

天弘中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

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	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	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
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	15
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	15
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	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 净资产（基金净值）变动表	19
6.4 报表附注	22
§7 投资组合报告	47
7.1 期末基金资产组合情况	47
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	47
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	64
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	66
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	67
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	67
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	67
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	67
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	67
7.11 本基金投资股指期货的投资政策	68
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	68
7.13 投资组合报告附注	68
§8 基金份额持有人信息	69
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	69

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	70
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.....	70
§9 开放式基金份额变动.....	70
§10 重大事件揭示.....	71
10.1 基金份额持有人大会决议.....	71
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.....	71
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	71
10.4 基金投资策略的改变.....	71
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	71
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.....	71
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	71
10.8 其他重大事件.....	74
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	74
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.....	74
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	74
§12 备查文件目录.....	75
12.1 备查文件目录.....	75
12.2 存放地点.....	75
12.3 查阅方式.....	75

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金	
基金简称	天弘中证500ETF联接	
基金主代码	000962	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年01月20日	
基金管理人	天弘基金管理有限公司	
基金托管人	国泰君安证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,103,887,850.13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500ETF联接 A	天弘中证500ETF联接 C
下属分级基金的交易代码	000962	005919
报告期末下属分级基金的份额总额	1,392,184,296.50份	711,703,553.63份

2.1.1 目标基金基本情况

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

2.2 基金产品说明

投资目标	通过投资于目标ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为目标ETF的联接基金，目标ETF是采用完全

	复制法实现对标的指数紧密跟踪的全被动指数基金。本基金通过把全部或接近全部的基金资产投资于目标ETF、标的指数成份股和备选成份股进行被动式指数化投资，实现对业绩比较基准的紧密跟踪。正常情况下，本基金投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%，日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人将采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。
业绩比较基准	中证500指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

2.2.1 目标基金产品说明

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

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		天弘基金管理有限公司	国泰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	证券日报
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	基金管理人及基金托管人的办公地址

点	
---	--

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500ETF联接A	天弘中证500ETF联接C
本期已实现收益	-6,254.58	-867,506.44
本期利润	57,518,249.78	35,897,889.64
加权平均基金份额本期利润	0.0411	0.0499
本期加权平均净值利润率	3.53%	4.22%
本期基金份额净值增长率	3.45%	3.36%
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	-30,383,046.37	111,421,667.63
期末可供分配基金份额利润	-0.0218	0.1566
期末基金资产净值	1,587,419,579.35	823,125,221.26
期末基金份额净值	1.1402	1.1566
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	14.02%	15.66%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

天弘中证500ETF联接A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.05%	0.89%	-0.77%	0.89%	0.72%	0.00%
过去三个月	-3.93%	0.78%	-5.10%	0.78%	1.17%	0.00%
过去六个月	3.45%	0.75%	2.20%	0.75%	1.25%	0.00%
过去一年	-4.65%	0.91%	-6.65%	0.91%	2.00%	0.00%
过去三年	12.01%	1.12%	2.48%	1.13%	9.53%	-0.01%
自基金合同生效日起至 今	14.02%	1.57%	14.54%	1.55%	-0.52%	0.02%

天弘中证500ETF联接C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.06%	0.89%	-0.77%	0.89%	0.71%	0.00%
过去三个月	-3.97%	0.78%	-5.10%	0.78%	1.13%	0.00%
过去六个月	3.36%	0.75%	2.20%	0.75%	1.16%	0.00%
过去一年	-4.83%	0.91%	-6.65%	0.91%	1.82%	0.00%
过去三年	11.36%	1.12%	2.48%	1.13%	8.88%	-0.01%
自基金份额首次确认日	15.66%	1.28%	1.32%	1.29%	14.34%	-0.01%

起至今						
-----	--	--	--	--	--	--

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

天弘中证500ETF联接A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2015年01月20日-2023年06月30日)



天弘中证500ETF联接C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2018年04月25日-2023年06月30日)



- 注：1、本基金合同于2015年01月20日生效。
2、本报告期内，本基金的各项投资比例达到基金合同约定的各项比例要求。
3、本基金自2018年04月24日起增设天弘中证500ETF联接C基金份额。天弘中证500ETF联接C基金份额的首次确认日为2018年04月25日。

§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		
陈瑶	本基金基金经理	2020年08月	-	12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。
--	--	--	--	--	-------

注：1、上述任职日期/离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金按照国家法律法规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

本基金由原天弘中证500指数型发起式证券投资基金转型而来。

截至本报告期末，本基金主要持有天弘中证500ETF及指数成分股，仍采用被动复制策略，其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，保证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，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2023年06月30日，天弘中证500ETF联接A基金份额净值为1.1402元，天弘中证500ETF联接C基金份额净值为1.1566元。报告期内份额净值增长率天弘中证500ETF联接A为3.45%，同期业绩比较基准增长率为2.20%；天弘中证500ETF联接C为3.36%，同期业绩比较基准增长率为2.20%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今年上半年股票市场在两重预期差中展开弱势震荡行情。一重预期差是经济修复的预期差，1季度股票市场在强政策刺激下对经济强修复的预期走高，但随着经济数据的验证，经济修复预期收敛，股票市场开始回调。另一重预期差是，在经济数据不及预期，需求未见明显修复的情形下，市场对稳增长政策加码的预期增强，但由于政策的定力超预期，市场陷入悲观情形，2季度股票市场继续走弱。上半年，股票市场以中特估、AI的主题投资机会为主，缺乏可扩散的投资主线，也侧面反映出市场的悲观情绪，风险偏好收敛到相对确定的主题投资板块。期间由于预期的摆动，股票市场中成长、顺周期板块来回震荡，快速切换，总体操作难度加大。汇率方面也有所反应。今年上半年人民币汇率面临贬值压力，我们认为人民币汇率的贬值压力主要反映的是对国内经济修复的悲观情绪。

进入下半年，我们认为下半年股票市场下跌空间较为有限，同时存在行情演绎的可能契机。一方面股票市场由于悲观情绪已经有了明显的回调，部分板块甚至回落到去年10月底的市场低点附近。从宏观环境上比较，去年10月底处于市场极度悲观，地产政策

和疫情防控政策未放松优化的状态；而今年经济尽管修复的节奏较慢，但总体仍在修复，地产风险有所化解，同比GDP经济增速增长；另一方面汇率也已经逼近7.3的关口，不排除后续可能出台维持人民币汇率稳定的举措，当前人民币汇率已经兑现了对经济和政策力度悲观的预期，我们认为人民币汇率不具备继续大幅贬值的基础。除此之外，7月再次迎来政策窗口期，不排除若有较为积极的超预期政策出台，那么市场可能迎来一波风险偏好修复的反弹行情。并且下半年的经济内在修复动能如果持续显现，那么也将有利于缓解及逆转当前的悲观情绪。

从中长期看，我们仍然看好中长期股票市场的表现。当前股票市场的底部区域特征还是较为明确的，一来政策底的信号已经明确。另一方面，近几年来，股票市场多轮下探已经对底部进行了多次试探。虽然经济底还尚未确认，宏观经济层面仍然存在一些不确定因素，包括宏观经济增长压力、外需可能回落、地缘政治风险等等，但无疑当前的指数点位也处于较低位置。因此中长期我们可以对中国经济的修复以及股票市场的表现更加乐观一些。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

报告期内，本基金管理人未与任何第三方签订与估值相关的定价服务协议。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内本基金管理人无应说明预警信息。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，国泰君安证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，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500交易型开放式指数证券投资基金联接基金

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
资产：			
银行存款	6.4.7.1	126,230,620.88	131,433,928.90
结算备付金		249,599.33	1,392,560.68

存出保证金		211,308.40	206,355.19
交易性金融资产	6.4.7.2	2,284,292,614.81	2,339,255,307.44
其中：股票投资		101,976,734.70	100,385,189.28
基金投资		2,181,810,283.81	2,238,837,656.28
债券投资		505,596.30	32,461.88
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		-	4,641.00
应收股利		-	-
应收申购款		3,081,288.77	3,940,855.39
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		2,414,065,432.19	2,476,233,648.60
负债和净资产	附注号	本期末 2023年06月30日	上年度末 2022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		0.18	3,363,559.25
应付赎回款		3,145,896.53	3,289,698.11
应付管理人报酬		86,398.19	98,721.22
应付托管费		17,279.65	19,744.28
应付销售服务费		134,288.15	150,644.48
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	0.30
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	136,768.88	238,571.21
负债合计		3,520,631.58	7,160,938.85
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	2,103,887,850.13	2,228,020,776.65
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	306,656,950.48	241,051,933.10
净资产合计		2,410,544,800.61	2,469,072,709.75
负债和净资产总计		2,414,065,432.19	2,476,233,648.60

注：报告截止日2023年06月30日，天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金A类基金份额净值1.1402元，天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金C类基金份额净值1.1566元；基金份额总额2,103,887,850.13份，其中天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金A类基金份额1,392,184,296.50份，天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金C类基金份额711,703,553.63份。

6.2 利润表

会计主体：天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：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		94,989,015.80	-245,750,341.11
1.利息收入		1,045,631.99	1,050,213.57

其中：存款利息收入	6.4.7.9	1,045,631.99	1,050,213.57
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）		-379,839.02	-10,733,980.94
其中：股票投资收益	6.4.7.10	121,958.35	-14,238,037.03
基金投资收益	6.4.7.11	-1,516,523.66	2,520,731.67
债券投资收益	6.4.7.12	25,459.92	15,383.38
资产支持证券投资	6.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	989,266.37	967,941.04
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）	6.4.7.17	94,289,900.44	-236,182,770.11
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	33,322.39	116,196.37
减：二、营业总支出		1,572,876.38	1,602,587.37
1. 管理人报酬		515,359.40	547,441.33
2. 托管费		103,071.93	109,488.29
3. 销售服务费		845,322.21	836,561.74

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		-	0.07
8. 其他费用	6.4.7.20	109,122.84	109,095.94
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		93,416,139.42	-247,352,928.48
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		93,416,139.42	-247,352,928.48
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		93,416,139.42	-247,352,928.48

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：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）	2,228,020,776.65	-	241,051,933.10	2,469,072,709.75
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净	2,228,020,776.6	-	241,051,933.10	2,469,072,709.7

资产（基金净值）	5			5
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-124,132,926.52	-	65,605,017.38	-58,527,909.14
（一）、综合收益总额	-	-	93,416,139.42	93,416,139.42
（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）	-124,132,926.52	-	-27,811,122.04	-151,944,048.56
其中：1.基金申购款	461,010,102.98	-	79,150,651.14	540,160,754.12
2.基金赎回款	-585,143,029.50	-	-106,961,773.18	-692,104,802.68
（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）	2,103,887,850.13	-	306,656,950.48	2,410,544,800.61
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	1,839,925,790.1	-	632,275,291.65	2,472,201,081.7

资产（基金净值）	1			6
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）	1,839,925,790.11	-	632,275,291.65	2,472,201,081.76
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	273,185,302.54	-	-204,355,461.21	68,829,841.33
（一）、综合收益总额	-	-	-247,352,928.48	-247,352,928.48
（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）	273,185,302.54	-	42,997,467.27	316,182,769.81
其中：1.基金申购款	1,153,209,335.98	-	206,964,095.48	1,360,173,431.46
2.基金赎回款	-880,024,033.44	-	-163,966,628.21	-1,043,990,661.65
（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）	2,113,111,092.65	-	427,919,830.44	2,541,030,923.09

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500交易型开放式指数证券投资基金联接基金系由原天弘中证500指数型发起式证券投资基金(以下简称“原基金”)转型而来。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。

根据基金管理人天弘基金管理有限公司于2020年8月8日发布《关于天弘中证500指数型发起式证券投资基金变更为天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金并相应修订基金合同的公告》，原天弘中证500指数型发起式证券投资基金变更为天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金。《天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》及其他法律文件自2020年8月8日起生效，原《天弘中证500指数型发起式证券投资基金基金合同》同日起失效。

根据《天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》和《天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》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。在投资人申购时不收取申购费、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。

本基金为天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“目标ETF”)的联接基金。目标ETF是采用完全复制法实现对中证500指数紧密跟踪的被动指数基金，本基金主要通过投资于目标ETF实现对业绩比较基准的紧密跟踪，力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》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，以目标ETF、标的指数成份股以及备选成份股为主要投资对象。为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于其他股票(非标的指数成份股及其备选成份股，含中小板、创业板及其他经中国证监会核准的上市股票)、存托凭证、银行存款、债券、债券回购、权证、股指期货、资产支持证券、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金投资于目标ETF的资产比例不低于基金资产的90%(已申购但尚未确认的目标ETF份额可计入在内)；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。本基金的业绩比较基准：中证500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500交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》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		126,230,620.88
等于：本金		126,174,000.18
加：应计利息		56,620.70
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		126,230,620.88

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	103,908,741.10	-	101,976,734.70	-1,932,006.40
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债 交易所市场	498,430.00	5,696.30	505,596.30	1,470.00

券	银行间市场	-	-	-	-
	合计	498,430.00	5,696.30	505,596.30	1,470.00
资产支持证券		-	-	-	-
基金		2,282,947,232.3 2	-	2,181,810,283.8 1	-101,136,948.51
其他		-	-	-	-
合计		2,387,354,403.4 2	5,696.30	2,284,292,614.8 1	-103,067,484.91

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

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

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	699.85
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	26,973.09
其中：交易所市场	26,973.09
银行间市场	-

应付利息	-
预提费用	109,095.94
合计	136,768.88

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 天弘中证500ETF联接A

金额单位：人民币元

项目 (天弘中证500ETF联接A)	本期 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	1,431,022,087.40	1,431,022,087.40
本期申购	193,452,626.00	193,452,626.00
本期赎回（以“-”号填列）	-232,290,416.90	-232,290,416.90
本期末	1,392,184,296.50	1,392,184,296.50

6.4.7.7.2 天弘中证500ETF联接C

金额单位：人民币元

项目 (天弘中证500ETF联接C)	本期 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	796,998,689.25	796,998,689.25
本期申购	267,557,476.98	267,557,476.98
本期赎回（以“-”号填列）	-352,852,612.60	-352,852,612.60
本期末	711,703,553.63	711,703,553.63

注：申购含转换转入份额；赎回含转换转出份额。

6.4.7.8 未分配利润

6.4.7.8.1 天弘中证500ETF联接A

单位：人民币元

项目 (天弘中证500ETF联接A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计

本期期初	-31,234,206.69	177,415,462.32	146,181,255.63
本期利润	-6,254.58	57,524,504.36	57,518,249.78
本期基金份额交易产生的变动数	857,414.90	-9,321,637.46	-8,464,222.56
其中：基金申购款	-4,234,019.59	35,796,711.64	31,562,692.05
基金赎回款	5,091,434.49	-45,118,349.10	-40,026,914.61
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-30,383,046.37	225,618,329.22	195,235,282.85

6.4.7.8.2 天弘中证500ETF联接C

单位：人民币元

项目 (天弘中证500ETF联接C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	233,101,428.39	-138,230,750.92	94,870,677.47
本期利润	-867,506.44	36,765,396.08	35,897,889.64
本期基金份额交易产生的变动数	-24,911,354.44	5,564,454.96	-19,346,899.48
其中：基金申购款	78,076,668.16	-30,488,709.07	47,587,959.09
基金赎回款	-102,988,022.60	36,053,164.03	-66,934,858.57
本期已分配利润	-	-	-
本期末	207,322,567.51	-95,900,899.88	111,421,667.63

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	1,041,973.85
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	1,822.55
其他	1,835.59

合计	1,045,631.99
----	--------------

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 2023年01月01日至2023年06月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	121,958.35
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	121,958.35

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 2023年01月01日至2023年06月30日
卖出股票成交总额	70,087,213.81
减：卖出股票成本总额	69,836,761.97
减：交易费用	128,493.49
买卖股票差价收入	121,958.35

6.4.7.11 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2023年01月01日至2023年06月30日
卖出/赎回基金成交总额	198,507,259.90
减：卖出/赎回基金成本总额	200,014,854.46
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	-
减：交易费用	8,929.10
基金投资收益	-1,516,523.66

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 2023年01月01日至2023年06月30日
债券投资收益——利息收入	16,236.17
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	9,223.75
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	25,459.92

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 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	3,914,773.52
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	3,831,818.00
减：应计利息总额	73,730.12
减：交易费用	1.65
买卖债券差价收入	9,223.75

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 2023年01月01日至2023年06月30日
股票投资产生的股利收益	989,266.37
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	989,266.37

6.4.7.17 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	94,289,900.44
——股票投资	3,777,213.29
——债券投资	2,010.40
——资产支持证券投资	-
——基金投资	90,510,676.75
——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	94,289,900.44
----	---------------

6.4.7.18 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	32,369.91
基金转换费收入	952.48
合计	33,322.39

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 2023年01月01日至2023年06月30日
审计费用	49,588.57
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
存托服务费	26.90
合计	109,122.84

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	12,130,761.89	10.17%	-	-

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 佣金总 量的比 例	期末应付佣金余额	占期末应 付佣金总 额的比例
国泰君安	2,807.71	5.73%	-	-

证券股份 有限公司				
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202 3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
当期发生的基金应支付的管理费	515,359.40	547,441.33
其中: 支付销售机构的客户维护费	2,349,195.42	2,216,992.66

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)0.50%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-前一日所持有目标ETF基金份额部分的基金资产)×该日适用费率/当年天数。

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位: 人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2023年01月01日至2023年06月30日	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	103,071.93	109,488.29

注:本基金基金财产中投资于目标ETF的部分不收取托管费,支付基金托管人国泰君安证券股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值扣除所持有目标ETF基金份额部分的基金资产后的余额(若为负数,则取0)0.10%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日托管费=(前一日基金资产净值-前一日所持有目标ETF基金份额部分的基金资产)×该日适用费率/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	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500ETF联接A	天弘中证500ETF联接C	合计
天弘基金管理有限公司	-	6,447.12	6,447.12
国泰君安证券股份有限公司	-	71.03	71.03
合计	-	6,518.15	6,518.15
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500ETF联接A	天弘中证500ETF联接C	合计
天弘基金管理有限公司	-	6,097.84	6,097.84
国泰君安证券股份有限公司	-	94.38	94.38

合计	-	6,192.22	6,192.22
----	---	----------	----------

注：1、支付基金销售机构的销售服务费按前一日各级基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给天弘基金管理有限公司，再由天弘基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。天弘中证500ETF联接C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500ETF联接A不收取销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

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	126,230,620.88	1,041,973.85	132,086,877.29	1,035,694.91
----------------------	----------------	--------------	----------------	--------------

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
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
国泰君安 证券股份 有限公司	301217	铜冠铜箔	网下申购	42,831	739,691.37
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

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2,233,173,269.00份目标ETF基金份额（上年度末：2,375,424,569.00份），占其总份额的比例为95.79%（上年度末：95.92%）。

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

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

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	10,500	64,585.76	73,185.00	-

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，将风险控制可在可承受的范围内。

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，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	505,596.30	-
合计	505,596.30	-

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 2023年06月30日	上年度末 2022年12月31日
AAA	-	13,461.63
AAA以下	-	19,000.25
未评级	-	-
合计	-	32,461.88

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期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的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 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	126,230,620.88	-	-	-	126,230,620.88
结算备付金	249,599.33	-	-	-	249,599.33
存出保证金	211,308.40	-	-	-	211,308.40
交易性金融资产	505,596.30	-	-	2,283,787,018.51	2,284,292,614.81
应收申购款	-	-	-	3,081,288.77	3,081,288.77
资产总计	127,197,124.91	-	-	2,286,868,307.28	2,414,065,432.19
负债					
应付清算款	-	-	-	0.18	0.18
应付赎回款	-	-	-	3,145,896.53	3,145,896.53
应付管理人报酬	-	-	-	86,398.19	86,398.19
应付托管费	-	-	-	17,279.65	17,279.65
应付销售服务费	-	-	-	134,288.15	134,288.15
其他负债	-	-	-	136,768.88	136,768.88
负债总计	-	-	-	3,520,631.58	3,520,631.58
利率敏感度缺口	127,197,124.91	-	-	2,283,347,675.70	2,410,544,800.69

	91			70	61
上年度末 2022 年 12 月 31 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	131,433,928.90	-	-	-	131,433,928.90
结算备付金	1,392,560.68	-	-	-	1,392,560.68
存出保证金	206,355.19	-	-	-	206,355.19
交易性金融资产	-	-	32,461.88	2,339,222,845.56	2,339,255,307.44
应收清算款	-	-	-	4,641.00	4,641.00
应收申购款	-	-	-	3,940,855.39	3,940,855.39
资产总计	133,032,844.77	-	32,461.88	2,343,168,341.95	2,476,233,648.60
负债					
应付清算款	-	-	-	3,363,559.25	3,363,559.25
应付赎回款	-	-	-	3,289,698.11	3,289,698.11
应付管理人报酬	-	-	-	98,721.22	98,721.22
应付托管费	-	-	-	19,744.28	19,744.28
应付销售服务费	-	-	-	150,644.48	150,644.48
应交税费	-	-	-	0.30	0.30
其他负债	-	-	-	238,571.21	238,571.21
负债总计	-	-	-	7,160,938.85	7,160,938.85
利率敏感度缺口	133,032,844.77	-	32,461.88	2,336,007,403.10	2,469,072,709.75

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0.02%(2022年12月31日：0.00%)，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。

本基金原则上采用完全复制法，跟踪中证500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 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	101,976,734.70	4.23	100,385,189.28	4.07
交易性金融资产—基金投资	2,181,810,283.81	90.51	2,238,837,656.28	90.68
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	2,283,787,018.51	94.74	2,339,222,845.56	94.74

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	上年度末

		2023年06月30日	2022年12月31日
	业绩比较基准上升5%	119,936,656.55	122,466,006.40
	业绩比较基准下降5%	-119,936,656.55	-122,466,006.40

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	2,283,713,833.51	2,338,858,340.19
第二层次	578,781.30	396,967.25
第三层次	-	-
合计	2,284,292,614.81	2,339,255,307.44

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；对于定期开放的基金投资，本基金不会于封闭期将相关基金列入第一层次；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、债券和基金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	101,976,734.70	4.22
	其中：股票	101,976,734.70	4.22
2	基金投资	2,181,810,283.81	90.38
3	固定收益投资	505,596.30	0.02
	其中：债券	505,596.30	0.02
	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	126,480,220.21	5.24
8	其他各项资产	3,292,597.17	0.14
9	合计	2,414,065,432.19	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	717,588.00	0.03

B	采矿业	3,758,617.22	0.16
C	制造业	63,755,997.08	2.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,527,552.60	0.15
E	建筑业	1,133,542.00	0.05
F	批发和零售业	3,226,746.82	0.13
G	交通运输、仓储和邮政业	1,532,498.00	0.06
H	住宿和餐饮业	191,395.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	8,512,970.43	0.35
J	金融业	8,771,034.97	0.36
K	房地产业	1,392,036.64	0.06
L	租赁和商务服务业	1,256,643.00	0.05
M	科学研究和技术服务业	1,141,295.78	0.05
N	水利、环境和公共设施管理业	566,926.92	0.02
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	511,067.84	0.02
R	文化、体育和娱乐业	1,440,330.00	0.06
S	综合	540,492.40	0.02
	合计	101,976,734.70	4.23

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	9,600	1,415,520.00	0.06
2	688256	寒武纪	3,149	592,012.00	0.02
3	000988	华工科技	15,301	581,591.01	0.02
4	002384	东山精密	20,800	538,720.00	0.02
5	002340	格林美	77,800	537,598.00	0.02
6	002422	科伦药业	17,800	528,304.00	0.02

7	600372	中航电子	34,000	516,120.00	0.02
8	300418	昆仑万维	12,706	511,797.68	0.02
9	300012	华测检测	25,500	497,250.00	0.02
10	600157	永泰能源	337,000	478,540.00	0.02
11	600079	人福医药	17,300	466,062.00	0.02
12	300724	捷佳伟创	4,100	460,635.00	0.02
13	600489	中金黄金	44,000	454,520.00	0.02
14	688777	中控技术	7,187	451,199.86	0.02
15	300003	乐普医疗	19,900	449,939.00	0.02
16	600487	亨通光电	29,900	438,334.00	0.02
17	002028	思源电气	9,317	435,290.24	0.02
18	002738	中矿资源	8,460	430,952.40	0.02
19	601058	赛轮轮胎	37,300	424,847.00	0.02
20	601555	东吴证券	60,650	420,911.00	0.02
21	600536	中国软件	8,916	417,982.08	0.02
22	002463	沪电股份	19,700	412,518.00	0.02
23	600765	中航重机	15,320	406,133.20	0.02
24	300037	新宙邦	7,820	405,779.80	0.02
25	600885	宏发股份	12,680	403,858.00	0.02
26	000807	云铝股份	31,379	399,454.67	0.02
27	603444	吉比特	800	392,888.00	0.02
28	000066	中国长城	28,400	392,772.00	0.02
29	600482	中国动力	16,300	382,072.00	0.02
30	000009	中国宝安	31,220	376,825.40	0.02
31	300146	汤臣倍健	15,400	369,292.00	0.02
32	600352	浙江龙盛	39,300	367,455.00	0.02
33	300058	蓝色光标	37,800	365,526.00	0.02
34	002966	苏州银行	55,490	363,459.50	0.02
35	000423	东阿阿胶	6,700	358,115.00	0.01
36	688099	晶晨股份	4,230	356,673.60	0.01
37	601108	财通证券	49,200	356,208.00	0.01

38	002185	华天科技	38,700	356,040.00	0.01
39	600415	小商品城	41,400	353,142.00	0.01
40	002156	通富微电	15,600	352,560.00	0.01
41	002624	完美世界	20,600	347,934.00	0.01
42	002625	光启技术	22,800	347,928.00	0.01
43	600027	华电国际	51,800	346,542.00	0.01
44	000783	长江证券	58,700	340,460.00	0.01
45	600161	天坛生物	12,400	336,660.00	0.01
46	601233	桐昆股份	25,400	336,550.00	0.01
47	601077	渝农商行	93,500	335,665.00	0.01
48	600418	江淮汽车	26,500	333,635.00	0.01
49	300144	宋城演艺	26,900	333,560.00	0.01
50	600109	国金证券	38,300	332,061.00	0.01
51	300285	国瓷材料	12,100	331,540.00	0.01
52	600096	云天化	19,400	331,158.00	0.01
53	002385	大北农	50,100	330,660.00	0.01
54	600988	赤峰黄金	24,500	329,770.00	0.01
55	002409	雅克科技	4,500	327,960.00	0.01
56	002223	鱼跃医疗	9,090	327,149.10	0.01
57	300568	星源材质	18,800	323,172.00	0.01
58	600298	安琪酵母	8,900	322,269.00	0.01
59	002008	大族激光	12,300	322,260.00	0.01
60	000630	铜陵有色	111,200	321,368.00	0.01
61	002407	多氟多	16,120	320,143.20	0.01
62	600862	中航高科	12,600	318,906.00	0.01
63	603688	石英股份	2,800	318,752.00	0.01
64	603882	金域医学	4,200	317,100.00	0.01
65	300024	机器人	18,885	314,812.95	0.01
66	601162	天风证券	105,000	312,900.00	0.01
67	002497	雅化集团	17,500	311,150.00	0.01
68	300390	天华新能	8,610	308,238.00	0.01

69	600705	中航产融	80,200	307,166.00	0.01
70	601168	西部矿业	28,900	303,739.00	0.01
71	300073	当升科技	6,000	301,980.00	0.01
72	300474	景嘉微	3,350	301,466.50	0.01
73	002439	启明星辰	10,100	300,576.00	0.01
74	002240	盛新锂能	9,400	299,578.00	0.01
75	300604	长川科技	6,300	299,187.00	0.01
76	000933	神火股份	23,000	299,000.00	0.01
77	000932	华菱钢铁	62,680	298,983.60	0.01
78	600060	海信视像	12,000	297,000.00	0.01
79	000975	银泰黄金	25,347	296,559.90	0.01
80	600066	宇通客车	20,100	296,274.00	0.01
81	605358	立昂微	8,000	293,840.00	0.01
82	603596	伯特利	3,700	293,262.00	0.01
83	300136	信维通信	14,600	293,168.00	0.01
84	002138	顺络电子	12,200	291,702.00	0.01
85	002797	第一创业	50,900	291,148.00	0.01
86	300395	菲利华	5,900	290,280.00	0.01
87	002465	海格通信	28,000	289,520.00	0.01
88	002568	百润股份	7,900	287,165.00	0.01
89	002600	领益智造	41,300	285,383.00	0.01
90	601128	常熟银行	41,500	283,030.00	0.01
91	600160	巨化股份	20,500	282,490.00	0.01
92	603816	顾家家居	7,400	282,310.00	0.01
93	600839	四川长虹	55,900	282,295.00	0.01
94	000021	深科技	14,108	282,018.92	0.01
95	300253	卫宁健康	26,000	281,320.00	0.01
96	300866	安克创新	3,200	280,000.00	0.01
97	603939	益丰药房	7,560	279,720.00	0.01
98	600879	航天电子	32,900	279,321.00	0.01
99	600873	梅花生物	31,200	278,616.00	0.01

100	300832	新产业	4,700	277,300.00	0.01
101	688072	拓荆科技	648	276,028.56	0.01
102	000683	远兴能源	38,300	275,377.00	0.01
103	600563	法拉电子	2,000	274,600.00	0.01
104	601990	南京证券	33,400	273,212.00	0.01
105	000591	太阳能	40,200	272,556.00	0.01
106	688521	芯原股份	3,782	272,001.44	0.01
107	600392	盛和资源	21,100	271,557.00	0.01
108	600497	XD驰宏锌	53,900	270,578.00	0.01
109	002078	太阳纸业	25,292	270,371.48	0.01
110	688567	孚能科技	12,513	270,155.67	0.01
111	601696	中银证券	25,200	268,632.00	0.01
112	002368	太极股份	6,497	267,481.49	0.01
113	603589	口子窖	5,400	266,490.00	0.01
114	600177	雅戈尔	42,000	265,020.00	0.01
115	300699	光威复材	8,580	264,693.00	0.01
116	002850	科达利	2,000	264,500.00	0.01
117	000729	燕京啤酒	21,200	264,364.00	0.01
118	000831	中国稀土	8,900	263,440.00	0.01
119	300017	网宿科技	36,900	262,359.00	0.01
120	600642	申能股份	37,200	260,028.00	0.01
121	600141	兴发集团	11,700	259,974.00	0.01
122	600699	均胜电子	14,700	259,308.00	0.01
123	002294	信立泰	8,300	258,877.00	0.01
124	000728	国元证券	39,700	258,844.00	0.01
125	002673	西部证券	40,500	257,175.00	0.01
126	300118	东方日升	10,000	256,300.00	0.01
127	600516	方大炭素	41,300	256,060.00	0.01
128	002025	航天电器	4,000	255,200.00	0.01
129	000629	钒钛股份	65,000	254,150.00	0.01
130	002195	二三四五	86,967	251,334.63	0.01

131	600325	华发股份	25,500	251,175.00	0.01
132	600118	中国卫星	8,900	251,069.00	0.01
133	002273	水晶光电	21,002	250,763.88	0.01
134	600153	建发股份	22,800	248,748.00	0.01
135	600521	华海药业	13,500	248,535.00	0.01
136	600166	福田汽车	72,900	247,860.00	0.01
137	002430	杭氧股份	7,200	247,392.00	0.01
138	002268	电科网安	8,869	247,179.03	0.01
139	000400	许继电气	10,700	246,635.00	0.01
140	600170	上海建工	91,200	245,328.00	0.01
141	600143	金发科技	28,100	245,313.00	0.01
142	603000	人民网	8,400	245,280.00	0.01
143	002532	天山铝业	40,900	244,991.00	0.01
144	600399	抚顺特钢	23,900	243,780.00	0.01
145	600549	厦门钨业	12,800	243,584.00	0.01
146	688002	睿创微纳	5,430	243,264.00	0.01
147	600637	东方明珠	31,100	243,202.00	0.01
148	000998	隆平高科	15,800	242,530.00	0.01
149	601966	玲珑轮胎	10,900	242,198.00	0.01
150	002739	万达电影	19,300	242,022.00	0.01
151	000738	航发控制	9,900	241,560.00	0.01
152	689009	九号公司	6,521	240,298.85	0.01
153	002065	东华软件	34,000	240,040.00	0.01
154	600859	王府井	12,100	239,459.00	0.01
155	002372	伟星新材	11,620	238,674.80	0.01
156	300595	欧普康视	7,900	238,501.00	0.01
157	002444	巨星科技	10,840	237,179.20	0.01
158	688390	固德威	1,419	236,774.34	0.01
159	601577	长沙银行	30,500	236,680.00	0.01
160	600486	扬农化工	2,700	236,034.00	0.01
161	601198	东兴证券	29,400	235,788.00	0.01

162	000997	新大陆	12,450	235,305.00	0.01
163	002131	利欧股份	102,285	235,255.50	0.01
164	600499	科达制造	20,700	235,152.00	0.01
165	300383	光环新网	21,700	233,275.00	0.01
166	600704	物产中大	47,000	232,180.00	0.01
167	688220	翱捷科技	3,060	230,693.40	0.01
168	600481	双良节能	16,500	230,670.00	0.01
169	000960	锡业股份	14,797	230,093.35	0.01
170	600271	航天信息	16,800	229,992.00	0.01
171	688536	思瑞浦	1,053	229,554.00	0.01
172	000519	中兵红箭	12,647	228,784.23	0.01
173	300001	特锐德	10,989	228,351.42	0.01
174	601997	贵阳银行	44,200	228,072.00	0.01
175	002373	千方科技	16,697	227,747.08	0.01
176	688009	中国通号	39,160	227,128.00	0.01
177	603077	和邦生物	93,400	226,962.00	0.01
178	002056	横店东磁	12,460	226,896.60	0.01
179	300438	鹏辉能源	4,700	225,788.00	0.01
180	000703	恒逸石化	33,300	225,774.00	0.01
181	000623	吉林敖东	14,015	224,800.60	0.01
182	002281	光迅科技	6,056	224,617.04	0.01
183	002353	杰瑞股份	8,920	224,159.60	0.01
184	300088	长信科技	37,100	223,713.00	0.01
185	300682	朗新科技	9,600	223,488.00	0.01
186	600021	上海电力	20,700	222,939.00	0.01
187	002507	涪陵榨菜	12,157	222,594.67	0.01
188	300676	华大基因	3,700	221,963.00	0.01
189	300487	蓝晓科技	3,550	221,591.00	0.01
190	002152	广电运通	18,900	221,508.00	0.01
191	600380	健康元	17,400	221,154.00	0.01
192	600529	山东药玻	8,100	220,482.00	0.01

193	600867	通化东宝	21,100	220,284.00	0.01
194	600498	烽火通信	10,800	219,996.00	0.01
195	000513	丽珠集团	5,610	218,285.10	0.01
196	600998	九州通	21,009	218,073.42	0.01
197	600511	国药股份	5,600	217,560.00	0.01
198	600348	华阳股份	27,450	217,129.50	0.01
199	600546	山煤国际	15,000	217,050.00	0.01
200	601016	节能风电	59,120	216,970.40	0.01
201	002299	圣农发展	11,300	216,395.00	0.01
202	002203	海亮股份	18,000	216,180.00	0.01
203	603517	绝味食品	5,800	215,470.00	0.01
204	688516	奥特维	1,140	214,776.00	0.01
205	002595	豪迈科技	6,100	214,293.00	0.01
206	688169	石头科技	667	213,893.56	0.01
207	600739	辽宁成大	16,200	213,030.00	0.01
208	601636	旗滨集团	24,300	209,466.00	0.01
209	000636	风华高科	13,592	208,501.28	0.01
210	603712	七一二	6,900	208,449.00	0.01
211	603927	中科软	5,400	208,224.00	0.01
212	002080	中材科技	10,100	207,252.00	0.01
213	603338	浙江鼎力	3,700	207,237.00	0.01
214	002531	天顺风能	13,600	207,128.00	0.01
215	600863	内蒙华电	49,700	206,255.00	0.01
216	600580	卧龙电驱	14,100	206,001.00	0.01
217	300212	易华录	6,120	203,367.60	0.01
218	002092	中泰化学	31,443	202,807.35	0.01
219	600970	中材国际	15,900	202,725.00	0.01
220	300182	捷成股份	32,100	202,551.00	0.01
221	600655	豫园股份	29,500	202,370.00	0.01
222	688385	复旦微电	4,039	202,353.90	0.01
223	000878	云南铜业	18,200	201,110.00	0.01

224	002506	协鑫集成	68,600	200,998.00	0.01
225	002192	融捷股份	3,000	200,490.00	0.01
226	600820	隧道股份	33,300	200,133.00	0.01
227	300296	利亚德	30,600	199,818.00	0.01
228	688772	珠海冠宇	9,886	199,202.90	0.01
229	603885	吉祥航空	12,900	199,047.00	0.01
230	600909	华安证券	42,590	198,895.30	0.01
231	600528	中铁工业	20,100	198,588.00	0.01
232	002926	华西证券	23,800	197,778.00	0.01
233	603737	三棵树	3,020	197,568.40	0.01
234	600329	达仁堂	4,400	197,516.00	0.01
235	600535	天士力	13,600	197,336.00	0.01
236	002683	广东宏大	6,700	197,248.00	0.01
237	002432	九安医疗	5,600	197,176.00	0.01
238	688188	柏楚电子	1,041	196,290.96	0.01
239	300244	迪安诊断	7,568	193,967.84	0.01
240	000547	航天发展	19,330	193,300.00	0.01
241	000750	国海证券	57,670	193,194.50	0.01
242	603156	养元饮品	7,800	192,660.00	0.01
243	600008	首创环保	66,720	192,153.60	0.01
244	000039	中集集团	27,859	191,948.51	0.01
245	002939	长城证券	23,600	191,868.00	0.01
246	300748	金力永磁	6,400	191,488.00	0.01
247	600258	首旅酒店	10,100	191,395.00	0.01
248	603233	大参林	6,740	188,787.40	0.01
249	002429	兆驰股份	34,300	188,650.00	0.01
250	000970	中科三环	14,715	188,646.30	0.01
251	000893	亚钾国际	8,200	188,108.00	0.01
252	000060	中金岭南	39,600	188,100.00	0.01
253	002557	洽洽食品	4,500	186,975.00	0.01
254	603160	汇顶科技	4,000	185,000.00	0.01

255	000830	鲁西化工	17,400	183,744.00	0.01
256	600369	西南证券	50,300	183,595.00	0.01
257	600390	五矿资本	34,100	183,458.00	0.01
258	603456	九洲药业	6,700	183,446.00	0.01
259	600416	湘电股份	9,600	183,264.00	0.01
260	300558	贝达药业	3,800	182,514.00	0.01
261	002500	山西证券	32,640	182,131.20	0.01
262	688200	华峰测控	1,188	181,764.00	0.01
263	600435	XD北方导	15,800	181,542.00	0.01
264	601991	大唐发电	54,700	181,057.00	0.01
265	600398	海澜之家	26,100	179,568.00	0.01
266	002508	老板电器	7,100	179,559.00	0.01
267	002936	郑州银行	77,854	179,064.20	0.01
268	002128	电投能源	13,530	178,866.60	0.01
269	601880	辽港股份	114,300	178,308.00	0.01
270	300009	安科生物	17,807	178,070.00	0.01
271	688301	奕瑞科技	626	176,801.18	0.01
272	300070	碧水源	32,900	176,344.00	0.01
273	002153	石基信息	12,592	176,288.00	0.01
274	603658	安图生物	3,400	175,882.00	0.01
275	600038	中直股份	4,400	175,208.00	0.01
276	601717	郑煤机	14,056	174,997.20	0.01
277	603893	瑞芯微	2,400	174,840.00	0.01
278	600848	上海临港	14,500	173,275.00	0.01
279	300026	红日药业	31,895	172,870.90	0.01
280	600985	淮北矿业	15,000	172,800.00	0.01
281	603858	步长制药	8,300	170,897.00	0.01
282	000050	深天马 A	18,500	169,830.00	0.01
283	002572	索菲亚	9,721	169,339.82	0.01
284	601179	中国西电	31,000	167,710.00	0.01
285	300373	扬杰科技	4,100	166,337.00	0.01

286	002244	滨江集团	18,800	165,816.00	0.01
287	300529	健帆生物	7,100	164,578.00	0.01
288	002408	齐翔腾达	25,797	164,326.89	0.01
289	601456	国联证券	18,000	163,800.00	0.01
290	600673	东阳光	22,700	163,667.00	0.01
291	600895	张江高科	11,700	162,864.00	0.01
292	601958	金钼股份	14,600	162,790.00	0.01
293	600667	太极实业	22,400	162,624.00	0.01
294	603127	昭衍新药	3,960	161,964.00	0.01
295	600827	百联股份	12,100	161,777.00	0.01
296	002019	亿帆医药	11,016	160,833.60	0.01
297	600208	新湖中宝	64,600	160,208.00	0.01
297	002958	青农商行	58,900	160,208.00	0.01
298	600566	济川药业	5,500	159,720.00	0.01
299	688779	长远锂科	14,154	159,515.58	0.01
300	002266	浙富控股	38,544	159,186.72	0.01
301	003035	南网能源	22,300	158,776.00	0.01
302	600171	上海贝岭	8,700	158,775.00	0.01
303	601000	唐山港	44,900	158,497.00	0.01
304	000155	川能动力	11,000	158,400.00	0.01
305	601666	平煤股份	21,000	158,340.00	0.01
306	600282	南钢股份	46,700	157,379.00	0.01
307	603267	鸿远电子	2,400	156,720.00	0.01
308	688538	和辉光电	61,688	156,687.52	0.01
309	000887	中鼎股份	11,946	156,373.14	0.01
310	000739	普洛药业	8,796	156,041.04	0.01
311	688116	天奈科技	3,404	155,733.00	0.01
312	600755	厦门国贸	20,100	155,574.00	0.01
313	300357	我武生物	4,600	154,698.00	0.01
314	600959	江苏有线	45,500	153,790.00	0.01
315	002155	湖南黄金	12,604	153,768.80	0.01

316	002670	国盛金控	17,459	153,290.02	0.01
317	300115	长盈精密	12,849	153,031.59	0.01
318	600316	洪都航空	6,500	152,425.00	0.01
319	300677	英科医疗	6,900	151,800.00	0.01
320	600378	昊华科技	4,000	150,560.00	0.01
321	601231	环旭电子	10,000	149,600.00	0.01
322	600315	上海家化	5,100	147,951.00	0.01
323	601866	中远海发	59,800	147,706.00	0.01
324	000778	新兴铸管	36,200	147,696.00	0.01
325	600517	XD国网英	25,900	147,630.00	0.01
326	002030	达安基因	14,803	147,585.91	0.01
327	600131	国网信通	7,300	147,387.00	0.01
328	000598	兴蓉环境	27,100	147,153.00	0.01
329	600056	中国医药	11,300	146,674.00	0.01
330	603218	日月股份	7,700	146,223.00	0.01
331	600582	天地科技	25,000	145,750.00	0.01
332	300363	博腾股份	4,900	144,991.00	0.01
333	002487	大金重工	4,700	144,948.00	0.01
334	300251	光线传媒	17,900	144,811.00	0.01
335	000987	越秀资本	22,765	144,557.75	0.01
336	002249	大洋电机	25,200	143,640.00	0.01
337	600598	北大荒	10,700	142,631.00	0.01
338	000027	深圳能源	21,640	142,607.60	0.01
339	603026	XD胜华新	2,400	142,200.00	0.01
340	002326	永太科技	9,300	142,197.00	0.01
341	601005	重庆钢铁	101,500	142,100.00	0.01
342	000709	河钢股份	62,700	141,702.00	0.01
343	600906	财达证券	19,600	141,120.00	0.01
344	688281	华秦科技	696	140,940.00	0.01
345	688082	盛美上海	1,267	139,876.80	0.01
346	002183	怡亚通	27,400	139,740.00	0.01

347	601106	中国一重	41,500	139,440.00	0.01
348	002221	东华能源	16,110	139,351.50	0.01
349	300888	稳健医疗	3,320	138,344.40	0.01
350	601992	金隅集团	63,100	137,558.00	0.01
351	600718	东软集团	12,900	137,514.00	0.01
352	600373	中文传媒	10,300	137,196.00	0.01
353	002690	美亚光电	5,323	137,067.25	0.01
354	000883	湖北能源	29,900	136,344.00	0.01
355	002831	裕同科技	5,584	136,193.76	0.01
356	601665	齐鲁银行	34,600	135,632.00	0.01
357	000825	太钢不锈	34,600	133,902.00	0.01
358	601778	晶科科技	27,100	133,874.00	0.01
359	002511	中顺洁柔	12,000	133,800.00	0.01
360	300776	帝尔激光	2,060	133,694.00	0.01
361	603568	伟明环保	7,620	133,426.20	0.01
362	601928	凤凰传媒	11,600	132,240.00	0.01
363	603883	老百姓	4,430	132,235.50	0.01
364	002518	科士达	3,300	132,033.00	0.01
365	600737	中粮糖业	16,300	131,215.00	0.01
366	603228	景旺电子	5,100	130,815.00	0.01
367	600967	内蒙一机	12,900	130,290.00	0.01
368	600663	陆家嘴	13,200	130,284.00	0.01
369	002985	北摩高科	2,941	129,756.92	0.01
370	600297	广汇汽车	61,600	128,128.00	0.01
371	600801	华新水泥	10,300	127,205.00	0.01
372	603225	新凤鸣	11,500	127,075.00	0.01
373	300861	美畅股份	2,900	125,773.00	0.01
374	601098	XD中南传	10,800	125,280.00	0.01
375	688208	道通科技	4,110	124,574.10	0.01
376	002468	申通快递	11,500	124,430.00	0.01
377	000012	南玻 A	20,693	123,330.28	0.01

378	002745	木林森	13,400	123,280.00	0.01
379	600155	华创云信	19,800	123,156.00	0.01
380	000156	华数传媒	14,100	122,670.00	0.01
381	600871	石化油服	61,900	122,562.00	0.01
382	603529	爱玛科技	3,800	122,436.00	0.01
383	688778	厦钨新能	2,473	122,413.50	0.01
384	600500	中化国际	21,700	120,652.00	0.01
385	000581	威孚高科	7,654	120,550.50	0.01
386	002867	周大生	6,725	119,570.50	0.00
387	001227	兰州银行	41,700	119,262.00	0.00
388	000401	冀东水泥	16,095	118,620.15	0.00
389	603866	桃李面包	11,662	118,019.44	0.00
390	301029	怡合达	2,640	117,955.20	0.00
391	688690	纳微科技	3,026	117,560.10	0.00
392	300482	万孚生物	4,410	117,438.30	0.00
393	002791	坚朗五金	1,800	116,478.00	0.00
394	002250	联化科技	11,100	116,106.00	0.00
395	601118	海南橡胶	25,900	116,032.00	0.00
396	000930	中粮科技	14,200	115,020.00	0.00
397	002032	苏泊尔	2,300	115,000.00	0.00
398	601611	中国核建	13,600	114,920.00	0.00
399	600022	山东钢铁	80,500	114,310.00	0.00
400	688276	百克生物	1,815	113,619.00	0.00
401	000785	居然之家	29,600	112,776.00	0.00
402	600556	天下秀	15,900	112,731.00	0.00
403	002010	传化智联	21,100	112,252.00	0.00
404	688520	神州细胞	1,977	112,174.98	0.00
405	688052	纳芯微	704	111,492.48	0.00
406	002423	中粮资本	13,900	111,200.00	0.00
407	601598	中国外运	23,800	110,908.00	0.00
408	601608	中信重工	26,300	110,723.00	0.00

409	688029	南微医学	1,348	109,942.88	0.00
410	002081	金螳螂	24,200	109,142.00	0.00
411	688006	杭可科技	3,563	108,564.61	0.00
412	000559	万向钱潮	19,900	108,455.00	0.00
413	300850	新强联	2,900	108,402.00	0.00
414	600597	光明乳业	10,400	108,160.00	0.00
415	600062	华润双鹤	6,200	108,004.00	0.00
416	600782	新钢股份	29,100	107,961.00	0.00
417	000089	深圳机场	15,500	107,725.00	0.00
418	002505	鹏都农牧	56,100	106,029.00	0.00
419	603638	艾迪精密	5,140	105,472.80	0.00
420	603826	坤彩科技	2,100	105,000.00	0.00
421	600259	广晟有色	2,900	104,806.00	0.00
422	600901	江苏金租	25,200	104,076.00	0.00
423	600707	彩虹股份	21,800	103,768.00	0.00
424	300618	寒锐钴业	3,200	103,712.00	0.00
425	000958	电投产融	23,800	103,054.00	0.00
426	600339	中油工程	25,300	102,971.00	0.00
427	000937	冀中能源	16,059	102,456.42	0.00
428	600409	三友化工	18,700	101,915.00	0.00
429	000898	鞍钢股份	36,300	100,914.00	0.00
430	600095	湘财股份	12,900	100,620.00	0.00
431	601187	厦门银行	19,900	99,898.00	0.00
432	002761	浙江建投	6,500	98,670.00	0.00
433	601718	际华集团	33,200	98,604.00	0.00
434	600507	方大特钢	21,200	98,156.00	0.00
435	000537	广宇发展	8,400	98,028.00	0.00
436	000967	盈峰环境	19,400	97,970.00	0.00
437	001914	招商积余	6,500	97,825.00	0.00
438	688107	安路科技	1,764	97,707.96	0.00
439	603707	健友股份	7,185	96,997.50	0.00

440	600167	联美控股	13,800	96,186.00	0.00
441	688185	康希诺	1,174	95,681.00	0.00
442	000415	渤海租赁	45,300	95,130.00	0.00
443	601568	北元集团	17,920	94,438.40	0.00
444	000563	陕国投 A	30,950	94,397.50	0.00
445	600968	海油发展	30,700	94,249.00	0.00
446	600808	马钢股份	36,600	94,062.00	0.00
447	688234	天岳先进	1,264	93,460.16	0.00
448	300257	开山股份	6,101	92,552.17	0.00
449	601156	东航物流	7,100	92,300.00	0.00
450	603650	彤程新材	2,800	91,840.00	0.00
451	002925	盈趣科技	4,690	90,986.00	0.00
452	600126	杭钢股份	20,500	88,970.00	0.00
453	600195	中牧股份	7,600	88,768.00	0.00
454	002705	新宝股份	4,900	88,347.00	0.00
455	600764	中国海防	3,200	87,104.00	0.00
456	603379	三美股份	3,700	86,987.00	0.00
457	300442	润泽科技	2,800	86,128.00	0.00
458	603786	科博达	1,300	85,410.00	0.00
459	002608	江苏国信	11,200	84,784.00	0.00
460	000959	首钢股份	23,600	82,600.00	0.00
461	000402	金融街	18,000	81,360.00	0.00
462	688819	天能股份	2,151	79,242.84	0.00
463	002110	三钢闽光	18,550	78,281.00	0.00
464	601828	美凯龙	16,300	78,077.00	0.00
465	002653	海思科	3,300	77,880.00	0.00
466	002563	森马服饰	12,100	75,262.00	0.00
467	688289	圣湘生物	4,456	75,039.04	0.00
468	600377	宁沪高速	7,600	74,708.00	0.00
469	001203	大中矿业	6,700	74,437.00	0.00
470	601298	青岛港	10,500	73,185.00	0.00

471	000031	大悦城	19,454	71,201.64	0.00
472	603317	天味食品	4,864	71,063.04	0.00
473	601228	广州港	22,000	71,060.00	0.00
474	600623	华谊集团	11,400	71,022.00	0.00
475	603056	德邦股份	4,600	70,932.00	0.00
476	600928	西安银行	20,100	70,752.00	0.00
477	601869	长飞光纤	1,900	70,319.00	0.00
478	600927	永安期货	4,300	69,918.00	0.00
479	600350	山东高速	10,200	64,974.00	0.00
480	002399	海普瑞	5,573	63,922.31	0.00
481	601139	深圳燃气	8,700	63,423.00	0.00
482	601136	首创证券	4,400	62,348.00	0.00
483	000869	张裕 A	2,000	61,320.00	0.00
484	601969	海南矿业	9,200	60,536.00	0.00
485	001872	招商港口	3,400	58,718.00	0.00
486	600995	南网储能	5,200	57,252.00	0.00
487	000553	安道麦 A	6,600	55,704.00	0.00
488	002945	华林证券	4,000	54,720.00	0.00
489	688105	诺唯赞	1,760	53,662.40	0.00
490	601158	重庆水务	8,800	48,928.00	0.00
491	600299	安迪苏	6,000	47,820.00	0.00
492	688248	南网科技	1,242	47,680.38	0.00
493	688295	中复神鹰	1,188	43,575.84	0.00
494	603355	莱克电气	1,640	41,672.40	0.00
495	600032	浙江新能	3,300	41,448.00	0.00
496	600956	新天绿能	4,600	40,112.00	0.00
497	300741	华宝股份	1,800	38,556.00	0.00
498	603868	飞科电器	600	37,854.00	0.00
499	002901	大博医疗	800	24,864.00	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	300308	中际旭创	438,807.00	0.02
2	600372	中航电子	433,271.73	0.02
3	002463	沪电股份	431,475.00	0.02
4	000066	中国长城	395,968.00	0.02
5	000423	东阿阿胶	321,061.00	0.01
6	000933	神火股份	315,718.00	0.01
7	002240	盛新锂能	311,741.00	0.01
8	002008	大族激光	306,511.72	0.01
9	688256	寒武纪	305,916.00	0.01
10	603882	金域医学	305,320.00	0.01
11	002600	领益智造	270,152.00	0.01
12	688072	拓荆科技	268,531.59	0.01
13	300418	昆仑万维	260,516.00	0.01
14	300395	菲利华	260,092.00	0.01
15	603444	吉比特	256,108.00	0.01
16	688220	翱捷科技	254,630.92	0.01
17	688536	思瑞浦	254,005.73	0.01
18	601966	玲珑轮胎	239,004.00	0.01
19	300118	东方日升	238,485.00	0.01
20	300595	欧普康视	230,885.00	0.01

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	002603	以岭药业	563,004.47	0.02
2	603345	安井食品	547,785.00	0.02
3	688122	西部超导	526,899.39	0.02
4	688063	派能科技	506,243.60	0.02
5	000999	华润三九	502,845.15	0.02
6	002340	格林美	473,300.70	0.02
7	603605	珀莱雅	461,969.48	0.02
8	002384	东山精密	455,600.00	0.02
9	601607	上海医药	451,111.00	0.02
10	300724	捷佳伟创	445,590.00	0.02
11	300012	华测检测	440,729.00	0.02
12	603613	国联股份	432,142.90	0.02
13	601699	潞安环能	409,976.00	0.02
14	603606	东方电缆	405,524.00	0.02
15	601872	招商轮船	388,200.00	0.02
16	300073	当升科技	374,966.00	0.02
17	002850	科达利	369,714.34	0.01
18	300003	乐普医疗	366,147.00	0.01
19	002422	科伦药业	363,118.00	0.01
20	300168	万达信息	351,640.21	0.01

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	49,422,714.10
卖出股票收入（成交）总额	70,087,213.81

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	505,596.30	0.02
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	505,596.30	0.02

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	019688	22国债23	5,000	505,596.30	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 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
----	------	----	------	-----	------	-------

						产净值比例(%)
1	天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金	股票型	交易型开放式	天弘基金管理有限公司	2,181,810,283.81	90.51

7.11 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.13 投资组合报告附注

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

7.13.2 基金投资的前十名股票，均为基金合同规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	211,308.40
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	3,081,288.77
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	3,292,597.17

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息**8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构**

份额单位：份

份额 级别	持 有 人 户 数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总 份额 比例	持有份额	占总份 额比例
天弘 中证5 00ET F联接 A	34 0,9 53	4,083.21	614,344.67	0.04%	1,391,569,951.83	99.96%
天弘 中证5 00ET F联接 C	10 7,1 58	6,641.63	3,777,304.16	0.53%	707,926,249.47	99.47%
合计	44 3,6 63	4,742.09	4,391,648.83	0.21%	2,099,496,201.30	99.79%

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

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比 例
基金管理人所有从业人员持有本基金	天弘中证500ETF联接A	962,807.67	0.07%
	天弘中证500ETF联接C	25,548.04	0.00%
	合计	988,355.71	0.05%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区 间(万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	天弘中证500ETF联接A	50~100
	天弘中证500ETF联接C	0
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	天弘中证500ETF联接A	0~10
	天弘中证500ETF联接C	0
	合计	0~10

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	天弘中证500ETF联接A	天弘中证500ETF联接C
基金合同生效日(2015年01月20日)基金份额总额	10,000,000.00	-
本报告期期初基金份额总额	1,431,022,087.40	796,998,689.25
本报告期基金总申购份额	193,452,626.00	267,557,476.98
减：本报告期基金总赎回份额	232,290,416.90	352,852,612.60

本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,392,184,296.50	711,703,553.63

§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	4,297,955.61	3.60%	1,853.97	3.78%	-
方正证券	5	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	2	-	-	-	-	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券	8	12,130,761.89	10.17%	2,807.71	5.73%	-
海通证券	3	-	-	-	-	-
恒泰证券	2	8,470,779.25	7.10%	3,653.18	7.45%	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
首创证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	1	65,994,212.29	55.34%	28,463.27	58.07%	-
信达证券	1	7,497,466.01	6.29%	3,234.55	6.60%	-

银河证券	2	-	-	-	-	-
中金财富	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	20,866,065.48	17.50%	9,001.11	18.36%	-
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。

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	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	512,415.51	11.81%	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
恒泰证券	3,825,886.01	88.19%	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-	-	-

首创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	212,821,135.70	100.00%
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500交易型开放式指数证券投资基金联接基金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500交易型开放式指数证券投资基金联接基金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
8	天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金2023年第1季度报告	中国证监会规定媒介	2023-04-23

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

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

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准天弘中证500指数型发起式证券投资基金募集的文件
- 2、天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同
- 3、天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议
- 4、天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书
- 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

天弘基金管理有限公司
二〇二三年八月三十一日