

天弘中证红利低波动 100 交易型开放式指数证券投资基金
联接基金

2024 年中期报告

2024 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:2024 年 08 月 30 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2024年08月28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2024年01月01日起至2024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	13
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 净资产变动表	19
6.4 报表附注	21
§7 投资组合报告	50
7.1 期末基金资产组合情况	50
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	50
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	51
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	55
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	57
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	57
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	58
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	58
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	58
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	58
7.11 本基金投资股指期货的投资政策	58
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	58
7.13 投资组合报告附注	58
§8 基金份额持有人信息	59
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	59

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	60
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.....	60
§9 开放式基金份额变动.....	61
§10 重大事件揭示.....	61
10.1 基金份额持有人大会决议.....	61
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.....	61
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	62
10.4 基金投资策略的改变.....	62
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	62
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.....	62
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	62
10.8 其他重大事件.....	65
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	66
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.....	66
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	66
§12 备查文件目录.....	66
12.1 备查文件目录.....	66
12.2 存放地点.....	67
12.3 查阅方式.....	67

§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	天弘中证红利低波动100ETF联接	
基金主代码	008114	
基金运作方式	契约型开放式	
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	2,271,355,819.58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100ETF联接A	天弘中证红利低波动100ETF联接C
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	1,064,307,476.07份	1,207,048,343.51份

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	天弘中证红利低波动100交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	159549
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2023年11月23日
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2023年12月11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的最小化。
------	---------------------------------------

投资策略	<p>本基金为目标ETF的联接基金，目标ETF是采用完全复制法实现对标的指数紧密跟踪的全被动指数基金。本基金通过把全部或接近全部的基金资产投资于目标ETF、标的指数成份股和备选成份股进行被动式指数化投资，实现对业绩比较基准的紧密跟踪。正常情况下，本基金投资于目标ETF的资产比例不低于基金资产净值的90%。</p> <p>本基金产品投资策略包括目标ETF投资策略、股票投资策略、存托凭证投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、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。</p>
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	<p>本基金为ETF联接基金，且目标ETF为股票型指数基金，因此本基金的预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金主要通过投资于目标ETF实现对标的指数的紧密跟踪，具有与标的指数相似的风险收益特征。</p>

2.2.1 目标基金产品说明

投资目标	<p>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。</p>
投资策略	<p>本基金采取完全复制策略，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况（如流动性不足、成份股长期停牌、法律法规限制等）导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。为使得基金的投资组合更紧密地跟踪标的指数，基金</p>

	可进行股指期货投资。本基金的投资策略包括：债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、参与融资及转融通证券出借业务策略、存托凭证投资策略。
业绩比较基准	中证红利低波动100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	tgrxp@tg.gtja.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	上海市静安区新闻路669号博华广场19楼
邮政编码		300203	200041
法定代表人		韩歆毅	朱健

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	www.thfund.com.cn

址	
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 (2024年01月01日-2024年06月30日)	
	天弘中证红利低波动100ETF联接A	天弘中证红利低波动100ETF联接C
本期已实现收益	338,887.00	-1,893,510.58
本期利润	29,792,766.95	39,378,854.22
加权平均基金份额本期利润	0.0330	0.0363
本期加权平均净值利润率	2.14%	2.38%
本期基金份额净值增长率	3.68%	3.57%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2024年06月30日)	
期末可供分配利润	366,435,981.91	400,027,198.10
期末可供分配基金份额利润	0.3443	0.3314
期末基金资产净值	1,622,809,470.52	1,823,477,846.38
期末基金份额净值	1.5248	1.5107
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2024年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	52.48%	51.07%

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100ETF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	-4.48%	0.76%	-6.04%	0.76%	1.56%	0.00%
过去三个月	0.34%	0.76%	-1.81%	0.77%	2.15%	-0.01%
过去六个月	3.68%	0.90%	1.87%	0.91%	1.81%	-0.01%
过去一年	4.36%	0.76%	0.53%	0.77%	3.83%	-0.01%
过去三年	31.94%	0.87%	11.91%	0.88%	20.03%	-0.01%
自基金合同生效日起至 今	52.48%	0.92%	22.19%	0.94%	30.29%	-0.02%

天弘中证红利低波动100ETF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	-4.49%	0.76%	-6.04%	0.76%	1.55%	0.00%
过去三个月	0.28%	0.76%	-1.81%	0.77%	2.09%	-0.01%
过去六个月	3.57%	0.90%	1.87%	0.91%	1.70%	-0.01%
过去一年	4.15%	0.76%	0.53%	0.77%	3.62%	-0.01%
过去三年	31.15%	0.87%	11.91%	0.88%	19.24%	-0.01%

自基金合同生效日起至今	51.07%	0.92%	22.19%	0.94%	28.88%	-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100ETF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
(2019年12月10日-2024年06月30日)



天弘中证红利低波动100ETF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
(2019年12月10日-2024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2024年6月30日，公司共管理运作197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	2023年12月	-	10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	2023年12月	-	9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、本基金基金经理助理协助基金经理进行投资、研究、头寸管理等日常工作。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金按照国家法律法规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1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

报告期内，市场整体震荡下行，并在结构及风格上出现显著分化。具体来说：中证全指下跌8.64%，沪深300上涨0.89%，中证500下跌8.96%，创业板指下跌10.99%，中证1000下跌16.84%。本基金投资策略所跟踪的中证红利低波动100指数上涨1.93%。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ETF联接产品，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2024年06月30日，天弘中证红利低波动100ETF联接A基金份额净值为1.5248元，天弘中证红利低波动100ETF联接C基金份额净值为1.5107元。报告期内份额净值增长率天弘中证红利低波动100ETF联接A为3.68%，同期业绩比较基准增长率为1.87%；天弘中证红利低波动100ETF联接C为3.57%，同期业绩比较基准增长率为1.87%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，宏观经济方面，我们认为将维持温和复苏的态势，以时间换空间的方式不断修复经济发展中的阶段性和结构性困难。具体来说：地产方面，以周期性托底的方式对冲趋势性收缩的压力；制造业方面，以大力发展新质生产力的方式对冲中低端产业成本及地缘优势减弱的压力；财政支出方面，以加大中央支持力度并优化中长期制度安排的方式对冲地方政府债务压力；需求方面，以大规模设备更新、消费品以旧换新等定向鼓励支持政策的方式对冲企业部门投资需求及居民部门消费需求不足的压力。在去年年报中，我们写到：“经济总体将逐渐在人口、地产、逆全球化、科技突破等诸多重大长期变量的变化中寻找新的平衡点。”目前看来，我们正处在这一新平衡建立的过

程中，尽管这一过程可能是温和而缓慢的、曲折而反复的，但却是真正需要坚持的长期而正确的事情，我们的经济发展正在摆脱对短期刺激的依赖，正在建立更加优化的中长期机制和结构，这一过程虽然会有阵痛，但是其积极效果将在未来的若干年时间里逐步显现，并实现高质量发展。利率及流动性方面，下半年外部利率环境对国内利率下行的制约压力或将减小，降息空间有望打开，流动性料将相对充裕，并对实体经济和资本市场形成一定的支撑。

证券市场方面，我们认为对下半年的A股市场不必悲观：经历了过去三年多的调整出清后，市场对于未来预期的透支程度偏低，甚至可能过度反应了谨慎的情绪和不利的因素，而选择性忽视了已经在边际上开始积极变化的因素。在年初的流动性挤压后，市场估值已具备吸引力，在未来经济企稳回升，企业利润逐步修复的预期下，投资的收益风险比将有望得到改善，我们建议投资者进行中长期配置。但是，我们也应知道无论是宽基指数还是细分行业指数，准确预测其变化的幅度、速率以及时间窗口的难度是很大的，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”）在天弘中证红利低波动100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：天弘中证红利低波动100交易型开放式指数证券投资基金联接基金

报告截止日：2024年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末	上年度末
----	-----	-----	------

		2024年06月30日	2023年12月31日
资产：			
货币资金	6.4.7.1	176,683,770.17	137,286,666.38
结算备付金		1,518,781.61	836,968.92
存出保证金		2,387,681.42	1,277,001.79
交易性金融资产	6.4.7.2	3,270,827,220.80	2,616,269,763.14
其中：股票投资		107,980,503.73	2,492,735,207.11
基金投资		3,162,846,717.07	120,688,002.39
债券投资		-	2,846,553.64
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		-	11,454,959.47
应收股利		-	-
应收申购款		13,515,002.01	20,657,711.01
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		3,464,932,456.01	2,787,783,070.71
负债和净资产	附注号	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023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		22,359.48	2,861,661.30
应付赎回款		17,865,347.57	33,469,729.71
应付管理人报酬		135,636.90	1,150,061.94

应付托管费		27,127.39	230,012.39
应付销售服务费		302,986.46	295,860.73
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	291,681.31	1,082,611.18
负债合计		18,645,139.11	39,089,937.25
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	2,271,355,819.58	1,878,253,897.19
未分配利润	6.4.7.8	1,174,931,497.32	870,439,236.27
净资产合计		3,446,287,316.90	2,748,693,133.46
负债和净资产总计		3,464,932,456.01	2,787,783,070.71

注：报告截止日2024年06月30日，天弘中证红利低波动100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1.5248元，天弘中证红利低波动100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1.5107元；基金份额总额2,271,355,819.58份，其中天弘中证红利低波动100交易型开放式指数证券投资基金联接基金A类基金份额1,064,307,476.07份，天弘中证红利低波动100交易型开放式指数证券投资基金联接基金C类基金份额1,207,048,343.51份。

6.2 利润表

会计主体：天弘中证红利低波动100交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2024年01月01日至 2024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至202 3年06月30日
一、营业总收入		73,693,582.08	49,710,110.12
1.利息收入		1,570,163.51	430,341.85
其中：存款利息收入	6.4.7.9	1,570,163.51	430,341.85
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息		-	-

收入			
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-”填列）		771,749.34	59,412,075.84
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-1,292,859.07	32,925,516.15
基金投资收益	6.4.7.11	-35,287.85	-
债券投资收益	6.4.7.12	10,774.36	12,636.09
资产支持证券投资	6.4.7.13	-	-
收益			
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	2,089,121.90	26,473,923.60
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	70,726,244.75	-10,355,905.56
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	625,424.48	223,597.99
减：二、营业总支出		4,521,960.91	3,207,506.45
1.管理人报酬		2,304,987.96	2,093,374.94
2.托管费		460,997.58	418,675.01
3.销售服务费		1,648,549.23	522,461.37
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.信用减值损失	6.4.7.19	-	-
7.税金及附加		-	-

8.其他费用	6.4.7.20	107,426.14	172,995.13
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		69,171,621.17	46,502,603.67
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		69,171,621.17	46,502,603.67
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		69,171,621.17	46,502,603.67

6.3 净资产变动表

会计主体：天弘中证红利低波动100交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2024年01月01日至2024年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	1,878,253,897.19	870,439,236.27	2,748,693,133.46
二、本期期初净资产	1,878,253,897.19	870,439,236.27	2,748,693,133.46
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	393,101,922.39	304,492,261.05	697,594,183.44
（一）、综合收益总额	-	69,171,621.17	69,171,621.17
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	393,101,922.39	235,320,639.88	628,422,562.27
其中：1.基金申购款	2,555,618,068.26	1,365,443,527.67	3,921,061,595.93

2.基金赎回款	-2,162,516,145.87	-1,130,122,887.79	-3,292,639,033.66
(三)、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动(净资产减少以“-”号填列)	-	-	-
四、本期期末净资产	2,271,355,819.58	1,174,931,497.32	3,446,287,316.90
项目	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	358,204,383.30	106,958,899.99	465,163,283.29
二、本期期初净资产	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净资产变动数(净资产减少以“-”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净资产变动(净资产减少)	-	-	-

以“-”号填列)			
四、本期期末净资产	880,728,665.41	399,254,839.37	1,279,983,504.78

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

高阳

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交易型开放式指数证券投资基金联接基金（以下简称“本基金”）系由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“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《天弘中证红利低波动100指数型发起式证券投资基金联接基金基金合同》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不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购/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。在投资者认购/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“目标ETF”）的联接基金。目标ETF是采用完全复制法实现对中证红利低波动100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《天弘中证红利低波动100指数型发起式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基金份额、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：本基金投资于目标ETF的资产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2024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2024年06月30日的财务状况以及2024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。根据财政部、国家税务总局公告2023年第39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》，自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

(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 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末	
	2024年06月30日	
活期存款	176,683,770.17	
等于：本金	176,602,436.44	
加：应计利息	81,333.73	
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	176,683,770.17	

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2024年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	110,127,652.43	-	107,980,503.73	-2,147,148.70
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-

基金	3,161,867,303.4 0	-	3,162,846,717.0 7	979,413.67
其他	-	-	-	-
合计	3,271,994,955.8 3	-	3,270,827,220.8 0	-1,167,735.03

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 2024年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	2,224.05
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	182,031.12
其中：交易所市场	182,031.12
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	107,426.14
合计	291,681.31

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 天弘中证红利低波动100ETF联接A

金额单位：人民币元

项目 (天弘中证红利低波动100ETF 联接A)	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	751,681,278.40	751,681,278.40
本期申购	901,641,731.38	901,641,731.38
本期赎回（以“-”号填列）	-589,015,533.71	-589,015,533.71
本期末	1,064,307,476.07	1,064,307,476.07

6.4.7.7.2 天弘中证红利低波动100ETF联接C

金额单位：人民币元

项目 (天弘中证红利低波动100ETF 联接C)	本期 2024年01月01日至2024年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	1,126,572,618.79	1,126,572,618.79
本期申购	1,653,976,336.88	1,653,976,336.88
本期赎回（以“-”号填列）	-1,573,500,612.16	-1,573,500,612.16
本期末	1,207,048,343.51	1,207,048,343.51

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100ETF联接A**

单位：人民币元

项目 (天弘中证红利低波动 100ETF联接A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	257,822,880.09	95,992,914.91	353,815,795.00
本期期初	257,822,880.09	95,992,914.91	353,815,795.00
本期利润	338,887.00	29,453,879.95	29,792,766.95
本期基金份额交易产生的变动数	108,274,214.82	66,619,217.68	174,893,432.50

其中：基金申购款	308,715,252.13	180,599,819.46	489,315,071.59
基金赎回款	-200,441,037.31	-113,980,601.78	-314,421,639.09
本期已分配利润	-	-	-
本期末	366,435,981.91	192,066,012.54	558,501,994.45

6.4.7.8.2 天弘中证红利低波动100ETF联接C

单位：人民币元

项目 (天弘中证红利低波动 100ETF联接C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	373,612,334.88	143,011,106.39	516,623,441.27
本期期初	373,612,334.88	143,011,106.39	516,623,441.27
本期利润	-1,893,510.58	41,272,364.80	39,378,854.22
本期基金份额交易产生的变动数	28,308,373.80	32,118,833.58	60,427,207.38
其中：基金申购款	544,603,993.96	331,524,462.12	876,128,456.08
基金赎回款	-516,295,620.16	-299,405,628.54	-815,701,248.70
本期已分配利润	-	-	-
本期末	400,027,198.10	216,402,304.77	616,429,502.87

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
活期存款利息收入	1,502,029.89
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	51,300.94
其他	16,832.68
合计	1,570,163.51

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 2024年01月01日至2024年06月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	25,101,138.49
股票投资收益——赎回差价收入	-
股票投资收益——申购差价收入	-26,393,997.56
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-1,292,859.07

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 2024年01月01日至2024年06月30日
卖出股票成交总额	2,030,223,703.87
减：卖出股票成本总额	2,002,876,712.06
减：交易费用	2,245,853.32
买卖股票差价收入	25,101,138.49

6.4.7.10.3 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
申购基金份额总额	3,029,392,400.00
减：现金支付申购款总额	2,186,528,038.66
减：申购股票成本总额	869,258,358.90
减：交易费用	-
申购差价收入	-26,393,997.56

6.4.7.11 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2024年01月01日至2024年06月30日
卖出/赎回基金成交总额	-
减：卖出/赎回基金成本总额	-
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	-
减：交易费用	35,287.85
基金投资收益	-35,287.85

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
	2024年01月01日至2024年06月30日
债券投资收益——利息收入	10,606.36
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	168.00
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	10,774.36

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
	2024年01月01日至2024年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	2,856,880.00
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,799,832.00
减：应计利息总额	56,880.00
减：交易费用	-
买卖债券差价收入	168.00

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

本基金本报告期未取得资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期未取得贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益**6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期未取得买卖权证差价收入。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期未取得其他衍生工具投资收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
股票投资产生的股利收益	2,089,121.90
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	2,089,121.90

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2024年01月01日至2024年06月30日
1.交易性金融资产	70,726,244.75
——股票投资	68,164,320.03
——债券投资	-448.00
——资产支持证券投资	-
——基金投资	2,562,372.72
——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	70,726,244.75

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2024年01月01日至2024年06月30日
基金赎回费收入	600,453.25
基金转换费收入	24,971.23
合计	625,424.48

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
	2024年01月01日至2024年06月30日
审计费用	44,753.80
信息披露费	59,672.34
证券出借违约金	-
银行间账户维护费	3,000.00
合计	107,426.14

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
内蒙古君正能源化工集团股份有限公司	基金管理人的股东

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 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023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	89,053,018.48	3.64%	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 2024年01月01日至2024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
国泰君安证券股份有限公司	21,907.28	2.04%	21,907.28	12.03%
关联方名称	上年度可比期间 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
国泰君安证券股份有限公司	17,243.85	1.85%	-	-

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、经手费和适用期间内由券商承担的证券结算风险基金后的净额列示。

2、本报告期及上年度可比期间，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 2024年01月01日至2024年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	2,304,987.96	2,093,374.94

其中：应支付销售机构的客户维护费	3,031,702.17	685,213.72
应支付基金管理人的净管理费	-726,714.21	1,408,161.22

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。

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2024年01月01日至2024 年06月30日	上年度可比期间 2023年01月01日至2023 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	460,997.58	418,675.01

注:本基金基金财产中投资于目标ETF的部分不收取托管费，支付基金托管人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 2024年01月01日至2024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100ETF 联接A	天弘中证红利低波动100ETF 联接C	合计

天弘基金 管理有限 公司	-	47,543.80	47,543.8 0
国泰君安 证券股份 有限公司	-	2,482.12	2,482.12
合计	-	50,025.92	50,025.9 2
获得销售 服务费的 各关联方 名称	上年度可比期间 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100ETF 联接A	天弘中证红利低波动100ETF 联接C	合计
天弘基金 管理有限 公司	-	28,286.84	28,286.8 4
国泰君安 证券股份 有限公司	-	546.76	546.76
合计	-	28,833.60	28,833.6 0

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100ETF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、天弘中证红利低波动100ETF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

天弘中证红利低波动100ETF联接A

无

天弘中证红利低波动100ETF联接C

无

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 2024年01月01日至2024年06月30日		上年度可比期间 2023年01月01日至2023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	176,683,770.17	1,502,029.89	64,956,057.26	417,665.02

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 2024年01月01日至2024年06月30日				
关联方名	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入

称				数量（单位：张 /股）	总金额
国泰君安 证券股份 有限公司	601033	永兴股份	网下申购	12,577	203,747.40
国泰君安 证券股份 有限公司	603082	北自科技	网下申购	1,070	22,769.60
国泰君安 证券股份 有限公司	301591	肯特股份	网下申购	2,184	42,435.12
国泰君安 证券股份 有限公司	603341	龙旗科技	网下申购	2,978	77,428.00
国泰君安 证券股份 有限公司	603285	键邦股份	网下申购	1,287	24,002.55
上年度可比期间 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	603135	中重科技	网下申购	5,667	100,872.60

有限公司					
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

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3,080,294,816.00份目标ETF基金份额（上年度末：121,981,001.00份），占其总份额的比例为93.05%（上年度末：52.23%）。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106,442股（上年度末：1,799,042股），估值总额为人民币1,442,289.10元（上年度末：26,769,744.96元），占基金净资产的比例为0.04%（上年度末：0.97%）；持有君正集团的股票388,200股（上年度末：7,114,600股），估值总额为人民币1,432,458.00元（上年度末：26,608,604.00元），占基金净资产的比例为0.04%（上年度末：0.97%）。

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

天弘中证红利低波动100ETF联接A

本报告期无利润分配事项。

天弘中证红利低波动100ETF联接C

本报告期无利润分配事项。

6.4.12 期末（2024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
3015	诺瓦	2024	6个月	创业	126.8	188.0	691	87,68	129,9	-

89	星云	-02-01		板打新限售	9	1		0.99	14.91	
301589	诺瓦星云	2024-05-30	3个月	锁定期送股	-	188.01	553	-	103,969.53	-
688692	达梦数据	2024-06-04	6个月	科创板打新限售	86.96	174.93	175	15,218.00	30,612.75	-
603285	键邦股份	2024-06-28	1个月内(含)	新股未上市	18.65	18.65	1,287	24,002.55	24,002.55	-
603350	安乃达	2024-06-26	1个月内(含)	新股未上市	20.56	20.56	1,051	21,608.56	21,608.56	-
601033	永兴股份	2024-01-11	6个月	新股锁定	16.20	15.96	1,258	20,379.60	20,077.68	-
688709	成都华微	2024-01-31	6个月	科创板打新限售	15.69	18.79	1,045	16,396.05	19,635.55	-
301536	星宸科技	2024-03-20	6个月	创业板打新限售	16.16	32.27	481	7,772.96	15,521.87	-
688584	上海合晶	2024-02-01	6个月	科创板打新限售	22.66	15.89	866	19,623.56	13,760.74	-
301538	骏鼎达	2024-03-13	6个月	创业板打新限售	55.82	91.24	107	5,972.74	9,762.68	-

				售						
301538	骏鼎达	2024-05-22	4个月	锁定期送股	-	91.24	43	-	3,923.32	-
603341	龙旗科技	2024-02-23	6个月	新股锁定	26.00	37.49	298	7,748.00	11,172.02	-
688691	灿芯股份	2024-04-02	6个月	科创板打新限售	19.86	42.51	247	4,905.42	10,499.97	-
301591	肯特股份	2024-02-20	6个月	创业板打新限售	19.43	36.98	219	4,255.17	8,098.62	-
301587	中瑞股份	2024-03-27	6个月	创业板打新限售	21.73	25.26	306	6,649.38	7,729.56	-
001389	广合科技	2024-03-26	6个月	新股锁定	17.43	34.56	222	3,869.46	7,672.32	-
301539	宏鑫科技	2024-04-03	6个月	创业板打新限售	10.64	19.82	361	3,841.04	7,155.02	-
688695	中创股份	2024-03-06	6个月	科创板打新限售	22.43	31.55	186	4,171.98	5,868.30	-
688530	欧莱新材	2024-04-29	6个月	科创板打新限售	9.60	16.10	344	3,302.40	5,538.40	-

301588	美新科技	2024-03-06	6个月	创业板打新限售	14.50	21.25	257	3,726.50	5,461.25	-
301502	华阳智能	2024-01-26	6个月	创业板打新限售	28.01	37.83	138	3,865.38	5,220.54	-
603381	C永臻	2024-06-19	6个月	新股锁定	23.35	25.13	178	4,156.30	4,473.14	-
603344	星德胜	2024-03-13	6个月	新股锁定	19.18	22.66	182	3,490.76	4,124.12	-
001359	平安电工	2024-03-19	6个月	新股锁定	17.39	20.60	184	3,199.76	3,790.40	-
603082	北自科技	2024-01-23	6个月	新股锁定	21.28	29.49	107	2,276.96	3,155.43	-
001379	腾达科技	2024-01-11	6个月	新股锁定	16.98	13.48	213	3,616.74	2,871.24	-
603375	盛景微	2024-01-17	6个月	新股锁定	38.18	38.90	72	2,748.96	2,800.80	-

注：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中需要限售的部分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。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2024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2024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，建立了以风险委员会为核心的、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。在董事会下设立风险委员会，负责审议风险管理的宏观政策，指导监督公司风险管理目标的落实等；在管理层层面设立风险管理委员会，主要负责指导、协调和监督各业务或职能部门开展风险管理工作；决定公司风险控制政策和程序，审批公司风险管理标准和重要业务风险管理口径；听取风险汇报，并就报告的重大风险管理事项进行决策；听取创新业务或产品风险评估报告；组织和协调重大风险事件的应对，直至风险得到妥善处理；审议公司重要的风险管理制度和流程。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。风险管理部由督察长分管。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。

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 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	-	2,846,553.64
合计	-	2,846,553.64

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2024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 2024年06月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	176,683,770.17	-	-	-	176,683,770.17
结算备付金	1,518,781.61	-	-	-	1,518,781.61
存出保证金	2,387,681.42	-	-	-	2,387,681.42
交易性金融资产	-	-	-	3,270,827,220.80	3,270,827,220.80
应收申购款	-	-	-	13,515,002.01	13,515,002.01
资产总计	180,590,233.20	-	-	3,284,342,222.81	3,464,932,456.01
负债					
应付清算款	-	-	-	22,359.48	22,359.48
应付赎回款	-	-	-	17,865,347.57	17,865,347.57
应付管理人报酬	-	-	-	135,636.90	135,636.90
应付托管费	-	-	-	27,127.39	27,127.39
应付销售服务费	-	-	-	302,986.46	302,986.46
其他负债	-	-	-	291,681.31	291,681.31
负债总计	-	-	-	18,645,139.11	18,645,139.11
利率敏感度缺口	180,590,233.20	-	-	3,265,697,083.70	3,446,287,316.90
上年度末 2023年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					

货币资金	137,286,666.38	-	-	-	137,286,666.38
结算备付金	836,968.92	-	-	-	836,968.92
存出保证金	1,277,001.79	-	-	-	1,277,001.79
交易性金融资产	2,846,553.64	-	-	2,613,423,209.50	2,616,269,763.14
应收清算款	-	-	-	11,454,959.47	11,454,959.47
应收申购款	-	-	-	20,657,711.01	20,657,711.01
资产总计	142,247,190.73	-	-	2,645,535,879.98	2,787,783,070.71
负债					
应付清算款	-	-	-	2,861,661.30	2,861,661.30
应付赎回款	-	-	-	33,469,729.71	33,469,729.71
应付管理人报酬	-	-	-	1,150,061.94	1,150,061.94
应付托管费	-	-	-	230,012.39	230,012.39
应付销售服务费	-	-	-	295,860.73	295,860.73
其他负债	-	-	-	1,082,611.18	1,082,611.18
负债总计	-	-	-	39,089,937.25	39,089,937.25
利率敏感度缺口	142,247,190.73	-	-	2,606,445,942.73	2,748,693,133.46

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2024年06月30日，本基金持有的交易性债券投资占基金净资产的比例为0.00%(2023年12月31日：0.10%)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响(2023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 2024年06月30日		上年度末 2023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	107,980,503.73	3.13	2,492,735,207.11	90.69
交易性金融资产—基金投资	3,162,846,717.07	91.78	120,688,002.39	4.39
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	3,270,827,220.80	94.91	2,613,423,209.50	95.08

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 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日

	业绩比较基准上升5%	170,376,518.49	126,258,005.31
	业绩比较基准下降5%	-170,376,518.49	-126,258,005.31

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2024年06月30日	上年度末 2023年12月31日
第一层次	3,270,338,799.53	2,612,247,708.10
第二层次	45,611.11	2,846,553.64
第三层次	442,810.16	1,175,501.40
合计	3,270,827,220.80	2,616,269,763.14

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2024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(2023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	107,980,503.73	3.12
	其中：股票	107,980,503.73	3.12
2	基金投资	3,162,846,717.07	91.28
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	178,202,551.78	5.14
8	其他各项资产	15,902,683.43	0.46
9	合计	3,464,932,456.01	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	977,967.00	0.03
B	采矿业	5,748,138.00	0.17

C	制造业	43,663,016.46	1.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,960,604.88	0.20
E	建筑业	4,531,660.00	0.13
F	批发和零售业	3,206,033.00	0.09
G	交通运输、仓储和邮政业	7,679,591.76	0.22
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	46,981.02	0.00
J	金融业	28,844,067.60	0.84
K	房地产业	1,988,647.33	0.06
L	租赁和商务服务业	4,313,719.00	0.13
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	20,077.68	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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	107,980,503.73	3.13

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	000895	双汇发展	103,700	2,464,949.00	0.07
2	600177	雅戈尔	330,573	2,353,679.76	0.07
3	600585	海螺水泥	98,400	2,321,256.00	0.07
4	601006	大秦铁路	319,986	2,291,099.76	0.07
5	600273	嘉化能源	282,401	2,016,343.14	0.06
6	600064	南京高科	327,619	1,988,647.33	0.06
7	002233	塔牌集团	244,391	1,786,498.21	0.05

8	600782	新钢股份	537,925	1,785,911.00	0.05
9	000825	太钢不锈	509,100	1,720,758.00	0.05
10	600755	厦门国贸	238,700	1,711,479.00	0.05
11	601088	中国神华	35,600	1,579,572.00	0.05
12	000651	格力电器	38,400	1,506,048.00	0.04
13	600655	豫园股份	285,900	1,472,385.00	0.04
14	600019	宝钢股份	220,100	1,463,665.00	0.04
15	600057	厦门象屿	212,200	1,442,960.00	0.04
16	601211	XD国泰君	106,442	1,442,289.10	0.04
17	601216	君正集团	388,200	1,432,458.00	0.04
18	002267	陕天然气	186,600	1,410,696.00	0.04
19	600395	盘江股份	233,100	1,400,931.00	0.04
20	600028	中国石化	221,400	1,399,248.00	0.04
21	600741	华域汽车	84,200	1,379,196.00	0.04
22	601225	XD陕西煤	53,100	1,368,387.00	0.04
23	600282	南钢股份	274,100	1,365,018.00	0.04
24	601158	重庆水务	280,300	1,345,440.00	0.04
25	601866	中远海发	516,100	1,331,538.00	0.04
26	600295	鄂尔多斯	132,600	1,315,392.00	0.04
27	600170	上海建工	611,200	1,314,080.00	0.04
28	600901	江苏金租	248,100	1,252,905.00	0.04
29	600008	首创环保	459,300	1,230,924.00	0.04
30	600104	上汽集团	88,600	1,227,996.00	0.04
31	000709	河钢股份	610,037	1,183,471.78	0.03
32	000429	粤高速 A	112,600	1,172,166.00	0.03
33	601318	中国平安	28,300	1,170,488.00	0.03
34	601229	上海银行	160,900	1,168,134.00	0.03
35	600997	开滦股份	169,200	1,160,712.00	0.03
36	000906	浙商中拓	172,000	1,159,280.00	0.03
37	600887	伊利股份	44,500	1,149,880.00	0.03
38	600039	四川路桥	143,600	1,133,004.00	0.03

39	601668	中国建筑	204,300	1,084,833.00	0.03
40	000776	广发证券	88,500	1,077,045.00	0.03
41	600033	福建高速	318,800	1,067,980.00	0.03
42	600236	桂冠电力	138,800	1,064,596.00	0.03
43	600377	宁沪高速	83,300	1,049,580.00	0.03
44	000685	中山公用	142,000	1,023,820.00	0.03
45	600820	隧道股份	153,100	999,743.00	0.03
46	000898	鞍钢股份	470,800	998,096.00	0.03
47	600873	梅花生物	99,400	995,988.00	0.03
48	000538	云南白药	19,400	992,310.00	0.03
49	600143	金发科技	150,100	992,161.00	0.03
50	600598	北大荒	78,300	977,967.00	0.03
51	600000	浦发银行	118,800	977,724.00	0.03
52	002032	苏泊尔	19,400	971,940.00	0.03
53	601009	南京银行	93,200	968,348.00	0.03
54	603858	步长制药	63,200	957,480.00	0.03
55	600704	物产中大	218,000	946,120.00	0.03
56	601169	北京银行	160,300	936,152.00	0.03
57	000778	新兴铸管	265,300	923,244.00	0.03
58	000157	中联重科	119,400	916,992.00	0.03
59	601818	光大银行	284,400	901,548.00	0.03
60	002736	国信证券	103,500	899,415.00	0.03
61	600740	山西焦化	227,100	890,232.00	0.03
62	600461	洪城环境	76,436	885,128.88	0.03
63	600089	特变电工	63,600	882,132.00	0.03
64	601166	兴业银行	49,900	879,238.00	0.03
65	601992	金隅集团	636,400	871,868.00	0.03
66	601398	工商银行	152,400	868,680.00	0.03
67	601997	贵阳银行	163,440	861,328.80	0.02
68	600837	海通证券	96,300	824,328.00	0.02
69	002545	东方铁塔	116,800	795,408.00	0.02

70	000019	深粮控股	137,200	787,528.00	0.02
71	601077	XD渝农商	156,700	786,634.00	0.02
72	601939	建设银行	105,100	777,740.00	0.02
73	000877	天山股份	143,200	773,280.00	0.02
74	600269	赣粤高速	148,400	767,228.00	0.02
75	601328	交通银行	101,900	761,193.00	0.02
76	601678	滨化股份	217,600	757,248.00	0.02
77	601963	重庆银行	97,500	755,625.00	0.02
78	002304	洋河股份	9,300	750,882.00	0.02
79	600623	华谊集团	128,400	742,152.00	0.02
80	600015	华夏银行	115,200	737,280.00	0.02
81	002216	三全食品	66,300	727,974.00	0.02
82	600016	民生银行	191,900	727,301.00	0.02
83	601187	厦门银行	132,700	707,291.00	0.02
84	002807	江阴银行	183,200	690,664.00	0.02
85	601825	沪农商行	99,900	671,328.00	0.02
86	600919	江苏银行	90,290	670,854.70	0.02
87	000039	中集集团	72,250	669,035.00	0.02
88	601288	农业银行	151,700	661,412.00	0.02
89	002948	青岛银行	191,500	645,355.00	0.02
90	002839	张家港行	156,500	629,130.00	0.02
91	600036	招商银行	17,900	612,001.00	0.02
92	601658	邮储银行	118,000	598,260.00	0.02
93	601988	中国银行	127,600	589,512.00	0.02
94	601577	长沙银行	72,000	588,960.00	0.02
95	601838	成都银行	35,500	539,245.00	0.02
96	603323	苏农银行	109,100	524,771.00	0.02
97	600908	无锡银行	93,900	499,548.00	0.01
98	002966	苏州银行	65,500	491,250.00	0.01
99	601665	齐鲁银行	99,000	486,090.00	0.01
100	601860	紫金银行	186,000	465,000.00	0.01

101	301589	诺瓦星云	1,244	233,884.44	0.01
102	688692	达梦数据	175	30,612.75	0.00
103	603285	键邦股份	1,287	24,002.55	0.00
104	603350	安乃达	1,051	21,608.56	0.00
105	601033	永兴股份	1,258	20,077.68	0.00
106	688709	成都华微	1,045	19,635.55	0.00
107	301536	星宸科技	481	15,521.87	0.00
108	688584	上海合晶	866	13,760.74	0.00
109	301538	骏鼎达	150	13,686.00	0.00
110	603341	龙旗科技	298	11,172.02	0.00
111	688691	灿芯股份	247	10,499.97	0.00
112	301591	肯特股份	219	8,098.62	0.00
113	301587	中瑞股份	306	7,729.56	0.00
114	001389	广合科技	222	7,672.32	0.00
115	301539	宏鑫科技	361	7,155.02	0.00
116	688695	中创股份	186	5,868.30	0.00
117	688530	欧莱新材	344	5,538.40	0.00
118	301588	美新科技	257	5,461.25	0.00
119	301502	华阳智能	138	5,220.54	0.00
120	603381	C永臻	178	4,473.14	0.00
121	603344	星德胜	182	4,124.12	0.00
122	001359	平安电工	184	3,790.40	0.00
123	603082	北自科技	107	3,155.43	0.00
124	001379	腾达科技	213	2,871.24	0.00
125	603375	盛景微	72	2,800.80	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	002556	辉隆股份	18,006,883.00	0.66
2	000895	双汇发展	17,187,086.00	0.63
3	000825	太钢不锈	15,866,652.00	0.58
4	000906	浙商中拓	15,460,889.74	0.56
5	000429	粤高速 A	15,318,780.80	0.56
6	002267	陕天然气	13,840,327.00	0.50
7	002032	苏泊尔	13,713,600.00	0.50
8	002004	华邦健康	12,276,496.00	0.45
9	002233	塔牌集团	11,942,602.14	0.43
10	002304	洋河股份	11,189,458.00	0.41
11	002367	康力电梯	10,070,035.00	0.37
12	000709	河钢股份	9,836,768.03	0.36
13	002911	佛燃能源	9,723,313.62	0.35
14	000930	中粮科技	9,695,960.21	0.35
15	000685	中山公用	9,641,118.00	0.35
16	000538	云南白药	9,500,266.40	0.35
17	002545	东方铁塔	9,038,087.00	0.33
18	002539	云图控股	8,697,005.00	0.32
19	002091	江苏国泰	8,668,832.00	0.32
20	002736	国信证券	8,650,893.00	0.31

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	600177	雅戈尔	77,296,143.34	2.81
2	601006	大秦铁路	51,468,327.29	1.87

3	601088	中国神华	50,112,929.68	1.82
4	600997	开滦股份	46,076,178.00	1.68
5	600273	嘉化能源	45,003,791.00	1.64
6	600282	南钢股份	43,122,066.00	1.57
7	600295	鄂尔多斯	43,092,941.24	1.57
8	600064	南京高科	40,130,893.00	1.46
9	601866	中远海发	38,448,424.00	1.40
10	600350	山东高速	36,564,939.00	1.33
11	601229	上海银行	36,149,955.37	1.32
12	600782	新钢股份	34,511,557.29	1.26
13	600655	豫园股份	31,776,738.00	1.16
14	601169	北京银行	31,147,893.28	1.13
15	605368	蓝天燃气	31,125,939.60	1.13
16	601101	昊华能源	30,793,904.21	1.12
17	600210	紫江企业	29,116,727.50	1.06
18	600395	盘江股份	28,419,047.00	1.03
19	600461	洪城环境	28,364,170.69	1.03
20	600008	首创环保	28,330,695.60	1.03

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	419,216,047.55
卖出股票收入（成交）总额	2,030,223,703.87

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	天弘中证红利低波动100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	3,162,846,717.07	91.78

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	2,387,681.42
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	13,515,002.01
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	15,902,683.43

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 红利 低波 动100 ETF 联接A	23 8,7 07	4,458.64	442,607,690.18	41.5 9%	621,699,785.89	58.41%
天弘 中证 红利 低波 动100 ETF 联接C	59 4,8 30	2,029.23	45,483,200.53	3.77%	1,161,565,142.98	96.23%
合计	82 0,9 50	2,766.74	488,090,890.71	21.4 9%	1,783,264,928.87	78.51%

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100ETF联接A	1,586,802.64	0.15%
	天弘中证红利低波动100ETF联接C	910,558.20	0.08%
	合计	2,497,360.84	0.11%

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	天弘中证红利低波	10~50

和研究部门负责人持有本开放式基金	动100ETF联接A	
	天弘中证红利低波动100ETF联接C	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100ETF联接A	0~10
	天弘中证红利低波动100ETF联接C	0
	合计	0~10

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	天弘中证红利低波动100ETF联接A	天弘中证红利低波动100ETF联接C
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	751,681,278.40	1,126,572,618.79
本报告期基金总申购份额	901,641,731.38	1,653,976,336.88
减：本报告期基金总赎回份额	589,015,533.71	1,573,500,612.16
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,064,307,476.07	1,207,048,343.51

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

本报告期内，南翰仪同志任职国泰君安证券资产托管部副总经理(主持工作)。陈忠义同志任国泰君安证券公司副总裁，不再兼任资产托管部总经理职务。具体信息参见国

泰君安证券资产托管与基金服务网站公告《关于国泰君安证券股份有限公司资产托管部负责人变更的公告》。

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未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	
东方财富证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-

方正 证券	5	584,100,963.89	23.86%	260,453.21	24.26%	-
光大 证券	2	-	-	-	-	-
广发 证券	3	-	-	-	-	-
国盛 证券	2	-	-	-	-	-
国泰 君安 证券	8	89,053,018.48	3.64%	21,907.28	2.04%	-
国投 证券	3	861,168,078.44	35.18%	384,010.15	35.77%	-
海通 证券	3	340,862,670.65	13.93%	151,992.79	14.16%	-
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	-	-	-	-	-
信达 证券	1	-	-	-	-	-
银河 证券	2	-	-	-	-	-
中金 财富	1	-	-	-	-	-
中金 公司	1	-	-	-	-	-

中泰证券	2	572,524,416.33	23.39%	255,308.70	23.78%	-
中信建投证券	2	-	-	-	-	-

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

2、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：中金公司北交所交易单元。

4、本基金报告期内停止租用交易单元：国泰君安证券深圳交易单元、国投证券上海交易单元、国投证券深圳交易单元。

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
东方财富证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	7,535,981.74	100.00%
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	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
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	天弘基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告	中国证监会规定媒介	2024-01-13
2	天弘中证红利低波动100交易型开放式指数证券投资基金联接基金2023年第4季度报告	中国证监会规定媒介	2024-01-22
3	天弘基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告	中国证监会规定媒介	2024-01-25
4	天弘基金将严格落实《证监会新闻发言人就“两融”融券业务有关情况答记者问》相关要求	中国证监会规定媒介	2024-02-06
5	天弘基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告	中国证监会规定媒介	2024-02-22
6	天弘基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告	中国证监会规定媒介	2024-02-26
7	天弘中证红利低波动100交易型开放式指数证券投资基	中国证监会规定媒介	2024-03-29

	金联接基金2023年年度报告		
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	2024-03-30
9	天弘中证红利低波动100交易型开放式指数证券投资基金联接基金2024年第1季度报告	中国证监会规定媒介	2024-04-22
10	天弘中证红利低波动100交易型开放式指数证券投资基金联接基金（A类份额）基金产品资料概要（更新）	中国证监会规定媒介	2024-06-28
11	天弘中证红利低波动100交易型开放式指数证券投资基金联接基金（C类份额）基金产品资料概要（更新）	中国证监会规定媒介	2024-06-28
12	天弘基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告	中国证监会规定媒介	2024-06-29

§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、天弘中证红利低波动100交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议
- 4、天弘中证红利低波动100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
二〇二四年八月三十日