利息折合30,883.43份基金份额。本基金的基金管理人为天弘基金管理有限公司，基金托管人为国泰君安证券股份有限公司。

根据《天弘中证红利低波动100指数型发起式证券投资基金基金合同》和《天弘中证红利低波动100指数型发起式证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金根据所收取认购/申购费用、赎回费用、销售服务费用方式的差异，将基金份额分为不同的类别。其中：在投资人认购/申购、赎回基金时收取认购/申购费用、赎回费用，并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为A类基金份额。在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用、赎回时收取赎回费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为C类基金份额。本基金A类和C类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算并公布基金份额净值和基金份额累计净值。

本基金为发起式基金，发起资金认购部分为10,000,444.49份基金份额，发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于3年。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘中证红利低波动100指数型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，以中证红利低波动100指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。为更好地实

现投资目标,本基金也可少量投资于其他股票(非标的指数成份股及其备选成份股,含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、存托凭证、银行存款、债券、债券回购、股指期货、资产支持证券、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金可以根据相关法律法规的规定参与融资和转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种,基金管理人在履行适当程序后,可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为:本基金投资于中证红利低波动100指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%;本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券,其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制,基金管理人在履行适当程序后,可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准:中证红利低波动100指数收益率 $\times$ 95%+银行活期存款利率(税后) $\times$ 5%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》及其他相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《天弘中证红利低波动100指数型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2023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2023年06月30日的财务状况以及2023年度上半年的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

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

#### 6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

## 6.4.6 税项

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

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

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

## 6.4.7 重要财务报表项目的说明

### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	
	2023年06月30日	
活期存款		64,956,057.26
等于：本金		64,920,651.21
加：应计利息		35,406.05
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		64,956,057.26

#### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末				
	2023年06月30日				
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动	
股票	1,235,280,642.31	-	1,212,241,911.41	-23,038,730.90	
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-	
债券	交易所市场	3,098,956.00	21,017.67	3,125,677.67	5,704.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	3,098,956.00	21,017.67	3,125,677.67	5,704.00
资产支持证券	-	-	-	-	



基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,238,379,598.31	21,017.67	1,215,367,589.08	-23,033,026.90

#### 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 2023年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	155.09
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	736,436.12
其中：交易所市场	736,436.12
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	89,260.15
其他应付款	56,467.75
合计	882,319.11

#### 6.4.7.7 实收基金

**6.4.7.7.1 天弘中证红利低波动100A**

金额单位：人民币元

项目 (天弘中证红利低波动100A)	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	151,835,238.93	151,835,238.93
本期申购	211,516,586.36	211,516,586.36
本期赎回（以“-”号填列）	-130,827,348.98	-130,827,348.98
本期末	232,524,476.31	232,524,476.31

**6.4.7.7.2 天弘中证红利低波动100C**

金额单位：人民币元

项目 (天弘中证红利低波动100C)	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	206,369,144.37	206,369,144.37
本期申购	1,020,423,217.44	1,020,423,217.44
本期赎回（以“-”号填列）	-578,588,172.71	-578,588,172.71
本期末	648,204,189.10	648,204,189.10

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 天弘中证红利低波动100A**

单位：人民币元

项目 (天弘中证红利低波动100A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	39,685,681.33	6,366,040.35	46,051,721.68
本期利润	18,201,614.71	11,750,201.82	29,951,816.53
本期基金份额交易产生的变动数	19,476,020.24	11,739,316.23	31,215,336.47
其中：基金申购款	58,998,174.00	34,187,266.90	93,185,440.90

基金赎回款	-39,522,153.76	-22,447,950.67	-61,970,104.43
本期已分配利润	-	-	-
本期末	77,363,316.28	29,855,558.40	107,218,874.68

#### 6.4.7.8.2 天弘中证红利低波动100C

单位：人民币元

项目 (天弘中证红利低波动 100C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	52,310,415.92	8,596,762.39	60,907,178.31
本期利润	38,656,894.52	-22,106,107.38	16,550,787.14
本期基金份额交易产生的变动数	118,354,733.92	96,223,265.32	214,577,999.24
其中：基金申购款	278,933,255.96	193,293,807.18	472,227,063.14
基金赎回款	-160,578,522.04	-97,070,541.86	-257,649,063.90
本期已分配利润	-	-	-
本期末	209,322,044.36	82,713,920.33	292,035,964.69

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
活期存款利息收入	417,665.02
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	10,179.46
其他	2,497.37
合计	430,341.85

#### 6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2023年01月01日至2023年06月30日
卖出股票成交总额	734,797,123.48
减：卖出股票成本总额	700,024,869.84
减：交易费用	1,846,737.49
买卖股票差价收入	32,925,516.15

#### 6.4.7.11 债券投资收益

##### 6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
债券投资收益——利息收入	13,860.09
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-1,224.00
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	12,636.09

##### 6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	2,052,210.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,011,224.00
减：应计利息总额	42,210.00
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	-1,224.00

**6.4.7.12 资产支持证券投资收益**

本基金本报告期未取得资产支持证券投资收益。

**6.4.7.13 贵金属投资收益**

本基金本报告期未取得贵金属投资收益。

**6.4.7.14 衍生工具收益****6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期未取得买卖权证差价收入。

**6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益**

本基金本报告期未取得其他衍生工具投资收益。

**6.4.7.15 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
股票投资产生的股利收益	26,473,923.60
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	26,473,923.60

**6.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
1.交易性金融资产	-10,355,905.56
——股票投资	-10,363,034.56
——债券投资	7,129.00
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-

——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	-10,355,905.56

#### 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
基金赎回费收入	207,339.92
基金转换费收入	16,258.07
合计	223,597.99

#### 6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内未发生信用减值损失。

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2023年01月01日至2023年06月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
指数使用费	83,734.98
合计	172,995.13

### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

#### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

#### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

## 6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

## 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

#### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日	
	成交金额	占当期 股票成 交总额 的比例	成交金额	占当期 股票成 交总额 的比例
国泰君安 证券股份 有限公司	74,530,588.37	3.39%	-	-

#### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

#### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日			
	当期佣金	占当期	期末应付佣金余额	占期末应

		佣金总量的比例		付佣金总额的比例
国泰君安证券股份有限公司	17,243.85	1.85%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
-	-	-	-	-

注:1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定,以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,093,374.94	773,550.61
其中:支付销售机构的客户维护费	685,213.72	272,020.37

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

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



## 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023 年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至2022 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	418,675.01	154,710.09

注:支付基金托管人国泰君安证券股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日托管费=前一日基金资产净值×该日适用费率/当年天数。

## 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售 服务费的 各关联方 名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	天弘中证红利低波动100A	天弘中证红利低波动100C	合计
天弘基金 管理有限 公司	-	28,286.84	28,286.84
国泰君安 证券股份 有限公司	-	546.76	546.76
合计	-	28,833.60	28,833.60
获得销售 服务费的 各关联方 名称	上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	天弘中证红利低波动100A	天弘中证红利低波动100C	合计
天弘基金 管理有限 公司	-	20,026.50	20,026.50
国泰君安 证券股份 有限公司	-	790.49	790.49

合计	-	20,816.99	20,816.99
----	---	-----------	-----------

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。天弘中证红利低波动100C按0.20%计提销售服务费。销售服务费的计算公式为：

日销售服务费=前一日各级基金资产净值×该日适用费率/当年天数。

2、天弘中证红利低波动100A不收取销售服务费。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

#### 6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

天弘中证红利低波动100A

份额单位：份

项目	本期 2023年01月01日至 2023年06月30日	上年度可比期间 2022年01月01日至 2022年06月30日
报告期初持有的基金份额	-	5,000,222.27
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	-	5,000,222.27

报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	7.10%
---------------------	---	-------

天弘中证红利低波动100C

份额单位：份

项目	本期 2023年01月01日至 2023年06月30日		上年度可比期间 2022年01月01日至 2022年06月30日	
	报告期初持有的基金份额	-	5,000,222.22	-
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	-	5,000,222.22	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	2.34%	-	-

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

本基金本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2023年01月01日至2023年06月30日		上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
国泰君安证券股份有限公司	64,956,057.26	417,665.02	21,321,534.27	154,949.86

注：本基金由基金托管人国泰君安证券股份有限公司保管的银行存款，存放在具有基金托管资格的银行，按银行同业利率或约定利率计息。

## 6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2023年01月01日至2023年06月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张/股）	总金额
国泰君安证券股份有限公司	001314	亿道信息	网下申购	508	17,780.00
国泰君安证券股份有限公司	001311	多利科技	网下申购	499	30,873.13
国泰君安证券股份有限公司	603065	宿迁联盛	网下申购	581	7,465.85
国泰君安证券股份有限公司	603135	中重科技	网下申购	5,667	100,872.60
国泰君安证券股份有限公司	688479	友车科技	网下申购	3,318	112,778.82
国泰君安证券股份有限公司	688361	中科飞测	网下申购	7,207	170,085.20
国泰君安证券股份有限公司	688543	国科军工	网下申购	4,094	178,784.98
上年度可比期间 2022年01月01日至2022年06月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张/股）	总金额

				/股)	
国泰君安证券股份有限公司	603070	万控智造	网下申购	775	7,300.50
国泰君安证券股份有限公司	688238	和元生物	网下申购	7,106	94,012.38
国泰君安证券股份有限公司	688120	华海清科	网下申购	1,326	181,211.16
国泰君安证券股份有限公司	688234	天岳先进	网下申购	773	63,996.67

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本报告期末，本基金（因追踪指数成份股而被动）持有国泰君安的股票1,005,342股（上年度末：325,442股），估值总额为人民币14,064,734.58元（上年度末：4,422,756.78元），占基金净资产的比例为1.10%（上年度末：0.95%）。

#### 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（2023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
301486	致尚科技	2023-06-30	1个月内（含）	新股未上市	57.66	57.66	4,820	277,921.20	277,921.20	-
301395	仁信新材	2023-06-2	1个月内（含）	新股未上	26.68	26.68	5,196	138,629.28	138,629.28	-

		1		市						
301292	海科新源	2023-06-29	1个月内(含)	新股未上市	19.99	19.99	5,824	116,421.76	116,421.76	-
301488	豪恩汽电	2023-06-26	1个月内(含)	新股未上市	39.78	39.78	2,618	104,144.04	104,144.04	-
301202	朗威股份	2023-06-28	1个月内(含)	新股未上市	25.82	25.82	3,060	79,009.20	79,009.20	-
688307	中润光学	2023-02-08	6个月	科创板打新限售	23.88	31.73	2,455	58,625.40	77,897.15	-
688603	天承科技	2023-06-30	1个月内(含)	新股未上市	55.00	55.00	1,391	76,505.00	76,505.00	-
688472	阿特斯	2023-06-02	6个月	科创板打新限售	11.10	17.04	4,362	48,418.20	74,328.48	-
301261	恒工精密	2023-06-29	1个月内(含)	新股未上市	36.90	36.90	1,973	72,803.70	72,803.70	-
688249	晶合集成	2023-04-24	6个月	科创板打新限售	19.86	18.06	3,863	76,719.18	69,765.78	-
688443	智翔金泰	2023-06-13	6个月	科创板打新限售	37.88	29.49	2,227	84,358.76	65,674.23	-
688361	中科	2023-05-1	6个月	科创	23.60	64.67	721	17,015.60	46,627.07	-

	飞测	2		板打 新限 售							
6884 69	中芯 集成	2023 -04-2 8	6个月	科创 板打 新限 售	5.69	5.41	7,287	41,46 3.03	39,42 2.67	-	
3013 25	曼恩 斯特	2023 -05-0 4	6个月	创业 板打 新限 售	76.80	107.9 5	364	27,95 5.20	39,29 3.80	-	
0012 86	陕西 能源	2023 -03-3 1	6个月	新股 锁定	9.60	9.41	3,767	36,16 3.20	35,44 7.47	-	
3013 01	川宁 生物	2022 -12-2 0	6个月	创业 板打 新限 售	5.00	8.96	3,561	17,80 5.00	31,90 6.56	-	
6885 76	西山 科技	2023 -05-3 0	6个月	科创 板打 新限 售	135.8 0	120.4 1	240	32,59 2.00	28,89 8.40	-	
6885 31	日联 科技	2023 -03-2 4	6个月	科创 板打 新限 售	152.3 8	135.9 7	197	30,01 8.86	26,78 6.09	-	
6885 82	N芯 动	2023 -06-2 1	6个月	科创 板打 新限 售	26.74	40.68	648	17,32 7.52	26,36 0.64	-	
3012 93	三博 脑科	2023 -04-2 5	6个月	创业 板打 新限 售	29.60	71.42	333	9,85 6.80	23,78 2.86	-	

301358	湖南裕能	2023-02-01	6个月	创业板打新限售	23.77	42.89	535	12,716.95	22,946.15	-
688552	航天南湖	2023-05-08	6个月	科创板打新限售	21.17	23.50	956	20,238.52	22,466.00	-
301260	格力博	2023-01-20	6个月	创业板打新限售	30.85	23.63	950	29,307.50	22,448.50	-
688570	天玛智控	2023-05-29	6个月	科创板打新限售	30.26	25.33	884	26,749.84	22,391.72	-
688146	中船特气	2023-04-13	6个月	科创板打新限售	36.15	38.13	577	20,858.55	22,001.01	-
688543	国科军工	2023-06-14	6个月	科创板打新限售	43.67	53.05	410	17,904.70	21,750.50	-
301307	美利信	2023-04-14	6个月	创业板打新限售	32.34	31.86	673	21,764.82	21,441.78	-
688458	美芯晟	2023-05-15	6个月	科创板打新限售	75.00	90.76	221	16,575.00	20,057.96	-
688581	安杰思	2023-05-1	6个月	科创板打	125.80	118.03	163	20,505.40	19,238.89	-



		2		新限售						
688352	颀中科技	2023-04-11	6个月	科创板打新限售	12.10	12.07	1,567	18,960.70	18,913.69	-
301317	鑫磊股份	2023-01-12	6个月	创业板打新限售	20.67	26.17	694	14,344.98	18,161.98	-
301262	海看股份	2023-06-13	6个月	创业板打新限售	30.22	25.50	692	20,912.24	17,646.00	-
001287	中电港	2023-03-30	6个月	新股锁定	11.88	21.02	817	9,705.96	17,173.34	-
688478	晶升股份	2023-04-13	6个月	科创板打新限售	32.52	42.37	402	13,073.04	17,032.74	-
301303	真兰仪表	2023-02-13	6个月	创业板打新限售	26.80	22.32	756	20,260.80	16,873.92	-
688507	索辰科技	2023-04-10	6个月	科创板打新限售	245.56	122.11	136	22,591.52	16,606.96	-
688562	航天软件	2023-05-15	6个月	科创板打新限售	12.68	22.31	726	9,205.68	16,197.06	-
6886	双元	2023	6个月	科创	125.8	86.79	178	22,40	15,44	-

23	科技	-05-31		板打新限售	8			6.64	8.62	
301332	德尔玛	2023-05-09	6个月	创业板打新限售	14.81	13.73	1,122	16,616.82	15,405.06	-
301399	英特科技	2023-05-16	6个月	创业板打新限售	43.99	51.57	293	12,889.07	15,110.01	-
301408	华人健康	2023-02-22	6个月	创业板打新限售	16.24	16.95	879	14,274.96	14,899.05	-
301305	朗坤环境	2023-05-15	6个月	创业板打新限售	25.25	19.69	753	19,013.25	14,826.57	-
301397	C溯联	2023-06-15	6个月	创业板打新限售	53.27	40.20	362	19,283.74	14,552.40	-
301419	阿莱德	2023-02-02	6个月	创业板打新限售	24.80	43.85	330	8,184.00	14,470.50	-
688334	西高院	2023-06-09	6个月	科创板打新限售	14.16	16.21	888	12,574.08	14,394.48	-
688593	新相微	2023-05-25	6个月	科创板打新限售	11.18	14.59	959	10,721.62	13,991.81	-

				售							
301210	N金杨	2023-06-21	6个月	创业板打新限售	57.88	49.17	281	16,264.28	13,816.77	-	
688512	慧智微	2023-05-08	6个月	科创板打新限售	20.92	19.16	721	15,083.32	13,814.36	-	
301382	蜂助手	2023-05-09	6个月	创业板打新限售	23.80	32.84	408	9,710.40	13,398.72	-	
301320	豪江智能	2023-06-01	6个月	创业板打新限售	13.06	20.62	642	8,384.52	13,238.04	-	
688433	华曙高科	2023-04-07	6个月	科创板打新限售	26.66	31.50	418	11,143.88	13,167.00	-	
688629	C华丰	2023-06-16	6个月	科创板打新限售	9.26	18.59	708	6,556.08	13,161.72	-	
601061	中信金属	2023-03-30	6个月	新股锁定	6.58	7.58	1,714	11,278.12	12,992.12	-	
688620	C安凯微	2023-06-15	6个月	科创板打新限售	10.68	12.34	1,016	10,850.88	12,537.44	-	
301360	荣旗科技	2023-04-1	6个月	创业板打	71.88	92.60	134	9,631.92	12,408.40	-	

		7		新限售						
301322	绿通科技	2023-02-27	6个月	创业板打新限售	131.11	53.24	230	20,059.83	12,245.20	-
301315	威士顿	2023-06-13	6个月	创业板打新限售	32.29	51.12	226	7,297.54	11,553.12	-
688523	航天环宇	2023-05-26	6个月	科创板打新限售	21.86	23.85	472	10,317.92	11,257.20	-
301225	恒勃股份	2023-06-08	6个月	创业板打新限售	35.66	33.26	333	11,874.78	11,075.58	-
301429	森泰股份	2023-04-10	6个月	创业板打新限售	28.75	21.02	499	14,346.25	10,488.98	-
301439	泓淋电力	2023-03-10	6个月	创业板打新限售	19.99	16.90	617	12,333.83	10,427.30	-
603135	中重科技	2023-03-29	6个月	新股锁定	17.80	17.89	567	10,092.60	10,143.63	-
688631	C莱斯	2023-06-19	6个月	科创板打新限售	25.28	29.87	336	8,494.08	10,036.32	-
6884	友车	2023	6个月	科创	33.99	29.49	332	11,28	9,79	-

79	科技	-05-04		板打新限售				4.68	0.68	
301232	飞沃科技	2023-06-08	6个月	创业板打新限售	72.50	58.42	165	11,962.50	9,639.30	-
301376	致欧科技	2023-06-14	6个月	创业板打新限售	24.66	22.51	420	10,357.20	9,454.20	-
301355	南王科技	2023-06-02	6个月	创业板打新限售	17.55	16.75	563	9,880.65	9,430.25	-
301357	北方长龙	2023-04-11	6个月	创业板打新限售	50.00	48.39	190	9,500.00	9,194.10	-
301386	未来电器	2023-03-21	6个月	创业板打新限售	29.99	23.79	378	11,336.22	8,992.62	-
301323	新莱福	2023-05-29	6个月	创业板打新限售	39.06	39.36	228	8,905.68	8,974.08	-
688429	C时创	2023-06-20	6个月	科创板打新限售	19.20	25.53	346	6,643.20	8,833.38	-
301373	凌玮科技	2023-01-20	6个月	创业板打新限售	33.73	31.85	277	9,343.21	8,822.45	-

				售						
301170	C锡南	2023-06-16	6个月	创业板打新限售	34.00	34.93	250	8,500.00	8,732.50	-
301281	科源制药	2023-03-28	6个月	创业板打新限售	44.18	25.10	337	10,647.38	8,458.70	-
688535	华海诚科	2023-03-28	6个月	科创板打新限售	35.00	51.23	161	5,635.00	8,248.03	-
301345	涛涛车业	2023-03-10	6个月	创业板打新限售	73.45	46.64	176	12,927.20	8,208.64	-
301157	华塑科技	2023-03-01	6个月	创业板打新限售	56.50	52.93	150	8,475.00	7,939.50	-
301295	C美硕	2023-06-19	6个月	创业板打新限售	37.40	36.07	215	8,041.00	7,755.05	-
300804	C广康	2023-06-15	6个月	创业板打新限售	42.45	32.97	226	9,593.70	7,451.22	-
301337	亚华电子	2023-05-16	6个月	创业板打新限售	32.60	30.37	232	7,563.20	7,045.84	-
3014	世纪	2023	6个月	创业	26.35	30.60	229	6,03	7,00	-

28	恒通	-05-10		板打 新限售				4.15	7.40	
601133	柏诚股份	2023-03-31	6个月	新股 锁定	11.66	12.26	552	6,43 6.32	6,76 7.52	-
601065	江盐集团	2023-03-31	6个月	新股 锁定	10.36	11.84	569	5,89 4.84	6,73 6.96	-
001380	华纬科技	2023-05-09	6个月	新股 锁定	28.84	30.78	170	4,90 2.80	5,23 2.60	-
603125	常青科技	2023-03-30	6个月	新股 锁定	25.98	24.53	160	4,15 6.80	3,92 4.80	-
001328	登康口腔	2023-03-29	6个月	新股 锁定	20.68	25.49	145	2,99 8.60	3,69 6.05	-
001282	三联锻造	2023-05-15	6个月	新股 锁定	27.93	33.03	105	2,93 2.65	3,46 8.15	-
001360	南矿集团	2023-03-31	6个月	新股 锁定	15.38	14.87	177	2,72 2.26	2,63 1.99	-
603137	恒尚节能	2023-04-10	6个月	新股 锁定	15.90	17.09	139	2,21 0.10	2,37 5.51	-
001324	长青科技	2023-05-12	6个月	新股 锁定	18.88	19.60	114	2,15 2.32	2,23 4.40	-
001367	海森药业	2023-03-30	6个月	新股 锁定	44.48	39.48	55	2,44 6.40	2,17 1.40	-
603172	万丰股份	2023-04-28	6个月	新股 锁定	14.58	16.13	122	1,77 8.76	1,96 7.86	-

注：1、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起6个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后6个月内不得转让。

2、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于6个月的限售期。

3、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

4、创业板新股致尚科技（证券代码：301486）于2023年07月07日起上市流通，本基金获配的股数中482股根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》于上市后进入限售期，可流通日为2024年01月08日。

5、创业板新股仁信新材（证券代码：301395）于2023年07月03日起上市流通，本基金获配的股数中520股根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》于上市后进入限售期，可流通日为2024年01月03日。

6、创业板新股海科新源（证券代码：301292）于2023年07月07日起上市流通，本基金获配的股数中583股根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》于上市后进入限售期，可流通日为2024年01月08日。

7、创业板新股豪恩汽电（证券代码：301488）于2023年07月04日起上市流通，本基金获配的股数中262股根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》于上市后进入限售期，可流通日为2024年01月04日。

8、创业板新股朗威股份（证券代码：301202）于2023年07月05日起上市流通，本基金获配的股数中306股根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》于上市后进入限售期，可流通日为2024年01月05日。

9、科创板新股天承科技（证券代码：688603）于2023年07月10日起上市流通，本基金获配的股数中140股根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》于上市后进入限售期，可流通日为2024年01月10日。

10、创业板新股恒工精密（证券代码：301261）于2023年07月10日起上市流通，本基金获配的股数中198股根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》于上市后进入限售期，可流通日为2024年01月10日。



**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
601298	青岛港	2023-06-28	拟筹划重大资产重组	6.97	2023-07-03	7.40	1,848,600	11,984,754.79	12,884,742.00	-

注:本基金截至2023年06月30日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,该类股票将在所公布事项的重大影响消除后,经交易所批准复牌。

**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2023年06月30日,本基金未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

**6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购**

截至本报告期末2023年06月30日,本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

**6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券**

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**

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

#### 6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款和定期存款存放在本基金的托管人国泰君安证券股份有限公司开立于具

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

新金融工具准则将金融工具所处的信用风险状况划分为三个阶段。本基金在参考历史违约率、市场信息及行业实践的基础上，选取隐含评级AA级为低信用风险阈值，并将减值阶段划分如下：在资产负债表日，若相关债券/资产支持证券投资的发行主体的中债市场隐含评级不低于初始确认隐含评级，或不低于低信用风险阈值，则处于第一阶段；若相关债券/资产支持证券投资的发行主体的中债市场隐含评级低于初始确认隐含评级，且低于低信用风险阈值，则处于第二阶段；若相关债券/资产支持证券投资的发行主体中债市场隐含评级下调至C，或出现其他认定为违约的情形时，则处于第三阶段。

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 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	3,125,677.67	2,050,621.27
合计	3,125,677.67	2,050,621.27

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

#### 6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级的资产支持证券。

#### **6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

本基金本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级的同业存单。

#### **6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

本基金本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级的债券。

#### **6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资**

本基金本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级的资产支持证券。

#### **6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资**

本基金本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级的同业存单。

### **6.4.13.3 流动性风险**

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

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

于2023年6月30日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(净资产)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### **6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析**

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短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股票不得超过该上市公司可流通股股票的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股票，不得超过该上市公司可流通股股票的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 2023 年 06 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	64,956,057.26	-	-	-	64,956,057.26
结算备付金	2,177,263.53	-	-	-	2,177,263.53
存出保证金	573,637.91	-	-	-	573,637.91
交易性金融资产	3,125,677.67	-	-	1,212,241,911.41	1,215,367,589.08
应收申购款	-	-	-	27,591,518.88	27,591,518.88
资产总计	70,832,636.37	-	-	1,239,833,430.29	1,310,666,066.66
负债					
应付清算款	-	-	-	24,954,782.88	24,954,782.88
应付赎回款	-	-	-	4,050,603.33	4,050,603.33
应付管理人报酬	-	-	-	536,329.08	536,329.08
应付托管费	-	-	-	107,265.81	107,265.81
应付销售服务费	-	-	-	151,261.67	151,261.67
其他负债	-	-	-	882,319.11	882,319.11
负债总计	-	-	-	30,682,561.88	30,682,561.88
利率敏感度缺口	70,832,636.37	-	-	1,209,150,868.41	1,279,983,504.78
上年度末 2022 年 12 月 31 日					
资产					
银行存款	22,353,402.26	-	-	-	22,353,402.26
结算备付金	121,132.72	-	-	-	121,132.72
存出保证金	210,110.55	-	-	-	210,110.55
交易性金融资产	2,050,621.27	-	-	441,647,930.42	443,698,551.69
应收申购款	-	-	-	1,356,125.89	1,356,125.89
资产总计	24,735,266.80	-	-	443,004,056.31	467,739,323.11
负债					
应付清算款	-	-	-	14.47	14.47

应付赎回款	-	-	-	1,935,874.87	1,935,874.87
应付管理人报酬	-	-	-	211,570.50	211,570.50
应付托管费	-	-	-	42,314.08	42,314.08
应付销售服务费	-	-	-	50,330.16	50,330.16
其他负债	-	-	-	335,935.74	335,935.74
负债总计	-	-	-	2,576,039.82	2,576,039.82
利率敏感度缺口	24,735,266.80	-	-	440,428,016.49	465,163,283.29

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2023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0.24%(2022年12月31日：0.44%)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响(2022年12月31日：同)。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金原则上采用完全复制法，跟踪中证红利低波动100指数，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金投资组合，并根据标的指数组成及其权重的变动而进行相应调整。但因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2023年06月30日		上年度末 2022年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净	公允价值	占基金 资产净

		值比例 (%)		值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	1,212,241,911.41	94.71	441,647,930.42	94.94
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	1,212,241,911.41	94.71	441,647,930.42	94.94

#### 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 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
	业绩比较基准上升5%	55,384,886.25	22,841,843.03
	业绩比较基准下降5%	-55,384,886.25	-22,841,843.03

#### 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



金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
第一层次	1,197,038,150.25	439,890,374.62
第二层次	16,875,853.85	2,050,621.27
第三层次	1,453,584.98	1,757,555.80
合计	1,215,367,589.08	443,698,551.69

#### 6.4.14.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

#### 6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2023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(2022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	1,212,241,911.41	92.49

	其中：股票	1,212,241,911.41	92.49
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	3,125,677.67	0.24
	其中：债券	3,125,677.67	0.24
	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	67,133,320.79	5.12
8	其他各项资产	28,165,156.79	2.15
9	合计	1,310,666,066.66	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	9,019,078.00	0.70
B	采矿业	17,278,212.00	1.35
C	制造业	529,087,799.16	41.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	70,695,197.68	5.52
E	建筑业	38,966,901.00	3.04
F	批发和零售业	34,282,746.00	2.68
G	交通运输、仓储和邮政业	115,941,409.23	9.06
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,971,886.00	0.70
J	金融业	316,101,473.70	24.70
K	房地产业	42,441,521.48	3.32
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	27,136,668.00	2.12
S	综合	-	-
	合计	1,209,922,892.25	94.53

### 7.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,057,623.94	0.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	35,447.47	0.00
E	建筑业	9,143.03	0.00
F	批发和零售业	54,518.71	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	109,282.10	0.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	14,394.48	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	14,826.57	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-

P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	23,782.86	0.00
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,319,019.16	0.18

### 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

#### 7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002110	三钢闽光	8,241,300	34,778,286.00	2.72
2	601006	大秦铁路	4,023,886	29,897,472.98	2.34
3	000895	双汇发展	1,116,300	27,338,187.00	2.14
4	000789	万年青	3,373,100	26,141,525.00	2.04
5	600177	雅戈尔	3,894,841	24,576,446.71	1.92
6	600782	新钢股份	6,470,625	24,006,018.75	1.88
7	000651	格力电器	637,300	23,267,823.00	1.82
8	002563	森马服饰	3,479,995	21,645,568.90	1.69
9	002233	塔牌集团	2,602,491	20,091,230.52	1.57
10	600282	南钢股份	5,860,900	19,751,233.00	1.54
11	000717	中南股份	7,072,101	19,660,440.78	1.54
12	600170	上海建工	7,269,200	19,554,148.00	1.53
13	600019	宝钢股份	3,449,000	19,383,380.00	1.51
14	600064	南京高科	2,773,668	18,333,945.48	1.43
15	002440	闰土股份	2,594,100	17,302,647.00	1.35
16	600028	中国石化	2,716,700	17,278,212.00	1.35
17	601169	北京银行	3,723,600	17,240,268.00	1.35
18	600104	上汽集团	1,216,300	17,234,971.00	1.35
19	002042	华孚时尚	5,256,500	16,505,410.00	1.29

20	600398	海澜之家	2,389,300	16,438,384.00	1.28
21	601000	唐山港	4,529,200	15,988,076.00	1.25
22	601992	金隅集团	7,194,000	15,682,920.00	1.23
23	600016	民生银行	4,154,000	15,577,500.00	1.22
24	600269	赣粤高速	4,216,100	15,473,087.00	1.21
25	000401	冀东水泥	2,068,700	15,246,319.00	1.19
26	600273	嘉化能源	1,551,500	14,615,130.00	1.14
27	601211	国泰君安	1,005,342	14,064,734.58	1.10
28	601398	工商银行	2,878,700	13,875,334.00	1.08
29	601328	交通银行	2,383,700	13,825,460.00	1.08
30	601229	上海银行	2,396,500	13,779,875.00	1.08
31	601288	农业银行	3,842,800	13,565,084.00	1.06
32	000157	中联重科	2,002,100	13,514,175.00	1.06
33	601077	渝农商行	3,703,500	13,295,565.00	1.04
34	601988	中国银行	3,341,400	13,064,874.00	1.02
35	600663	陆家嘴	1,314,800	12,977,076.00	1.01
36	601298	青岛港	1,848,600	12,884,742.00	1.01
37	000932	华菱钢铁	2,686,500	12,814,605.00	1.00
38	000898	鞍钢股份	4,597,600	12,781,328.00	1.00
39	000783	长江证券	2,152,072	12,482,017.60	0.98
40	600900	长江电力	561,200	12,380,072.00	0.97
41	600901	江苏金租	2,966,800	12,252,884.00	0.96
42	003816	中国广核	3,904,000	12,141,440.00	0.95
43	601098	XD中南传	1,042,700	12,095,320.00	0.94
44	600000	浦发银行	1,659,900	12,017,676.00	0.94
45	600655	豫园股份	1,674,700	11,488,442.00	0.90
46	601939	建设银行	1,834,600	11,484,596.00	0.90
47	601866	中远海发	4,634,900	11,448,203.00	0.89
48	600648	外高桥	1,011,600	11,441,196.00	0.89
49	000039	中集集团	1,657,250	11,418,452.50	0.89
50	601598	中国外运	2,447,900	11,407,214.00	0.89

51	600704	物产中大	2,298,200	11,353,108.00	0.89
52	000402	金融街	2,462,500	11,130,500.00	0.87
53	600837	海通证券	1,182,400	10,901,728.00	0.85
54	600126	杭钢股份	2,496,100	10,833,074.00	0.85
55	600999	招商证券	786,000	10,666,020.00	0.83
56	600008	首创环保	3,697,900	10,649,952.00	0.83
57	000538	云南白药	200,400	10,516,992.00	0.82
58	601818	光大银行	3,358,900	10,311,823.00	0.81
59	000900	现代投资	2,472,800	9,965,384.00	0.78
60	600642	申能股份	1,424,000	9,953,760.00	0.78
61	601997	贵阳银行	1,922,340	9,919,274.40	0.77
62	600820	隧道股份	1,615,300	9,707,953.00	0.76
63	600846	同济科技	866,500	9,704,800.00	0.76
64	600015	华夏银行	1,737,400	9,399,334.00	0.73
65	688009	中国通号	1,587,976	9,210,260.80	0.72
66	600352	浙江龙盛	977,500	9,139,625.00	0.71
67	601139	深圳燃气	1,247,392	9,093,487.68	0.71
68	600598	北大荒	676,600	9,019,078.00	0.70
69	600637	东方明珠	1,147,300	8,971,886.00	0.70
70	000778	新兴铸管	2,192,200	8,944,176.00	0.70
71	600623	华谊集团	1,432,300	8,923,229.00	0.70
72	600018	上港集团	1,690,901	8,877,230.25	0.69
73	601688	华泰证券	642,100	8,841,717.00	0.69
74	600390	五矿资本	1,630,300	8,771,014.00	0.69
75	000559	万向钱潮	1,579,100	8,606,095.00	0.67
76	600674	川投能源	567,400	8,539,370.00	0.67
77	000156	华数传媒	950,600	8,270,220.00	0.65
78	601766	中国中车	1,269,000	8,248,500.00	0.64
79	600867	通化东宝	764,200	7,978,248.00	0.62
80	600025	华能水电	1,113,200	7,937,116.00	0.62
81	000725	京东方 A	1,894,200	7,747,278.00	0.61

82	600887	伊利股份	270,500	7,660,560.00	0.60
83	002958	青农商行	2,710,700	7,373,104.00	0.58
84	002030	达安基因	710,660	7,085,280.20	0.55
85	601019	山东出版	738,400	6,771,128.00	0.53
86	600928	西安银行	1,814,000	6,385,280.00	0.50
87	601166	兴业银行	372,500	5,829,625.00	0.46
88	601860	紫金银行	2,217,300	5,565,423.00	0.43
89	002948	青岛银行	1,644,300	5,146,659.00	0.40
90	601009	南京银行	595,100	4,760,800.00	0.37
91	601577	长沙银行	590,500	4,582,280.00	0.36
92	600919	江苏银行	611,890	4,497,391.50	0.35
93	601998	中信银行	711,969	4,257,574.62	0.33
94	603323	苏农银行	882,200	3,714,062.00	0.29
95	601658	邮储银行	720,600	3,523,734.00	0.28
96	002966	苏州银行	498,200	3,263,210.00	0.25
97	002839	张家港行	769,600	3,255,408.00	0.25
98	600926	杭州银行	246,200	2,892,850.00	0.23
99	600908	无锡银行	539,000	2,889,040.00	0.23
100	601128	常熟银行	414,700	2,828,254.00	0.22

### 7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	301486	致尚科技	4,820	277,921.20	0.02
2	301395	仁信新材	5,196	138,629.28	0.01
3	301292	海科新源	5,824	116,421.76	0.01
4	301488	豪恩汽电	2,618	104,144.04	0.01
5	301202	朗威股份	3,060	79,009.20	0.01
6	688307	中润光学	2,455	77,897.15	0.01

7	688603	天承科技	1,391	76,505.00	0.01
8	688472	阿特斯	4,362	74,328.48	0.01
9	301261	恒工精密	1,973	72,803.70	0.01
10	688249	晶合集成	3,863	69,765.78	0.01
11	688443	智翔金泰	2,227	65,674.23	0.01
12	688361	中科飞测	721	46,627.07	0.00
13	688469	中芯集成	7,287	39,422.67	0.00
14	301325	曼恩斯特	364	39,293.80	0.00
15	001286	陕西能源	3,767	35,447.47	0.00
16	301301	川宁生物	3,561	31,906.56	0.00
17	688576	西山科技	240	28,898.40	0.00
18	688531	日联科技	197	26,786.09	0.00
19	688582	N芯动	648	26,360.64	0.00
20	301293	三博脑科	333	23,782.86	0.00
21	301358	湖南裕能	535	22,946.15	0.00
22	688552	航天南湖	956	22,466.00	0.00
23	301260	格力博	950	22,448.50	0.00
24	688570	天玛智控	884	22,391.72	0.00
25	688146	中船特气	577	22,001.01	0.00
26	688543	国科军工	410	21,750.50	0.00
27	301307	美利信	673	21,441.78	0.00
28	688458	美芯晟	221	20,057.96	0.00
29	688581	安杰思	163	19,238.89	0.00
30	688352	颀中科技	1,567	18,913.69	0.00
31	301317	鑫磊股份	694	18,161.98	0.00
32	301262	海看股份	692	17,646.00	0.00
33	001287	中电港	817	17,173.34	0.00
34	688478	晶升股份	402	17,032.74	0.00
35	301303	真兰仪表	756	16,873.92	0.00
36	688507	索辰科技	136	16,606.96	0.00
37	688562	航天软件	726	16,197.06	0.00



38	688623	双元科技	178	15,448.62	0.00
39	301332	德尔玛	1,122	15,405.06	0.00
40	301399	英特科技	293	15,110.01	0.00
41	301408	华人健康	879	14,899.05	0.00
42	301305	朗坤环境	753	14,826.57	0.00
43	301397	C溯联	362	14,552.40	0.00
44	301419	阿莱德	330	14,470.50	0.00
45	688334	西高院	888	14,394.48	0.00
46	688593	新相微	959	13,991.81	0.00
47	301210	N金杨	281	13,816.77	0.00
48	688512	慧智微	721	13,814.36	0.00
49	301382	蜂助手	408	13,398.72	0.00
50	301320	豪江智能	642	13,238.04	0.00
51	688433	华曙高科	418	13,167.00	0.00
52	688629	C华丰	708	13,161.72	0.00
53	601061	中信金属	1,714	12,992.12	0.00
54	688620	C安凯微	1,016	12,537.44	0.00
55	301360	荣旗科技	134	12,408.40	0.00
56	301322	绿通科技	230	12,245.20	0.00
57	301315	威士顿	226	11,553.12	0.00
58	688523	航天环宇	472	11,257.20	0.00
59	301225	恒勃股份	333	11,075.58	0.00
60	301429	森泰股份	499	10,488.98	0.00
61	301439	泓淋电力	617	10,427.30	0.00
62	603135	中重科技	567	10,143.63	0.00
63	688631	C莱斯	336	10,036.32	0.00
64	688479	友车科技	332	9,790.68	0.00
65	301232	飞沃科技	165	9,639.30	0.00
66	301376	致欧科技	420	9,454.20	0.00
67	301355	南王科技	563	9,430.25	0.00
68	301357	北方长龙	190	9,194.10	0.00

69	301386	未来电器	378	8,992.62	0.00
70	301323	新莱福	228	8,974.08	0.00
71	688429	C时创	346	8,833.38	0.00
72	301373	凌玮科技	277	8,822.45	0.00
73	301170	C锡南	250	8,732.50	0.00
74	301281	科源制药	337	8,458.70	0.00
75	688535	华海诚科	161	8,248.03	0.00
76	301345	涛涛车业	176	8,208.64	0.00
77	301157	华塑科技	150	7,939.50	0.00
78	301295	C美硕	215	7,755.05	0.00
79	300804	C广康	226	7,451.22	0.00
80	301337	亚华电子	232	7,045.84	0.00
81	301428	世纪恒通	229	7,007.40	0.00
82	601133	柏诚股份	552	6,767.52	0.00
83	601065	江盐集团	569	6,736.96	0.00
84	001380	华纬科技	170	5,232.60	0.00
85	603125	常青科技	160	3,924.80	0.00
86	001328	登康口腔	145	3,696.05	0.00
87	001282	三联锻造	105	3,468.15	0.00
88	001360	南矿集团	177	2,631.99	0.00
89	603137	恒尚节能	139	2,375.51	0.00
90	001324	长青科技	114	2,234.40	0.00
91	001367	海森药业	55	2,171.40	0.00
92	603172	万丰股份	122	1,967.86	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	002110	三钢闽光	37,051,691.73	7.97
2	600782	新钢股份	28,210,240.00	6.06
3	000895	双汇发展	27,699,288.67	5.95
4	000789	万年青	27,637,806.76	5.94
5	601006	大秦铁路	26,835,373.29	5.77
6	600177	雅戈尔	24,526,054.98	5.27
7	000717	中南股份	24,280,708.48	5.22
8	600028	中国石化	23,692,953.90	5.09
9	600170	上海建工	22,295,414.00	4.79
10	000651	格力电器	20,073,380.00	4.32
11	002042	华孚时尚	20,047,135.35	4.31
12	600019	宝钢股份	19,338,447.88	4.16
13	600269	赣粤高速	18,772,308.08	4.04
14	600282	南钢股份	18,752,544.89	4.03
15	600064	南京高科	18,486,775.21	3.97
16	600373	中文传媒	18,452,394.93	3.97
17	002440	闰土股份	18,396,604.04	3.95
18	600694	大商股份	18,251,253.39	3.92
19	000581	威孚高科	17,617,787.39	3.79
20	002233	塔牌集团	17,450,741.06	3.75
21	002563	森马服饰	17,352,388.08	3.73
22	600273	嘉化能源	17,284,096.00	3.72
23	600663	陆家嘴	17,148,151.27	3.69
24	601992	金隅集团	16,635,755.58	3.58
25	600104	上汽集团	16,600,370.00	3.57
26	000401	冀东水泥	16,152,113.87	3.47
27	601098	中南传媒	15,610,661.86	3.36
28	601169	北京银行	15,370,083.30	3.30
29	601000	唐山港	15,044,244.68	3.23
30	600655	豫园股份	15,000,733.59	3.22
31	000932	华菱钢铁	14,754,501.00	3.17

32	603156	养元饮品	14,701,705.52	3.16
33	600350	山东高速	14,543,637.31	3.13
34	600126	杭钢股份	14,449,759.70	3.11
35	601818	光大银行	14,243,020.00	3.06
36	601288	XD农业银	13,914,523.00	2.99
37	600398	海澜之家	13,869,195.00	2.98
38	601211	国泰君安	13,742,238.00	2.95
39	600016	民生银行	13,720,902.00	2.95
40	000402	金融街	13,373,301.00	2.87
41	600837	海通证券	13,357,251.97	2.87
42	601598	中国外运	13,275,809.00	2.85
43	600999	招商证券	13,190,616.00	2.84
44	601866	中远海发	13,189,748.00	2.84
45	601229	上海银行	13,128,708.55	2.82
46	601077	渝农商行	13,081,248.00	2.81
47	601988	中国银行	13,053,033.90	2.81
48	000900	现代投资	12,911,932.69	2.78
49	000898	鞍钢股份	12,647,241.00	2.72
50	600008	首创环保	12,596,291.00	2.71
51	600900	长江电力	12,143,494.00	2.61
52	601857	中国石油	12,092,236.00	2.60
53	601398	工商银行	11,925,724.00	2.56
54	601328	交通银行	11,586,883.00	2.49
55	601298	青岛港	11,506,117.00	2.47
56	000783	长江证券	11,494,044.02	2.47
57	600648	外高桥	11,489,891.00	2.47
58	000039	中集集团	11,203,113.43	2.41
59	600018	上港集团	11,136,715.01	2.39
60	000157	中联重科	11,051,849.00	2.38
61	003816	中国广核	11,036,018.00	2.37
62	600000	浦发银行	10,998,748.08	2.36

63	600642	申能股份	10,805,516.00	2.32
64	600901	江苏金租	10,685,081.20	2.30
65	600704	物产中大	10,583,464.00	2.28
66	600846	同济科技	10,571,111.90	2.27
67	000538	云南白药	10,544,554.39	2.27
68	000778	新兴铸管	10,464,665.00	2.25
69	600352	浙江龙盛	10,370,148.00	2.23
70	600598	北大荒	10,278,901.72	2.21
71	600623	华谊集团	10,256,019.00	2.20
72	000725	京东方 A	10,166,995.00	2.19
73	000685	中山公用	10,047,395.95	2.16
74	601997	贵阳银行	10,031,526.80	2.16
75	600637	东方明珠	9,972,448.79	2.14
76	600887	伊利股份	9,933,597.00	2.14
77	601939	建设银行	9,843,209.30	2.12
78	000559	万向钱潮	9,749,841.86	2.10
79	688009	中国通号	9,712,276.85	2.09
80	601139	深圳燃气	9,703,435.36	2.09
81	002030	达安基因	9,630,605.52	2.07

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	603156	养元饮品	24,979,591.92	5.37
2	600350	山东高速	24,186,214.00	5.20
3	600373	中文传媒	23,583,319.97	5.07
4	600028	中国石化	23,268,426.70	5.00

5	000581	威孚高科	20,894,702.08	4.49
6	601138	工业富联	19,919,771.06	4.28
7	600694	大商股份	18,625,713.00	4.00
8	000685	中山公用	15,878,951.46	3.41
9	601857	中国石油	14,538,998.00	3.13
10	601318	中国平安	13,421,951.20	2.89
11	600755	厦门国贸	12,995,321.33	2.79
12	600643	爱建集团	12,063,177.13	2.59
13	600449	宁夏建材	11,533,335.60	2.48
14	601098	中南传媒	11,075,611.92	2.38
15	600035	楚天高速	10,570,354.00	2.27
16	002736	国信证券	10,323,492.00	2.22
17	600368	五洲交通	10,037,882.00	2.16
18	601319	中国人保	9,574,877.00	2.06
19	600308	华泰股份	9,476,894.60	2.04
20	600398	海澜之家	9,263,640.56	1.99

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	1,480,981,885.39
卖出股票收入（成交）总额	734,797,123.48

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	3,125,677.67	0.24
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-

	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	3,125,677.67	0.24

### 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	019703	23国债10	15,000	1,507,894.52	0.12
2	019694	23国债01	13,000	1,314,425.37	0.10
3	019688	22国债23	3,000	303,357.78	0.02

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

### 7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.12 投资组合报告附注

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

**7.12.2** 基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

**7.12.3** 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	573,637.91
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	27,591,518.88
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	28,165,156.79

**7.12.4** 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

**7.12.5** 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

**7.12.5.1** 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限情况。

**7.12.5.2** 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	301486	致尚科技	277,921.20	0.02	新股未上市
2	301395	仁信新材	138,629.28	0.01	新股未上市
3	301292	海科新源	116,421.76	0.01	新股未上市
4	301488	豪恩汽电	104,144.04	0.01	新股未上市



5	301202	朗威股份	79,009.20	0.01	新股未上市
---	--------	------	-----------	------	-------

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	人均持有的基金份额	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
天弘中证红利低波动100A	20,226	11,496.32	45,255,476.18	19.46%	187,269,000.13	80.54%
天弘中证红利低波动100C	20,778	3,119.61	224,354,495.04	34.61%	423,849,694.06	65.39%
合计	22,649	3,888.56	269,609,971.22	30.61%	611,118,694.19	69.39%

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	天弘中证红利低波 动100A	1,078,151.11	0.46%
	天弘中证红利低波 动100C	337,964.60	0.05%
	合计	1,416,115.71	0.16%

### 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	天弘中证红利低波 动100A	10~50
	天弘中证红利低波 动100C	0~10
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基 金	天弘中证红利低波 动100A	0~10
	天弘中证红利低波 动100C	0
	合计	0~10

### 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

本基金成立后有10,000,444.49份为发起份额，发起份额承诺的持有期限为2019年12月10日至2022年12月10日。截至本报告期末，发起资金持有份额为0.00份。

## §9 开放式基金份额变动

单位：份

	天弘中证红利低波动10 0A	天弘中证红利低波动10 0C
基金合同生效日(2019年12月10 日)基金份额总额	48,307,428.05	50,330,310.90

本报告期期初基金份额总额	151,835,238.93	206,369,144.37
本报告期基金总申购份额	211,516,586.36	1,020,423,217.44
减：本报告期基金总赎回份额	130,827,348.98	578,588,172.71
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	232,524,476.31	648,204,189.10

## §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，童建林先生任职公司风控负责人，刘荣逵先生任职公司首席信息官，马文辉先生任职公司财务负责人，朱海扬先生不再担任公司副总经理，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》。

在本报告截止日至报告批准送出日之间，韩歆毅先生代任公司总经理，郭树强先生不再担任公司总经理，具体信息请参见基金管理人在规定媒介披露的《天弘基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。

本报告期内，本基金的基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 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，未发生涉及基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略没有改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生变化。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员未发生受稽查或处罚的情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员没有发生受稽查或处罚的情况。

## 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
安信证券	3	-	-	-	-	-
东方财富证券	2	876,141,300.10	39.81%	377,872.64	40.44%	-
方正证券	5	183,959,416.81	8.36%	79,346.68	8.49%	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券	8	74,530,588.37	3.39%	17,243.85	1.85%	-
海通证券	3	-	-	-	-	-
恒泰证券	2	305,124,489.02	13.86%	131,621.40	14.09%	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
首创证券	2	13,806,712.75	0.63%	5,954.53	0.64%	-
西部	1	86,671,691.67	3.94%	37,384.56	4.00%	-

证券						
信达证券	1	398,982,798.09	18.13%	172,088.34	18.42%	-
银河证券	2	77,602,950.38	3.53%	33,473.96	3.58%	-
中金财富	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	184,109,329.91	8.37%	79,398.35	8.50%	-
中信建投证券	2	-	-	-	-	-

注：1、基金专用交易单元的选择标准为：该证券经营机构财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；经营行为规范，内控制度健全，最近两年未因重大违规行为受到监管机关的处罚；研究实力较强，能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、市场分析报告、行业研究报告、个股分析报告及全面的信息服务等。

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

3、本基金报告期内新租用交易单元：无。

4、本基金报告期内停止租用交易单元：无。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	1,502,250.00	48.48%	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	299,124.00	9.65%	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	1,297,582.00	41.87%	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-	-	-

江海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证 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	天弘中证红利低波动100指数型发起式证券投资基金2022年第4季度报告	中国证监会规定媒介	2023-01-28
2	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会规定媒介	2023-02-04
3	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会规定媒介	2023-02-18
4	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会规定媒介	2023-03-16
5	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	2023-03-24
6	天弘中证红利低波动100指数型发起式证券投资基金2022年年度报告	中国证监会规定媒介	2023-03-31
7	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会规定媒介	2023-03-31
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	2023-04-01
9	天弘中证红利低波动100指数型发起式证券投资基金2023年第1季度报告	中国证监会规定媒介	2023-04-23
10	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会规定媒介	2023-05-06
11	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会规定媒介	2023-05-15
12	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会规定媒介	2023-06-16

## §11 影响投资者决策的其他重要信息

**11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况**

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过 20% 的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20230101-20230326	80,766,54 4.64	23,096,87 0.23	78,616,99 0.61	25,246,42 4.26	2.87%
<b>产品特有风险</b>							
<p>基金管理人秉承谨慎勤勉、独立决策、规范运作、充分披露原则，公平对待投资者，保障投资者合法权益。当单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 时，由此可能导致的特有风险主要包括：</p> <p>（1）超出基金管理人允许的单一投资者持有基金份额比例的申购申请不被确认的风险；</p> <p>（2）极端市场环境下投资者集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对赎回申请的风险；</p> <p>（3）持有基金份额占比较高的投资者大额赎回可能引发基金净值大幅波动的风险；</p> <p>（4）持有基金份额占比较高的投资者在召开基金份额持有人大会并对重大事项进行投票表决时，可能拥有较大话语权；</p> <p>（5）极端情况下，持有基金份额占比较高的投资者大量赎回后，可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平，面临转换基金运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等风险。</p>							

注：份额占比精度处理方式四舍五入。

**11.2 影响投资者决策的其他重要信息**

本报告期内，本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

**§12 备查文件目录****12.1 备查文件目录**

- 1、中国证监会批准天弘中证红利低波动100指数型发起式证券投资基金募集的文件
- 2、天弘中证红利低波动100指数型发起式证券投资基金基金合同
- 3、天弘中证红利低波动100指数型发起式证券投资基金托管协议
- 4、天弘中证红利低波动100指数型发起式证券投资基金招募说明书

- 5、报告期内在指定报刊上披露的各项公告
- 6、中国证监会规定的其他文件

## 12.2 存放地点

天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层

## 12.3 查阅方式

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

公司网站：[www.thfund.com.cn](http://www.thfund.com.cn)

天弘基金管理有限公司  
二〇二三年八月三十一日