

天弘中证 500 指数量化增强型证券投资基金

2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人:天弘基金管理有限公司

基金托管人:江苏银行股份有限公司

送出日期:2026 年 08 月 31 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意。

基金托管人江苏银行股份有限公司根据本基金合同约定，于2026年08月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2026年01月01日起至2026年06月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	46
7.1 期末基金资产组合情况	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	47
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	48
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	63
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	65
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	65
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	65
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	66
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	66
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	66
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	66
7.12 投资组合报告附注	66
§8 基金份额持有人信息	67
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	67
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	68

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.....	68
§9 开放式基金份额变动.....	68
§10 重大事件揭示.....	69
10.1 基金份额持有人大会决议.....	69
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	69
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	69
10.4 基金投资策略的改变	69
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	69
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	69
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	70
10.8 其他重大事件	71
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	72
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.....	72
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	72
§12 备查文件目录.....	72
12.1 备查文件目录	72
12.2 存放地点.....	73
12.3 查阅方式.....	73

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	天弘中证500指数量化增强型证券投资基金	
基金简称	天弘中证500指数量化增强	
基金主代码	025013	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025年09月12日	
基金管理人	天弘基金管理有限公司	
基金托管人	江苏银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	170,329,397.44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500指数量化增强A	天弘中证500指数量化增强C
下属分级基金的交易代码	025013	025014
报告期末下属分级基金的份额总额	48,743,845.18份	121,585,552.26份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票型指数增强基金，在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上，通过数量化的方法进行积极的指数组合管理与风险控制，力争获取高于标的指数的投资收益。
投资策略	本基金采用指数增强型投资策略，以中证500指数作为基金投资组合的标的指数，结合深入的宏观面、基本面研究及量化投资技术，在指数化投资基础上优化调整投资组合，力争控制本基金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0.5%，年跟踪误差不超过7.75%，以实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。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。本基金运作过程中，当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市，且指数编制机构

	暂未作出调整的，基金管理人应当按照基金份额持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。本基金主要投资策略包括：资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、其他类型资产投资策略。
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	本基金为股票指数增强型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。本基金若投资港股通标的股票，会面临港股通机制下因投资环境、投资标的、市场制度以及交易规则等差异带来的特有风险。

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	江苏银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	童建林	田作全
	联系电话	022-83310208	025-58588321
	电子邮箱	service@thfund.com.cn	tianzuoquan@jsbchina.cn
客户服务电话		400-986-8888	95319
传真		022-83865564	025-58588155
注册地址		天津自贸试验区（中心商务区）新华路3678号宝风大厦（新金融大厦）16层02单元3号房间	南京市中华路26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	南京市中华路26号
邮政编码		300203	210001
法定代表人		黄辰立	袁军

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披	中国证券报
-----------	-------

露报纸名称	
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.thfund.com.cn
基金中期报告置备地点	基金管理人及基金托管人的办公地址

2.5 其他相关资料

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2026年01月01日-2026年06月30日)	
	天弘中证500指数量化增强A	天弘中证500指数量化增强C
本期已实现收益	6,345,862.96	24,957,338.60
本期利润	7,354,757.31	28,981,251.14
加权平均基金份额本期利润	0.2253	0.2623
本期加权平均净值利润率	19.26%	22.66%
本期基金份额净值增长率	24.34%	24.09%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2026年06月30日)	
期末可供分配利润	12,953,554.24	31,814,204.83
期末可供分配基金份额利润	0.2657	0.2617
期末基金资产净值	62,549,296.09	155,514,605.57
期末基金份额净值	1.2832	1.2791
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2026年06月30日)	

基金份额累计净值增长率	28.32%	27.91%
-------------	--------	--------

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500指数量化增强A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	19.88%	1.51%	17.61%	1.56%	2.27%	-0.05%
过去六个月	24.34%	1.55%	19.93%	1.58%	4.41%	-0.03%
自基金合同 生效日起至 今	28.32%	1.39%	25.44%	1.42%	2.88%	-0.03%

天弘中证500指数量化增强C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	19.78%	1.51%	17.61%	1.56%	2.17%	-0.05%
过去六个月	24.09%	1.55%	19.93%	1.58%	4.16%	-0.03%
自基金合同 生效日起至 今	27.91%	1.39%	25.44%	1.42%	2.47%	-0.03%

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500指数量化增强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
(2025年09月12日-2026年06月30日)



天弘中证500指数量化增强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
(2025年09月12日-2026年06月30日)



注：1、本基金合同于2025年09月12日生效，本基金合同生效起至披露时点不满1年。

2、按照本基金合同的约定，基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。本基金的建仓期为2025年09月12日至2026年03月11日，建仓期结束时及至报告期末，各项资产配置比例均符合基金合同的约定。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

截至2026年06月30日，公司共管理运作267只公募基金，公司业务范围涵盖二级市场股票投资、债券投资、现金管理、衍生品投资等。公司始终秉承“稳健理财，值得信赖”的理念，坚持为投资者带来优质的基金产品和理财服务。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘笑明	本基金基金经理	2025年09月12日	-	12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。

注：1、上述任职日期/离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

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

本报告期内，本基金运作合法合规，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，市场整体上行，但结构上有较大分化。具体来说，根据万得数据统计（以价格指数计算，未考虑指数样本股分红收益）：中证全指上涨10.69%，沪深300上涨7.55%，中证A500上涨11.91%，中证500上涨20.97%，创业板指上涨35.58%，中证1000上涨15.99%。报告期内，基金以基准指数为投资基础，通过选股模型围绕基准进行持续优化，力争在基准的行业分布内精选基本面更为优质的标的，并在结构化风险模型和优化器的辅助下构建收益风险比更具优势的投资组合。受益于上述策略的有效性，基金在报告期内取得了一定程度的超额收益。

投资策略方面，本基金作为股票型指数增强基金，在对基准指数进行有效跟踪的基础上，通过对市场结构及公司基本面的持续跟踪分析，利用量化选股模型及优化策略积极抽样组合，力争在控制跟踪误差的同时为投资者提供高于业绩比较基准的投资收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2026年06月30日，天弘中证500指数量化增强A基金份额净值为1.2832元，天弘中证500指数量化增强C基金份额净值为1.2791元。报告期内份额净值增长率天弘中证500指数量化增强A为24.34%，同期业绩比较基准增长率为19.93%；天弘中证500指数量化增强C为24.09%，同期业绩比较基准增长率为19.93%。

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2026年下半年，外部环境依然错综复杂，全球贸易条件与地缘冲突的外溢风险尚未消退，国内经济则处在新旧动能转换与结构升级的关键阶段。上半年我国经济运行在合理区间，经济增速符合全年预期目标，展现出较强的发展韧性与活力，同时经济持续稳中向好的基础仍需进一步巩固。我们认为，下半年宏观运行大概率延续波动中修复、分化中再平衡的特征：出口在经历较快增长后将面临基数抬升与外部不确定性的考验，但依托中国制造业的结构性竞争优势，外贸有望继续保持韧性并发挥托底作用；高技术制造与数字基础设施相关领域的投资有望保持相对韧性，房地产投资的调整或将延续，其对总量增长的影响仍需观察；消费的修复斜率或仍偏温和，但结构上有望继续向服务消费与更新换代需求倾斜。随着落后产能治理的推进，工业品价格有望保持温和回升，但其持续性仍取决于供需格局的进一步改善，居民消费价格则预计维持低位温和运行。

政策取向清晰而积极。2026年是“十五五”规划的开局之年，宏观政策明确要求精准有效实施更加积极的财政政策和适度宽松的货币政策，持续扩大内需、优化供给，着力稳就业、稳企业、稳市场、稳预期。财政方面，赤字率安排与超长期特别国债的发行规模为扩大财政支出、加强逆周期调节提供了有力支持；货币方面，政策强调增强前瞻性、灵活性与针对性，保持流动性充裕和社会融资条件相对宽松，并通过结构性工具对科技创新、民营企业、普惠小微等重点领域实施定向支持，后续仍具备相机抉择的余地。

“十五五”规划纲要关于全面实施“人工智能+”行动、加快建设现代化产业体系等部

署，为产业升级提供了明确且具有延续性的政策指引；与此同时，深化资本市场投融资综合改革、健全中长期资金入市机制等安排的持续推进，也在稳步改善权益市场的制度环境与资金结构。

证券市场方面，我们对A股的中长期表现继续保持积极，同时提示两个需要正视的变化。其一是市场结构的高度分化，报告期内无论从行业间的收益差距还是个股收益的截面离散度衡量，市场分化程度均达到近十年来的高位，主要宽基指数的涨幅与多数个股的实际表现之间出现明显背离；我们认为，这一分化反映了不同行业盈利前景、估值水平与市场预期的差异，后续可能随着盈利验证、资金结构及风险偏好的变化而有所调整。其二是市场核心矛盾的切换，本轮行情的驱动力正在从预期与情绪的修复逐步转向企业盈利与现金流的实际兑现，从一季度数据看，上市公司整体营业收入与归属于母公司股东的净利润同比均有所改善，但不同板块之间的景气差异依然明显，前期估值抬升较快的方向能否被后续业绩所验证，将是影响行情高度与节奏的重要因素。相应地，下半年市场的波动中枢可能较上半年有所抬升，部分领域估值与交易拥挤度的上升，可能放大市场对边际变化的敏感度。尽管如此，市场仍存在若干中长期支撑因素，无风险收益率的低位运行与居民资产多元化配置需求，有望为权益市场资金面提供一定支持，中长期资金入市机制的健全亦有助于改善投资者结构与定价稳定性。总体而言，我们认为权益资产的中长期配置价值依然值得重视，但下半年的收益来源或将更多取决于结构的选择与风险的管理，而非对市场整体方向的简单押注。

当然，我们也应认识到，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、速率以及时间窗口始终存在较大挑战。面对市场的不确定性，一套以概率思维为指导的投资框架和应对方法，往往比依赖单一结果的押注式预测更加有效，也更有可能带来良好的投资体验；在个股表现差异显著放大的市场环境中，系统化、纪律化的投资流程对于保持策略的一致性尤为重要。因此，我们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，另一方面在投资时机以及投资品种上进行适度分散化，以更好地对冲风险，力争实现收益的长期积累，并更充分地发挥复利效应。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

本基金管理人按照企业会计准则、中国证监会相关规定、中国证券投资基金业协会相关指引和基金合同关于估值的约定，对基金所持有的投资品种进行估值。本基金管理人设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构，负责制定公司所管理基金的基本估值政策，对公司旗下基金已采用的估值政策、方法、流程的执行情况进行审核监督，确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益。

本基金托管人根据法律法规要求履行基金估值及净值计算的复核责任。基金管理人改变估值技术，导致基金资产净值的变化在0.25%以上的，对所采用的相关估值技术、假设及输入值的适当性等咨询会计师事务所的专业意见。定价服务机构按照商业合同约定提供定价服务。参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，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，本基金托管人--江苏银行股份有限公司严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规的规定以及《托管协议》的约定，尽职尽责履行了托管人应尽的义务，没有从事任何损害基金份额持有人利益的行为。

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，本基金托管人--江苏银行股份有限公司未发现天弘基金管理有限公司在基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上存在损害基金份额持有人利益的行为，或违反《中华人民共和国证券投资基金法》等有关法律法规、在各重要方面的运作违反基金合同规定的情况。

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

本报告期内，由基金管理人所编制和披露的定期报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§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指数量化增强型证券投资基金

报告截止日：2026年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
资 产:			
货币资金	6.4.7.1	27,794,300.73	19,752,290.74
结算备付金		2,108,679.08	2,889,363.45
存出保证金		2,347,152.00	1,610,323.20
交易性金融资产	6.4.7.2	187,028,318.32	134,466,188.99
其中：股票投资		186,958,315.47	134,466,188.99
基金投资		-	-
债券投资		70,002.85	-
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	-	9,995,657.26
应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		1,848,504.43	925,745.63
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		221,126,954.56	169,639,569.27
负 债 和 净 资 产	附注号	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		2,778,171.32	13,198,156.57

应付管理人报酬		131,128.05	127,864.74
应付托管费		16,391.02	15,983.09
应付销售服务费		47,760.30	60,447.60
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	7,250.78
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	89,602.21	40,000.00
负债合计		3,063,052.90	13,449,702.78
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	170,329,397.44	151,512,760.59
未分配利润	6.4.7.8	47,734,504.22	4,677,105.90
净资产合计		218,063,901.66	156,189,866.49
负债和净资产总计		221,126,954.56	169,639,569.27

注：1.报告截止日2026年06月30日，天弘中证500指数量化增强型证券投资基金A类基金份额净值1.2832元，天弘中证500指数量化增强型证券投资基金C类基金份额净值1.2791元；基金份额总额170,329,397.44份，其中天弘中证500指数量化增强型证券投资基金A类基金份额48,743,845.18份，天弘中证500指数量化增强型证券投资基金C类基金份额121,585,552.26份。

2.本基金的合同生效日为2025年09月12日，无上一年度可比期间(下同)。

6.2 利润表

会计主体：天弘中证500指数量化增强型证券投资基金

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2026年01月01日至2026年0 6月30日
一、营业总收入		37,415,540.33
1.利息收入		25,101.09
其中：存款利息收入	6.4.7.9	19,640.41
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		5,460.68
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		32,329,196.91
其中：股票投资收益	6.4.7.10	30,914,926.86
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	2,985.76
资产支持证券投资收益	6.4.7.12	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-
衍生工具收益	6.4.7.14	277,471.82
股利收益	6.4.7.15	1,133,812.47
其他投资收益		-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	5,032,806.89
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	28,435.44
减：二、营业总支出		1,079,531.88
1.管理人报酬		659,306.50
2.托管费		82,413.32
3.销售服务费		254,260.84
4.投资顾问费		-
5.利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6.信用减值损失	6.4.7.18	-
7.税金及附加		4,200.49
8.其他费用	6.4.7.19	79,350.73
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		36,336,008.45
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		36,336,008.45
五、其他综合收益的税后净额		-

六、综合收益总额		36,336,008.45
----------	--	---------------

6.3 净资产变动表

会计主体：天弘中证500指数量化增强型证券投资基金

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	151,512,760.59	4,677,105.90	156,189,866.49
二、本期期初净资产	151,512,760.59	4,677,105.90	156,189,866.49
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	18,816,636.85	43,057,398.32	61,874,035.17
（一）、综合收益总额	-	36,336,008.45	36,336,008.45
（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）	18,816,636.85	6,721,389.87	25,538,026.72
其中：1.基金申购款	225,259,788.21	38,593,799.14	263,853,587.35
2.基金赎回款	-206,443,151.36	-31,872,409.27	-238,315,560.63
（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	170,329,397.44	47,734,504.22	218,063,901.66

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

高阳	迟哲	薄贺龙
-----	-----	-----
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

天弘中证500指数量化增强型证券投资基金（以下简称“本基金”）系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2025]1491号《关于准予天弘中证500指数量化增强型证券投资基金注册的批复》的准许，由基金管理人天弘基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于2025年09月12日正式生效，首次设立募集规模为401,199,581.67份基金份额。本基金的运作方式为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为天弘基金管理有限公司，基金托管人为江苏银行股份有限公司。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票（包括创业板及其他经中国证监会允许上市的股票、存托凭证）、港股通标的股票、债券（包括国债、金融债、地方政府债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券）、货币市场工具、同业存单、银行存款、债券回购、国债期货、股指期货、股票期权、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金可以根据相关法律法规的规定参与融资和转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金投资于股票的资产不低于基金资产的80%，其中投资于港股通标的股票比例占股票资产的0%-50%，投资于标的指数成份股、备选成份股的资产的比例不低于非现金基金资产的80%；每个交易日日终在扣除国债期货、股指期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、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。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会发布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证

券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第2号——定期报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则第3号〈会计报表附注的编制及披露〉》，中国证券投资基金业协会发布的《公开募集证券投资基金信息披露XBRL模板第3号——年度报告和中期报告》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2026年度上半年财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2026年06月30日的财务状况以及2026年度上半年的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

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

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

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2014]81号文《关于沪港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、财税[2016]127号文《关于深港股票市场交易互联互通机制试点有关税收政策的通知》、深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、中投信〔2021〕20号《关于香港联合交易所有限公司上调股票交易印花税率有关提示的通知》、财政部税务总局公告

2023年第2号《关于延续实施有关个人所得税优惠政策的公告》、财政部 税务总局 中国证监会公告2023年第23号《关于延续实施沪港、深港股票市场交易互联互通机制和内地与香港基金互认有关个人所得税政策的公告》、财税[2023] 39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部 税务总局公告2024年第8号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2025] 4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

a) 本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照3%的规定征收率计算缴纳增值税。

本基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入，自2026年1月1日至2027年12月31日，免征增值税；对金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。自2025年8月8日起，对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在2025年8月8日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。本基金管理人运营本基金提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

b) 对投资者从本基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

对本基金从中国内地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。

c) 对本基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内（含1个月）的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年（含1年）的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对本基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

对本基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向本基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市H股取得的股息红利，H股公司应向中国证券登记结算有限责任公司（以下简称中国结算）提出申请，由中国结算向H股公司提供内地个人投资者名册，H股公司按照20%的税率代扣个人所得税。内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市的非H股取得的股息红利，由中国结算按照20%的税率代扣个人所得税。对本基金通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的股息红利所得，按照上述规定计征个人所得税。

对内地个人投资者通过沪港通、深港通投资香港联交所上市股票取得的转让差价所得和通过基金互认买卖香港基金份额取得的转让差价所得，继续暂免征收个人所得税，执行至2027年12月31日。

d) 本基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。对于本基金通过沪港通、深港通买卖、继承、赠与联交所上市股票，按照香港特别行政区现行税法规定缴纳印花税。

e) 对本基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照本基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日
活期存款	12,452,894.96
等于：本金	12,451,552.87
加：应计利息	1,342.09
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	15,341,405.77
等于：本金	15,341,015.38
加：应计利息	390.39
减：坏账准备	-
合计	27,794,300.73

注：其他存款为存放在证券经纪商证券资金账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026年06月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		179,067,599.23	-	186,958,315.47	7,890,716.24
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	70,000.00	2.85	70,002.85	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	70,000.00	2.85	70,002.85	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		179,137,599.23	2.85	187,028,318.32	7,890,716.24

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

6.4.7.3.1 衍生金融资产/负债期末余额

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	18,547,680.00	-	-	-
--股指期货	18,547,680.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	18,547,680.00	-	-	-

6.4.7.3.2 期末基金持有的期货合约情况

单位：人民币元

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值	公允价值变动
IC2607	IC2607	7.00	12,499,480.00	804,000.00
IC2608	IC2608	3.00	5,307,840.00	157,080.00
IC2609	IC2609	1.00	1,752,280.00	50,840.00
合计				1,011,920.00
减：可抵销 期货暂收 款				1,011,920.00
净额				-

注：1、买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

2、衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为0。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-

应付交易费用	-
其中：交易所市场	-
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	79,343.16
其他应付款	10,259.05
合计	89,602.21

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 天弘中证500指数量化增强A

金额单位：人民币元

项目 (天弘中证500指数量化增强 A)	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	10,179,453.91	10,179,453.91
本期申购	58,209,569.52	58,209,569.52
本期赎回（以“-”号填列）	-19,645,178.25	-19,645,178.25
本期末	48,743,845.18	48,743,845.18

6.4.7.7.2 天弘中证500指数量化增强C

金额单位：人民币元

项目 (天弘中证500指数量化增强 C)	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	141,333,306.68	141,333,306.68
本期申购	167,050,218.69	167,050,218.69
本期赎回（以“-”号填列）	-186,797,973.11	-186,797,973.11
本期末	121,585,552.26	121,585,552.26

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500指数量化增强A

单位：人民币元

项目 (天弘中证500指数量 化增强A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	274,297.20	51,926.56	326,223.76
本期期初	274,297.20	51,926.56	326,223.76
本期利润	6,345,862.96	1,008,894.35	7,354,757.31
本期基金份额交易产 生的变动数	6,333,394.08	-208,924.24	6,124,469.84
其中：基金申购款	9,658,353.00	2,897.02	9,661,250.02
基金赎回款	-3,324,958.92	-211,821.26	-3,536,780.18
本期已分配利润	-	-	-
本期末	12,953,554.24	851,896.67	13,805,450.91

6.4.7.8.2 天弘中证500指数量化增强C

单位：人民币元

项目 (天弘中证500指数量 化增强C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	3,633,394.70	717,487.44	4,350,882.14
本期期初	3,633,394.70	717,487.44	4,350,882.14
本期利润	24,957,338.60	4,023,912.54	28,981,251.14
本期基金份额交易产 生的变动数	3,223,471.53	-2,626,551.50	596,920.03
其中：基金申购款	28,652,765.25	279,783.87	28,932,549.12
基金赎回款	-25,429,293.72	-2,906,335.37	-28,335,629.09
本期已分配利润	-	-	-
本期末	31,814,204.83	2,114,848.48	33,929,053.31

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2026年01月01日至2026年06月30日
活期存款利息收入	8,243.23
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	5,399.49
结算备付金利息收入	5,997.69
其他	-
合计	19,640.41

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
卖出股票成交总额	577,311,205.38
减：卖出股票成本总额	545,809,044.54
减：交易费用	587,233.98
买卖股票差价收入	30,914,926.86

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
债券投资收益——利息收入	3.03
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	2,982.73
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	2,985.76

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2026年01月01日至2026年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	5,883.32
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	2,900.00
减：应计利息总额	0.18
减：交易费用	0.41
买卖债券差价收入	2,982.73

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期未取得资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期未取得贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期未取得买卖权证差价收入。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
期货投资	277,471.82

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
股票投资产生的股利收益	1,133,812.47
其中：证券出借权益补偿收入	-

基金投资产生的股利收益	-
合计	1,133,812.47

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
1.交易性金融资产	4,597,136.12
——股票投资	4,597,136.12
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	435,670.77
——权证投资	-
——期货投资	435,670.77
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	5,032,806.89

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
基金赎回费收入	27,655.94
基金转换费收入	779.50
合计	28,435.44

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内未发生信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
审计费用	19,835.79
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
存托服务费	7.57
合计	79,350.73

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
天弘基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
江苏银行股份有限公司	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

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	659,306.50
其中：应支付销售机构的客户维护费	289,161.37
应支付基金管理人的净管理费	370,145.13

注:1、支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值0.80%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬＝前一日基金资产净值×该日适用费率/当年天数。

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	82,413.32

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

6.4.10.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2026年01月01日至2026年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	天弘中证500指数量化增强A	天弘中证500指数量化增强C	合计
天弘基金管理有限公司	-	718.86	718.86
江苏银行股份有限公司	-	229,675.99	229,675.99
合计	-	230,394.85	230,394.85

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500指数量化增强C的销售服务费率为0.40%。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500指数量化增强A不收取销售服务费。

3、根据《公开募集证券投资基金销售费用管理规定》,自该规定施行之日起,或对于已发售基金,自其完成基金合同修订及相关调整之日起,投资人通过基金管理人认购/申购的或者通过代销机构认购/申购且持续持有期限超过一年的基金份额不收取销售服务费。本基金按照该法规要求对不应收取的销售服务费将在投资者赎回基金份额或基金合同终止时随赎回款或清算款一并返还给投资者。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末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500指数量化增强A

本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

天弘中证500指数量化增强C

本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期	
	2026年01月01日至2026年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
江苏银行股份有限公司	12,452,894.96	8,243.23

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期未在承销期内参与关联方承销证券交易。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期无利润分配事项。

6.4.12 期末（2026年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688795	摩尔线程	2025-11-26	9个月	新股流通受限	114.28	676.94	640	73,139.20	433,241.60	-
688802	沐曦股份	2025-12-09	9个月	新股流通受限	104.66	768.89	466	48,771.56	358,302.74	-
301666	大普微	2026-04-08	6个月	新股流通受限	46.08	463.33	227	10,460.16	105,175.91	-
688790	昂瑞微	2025-12-09	9个月	新股流通受限	83.06	126.45	522	43,357.32	66,006.90	-
688808	联讯仪器	2026-04-16	6个月	新股流通受限	81.88	1,584.33	40	3,275.20	63,373.20	-
688781	视涯科技	2026-03-18	9个月	新股流通受限	22.68	42.16	1,403	31,820.04	59,150.48	-
001248	华润新能源	2026-06-24	6个月	新股流通受限	10.11	10.11	5,534	55,948.74	55,948.74	-
688797	C臻宝	2026-06-16	6个月	新股流通	44.56	468.67	69	3,074.64	32,338.23	-

				受限						
688820	盛合晶微	2026-04-13	6个月	新股流通受限	19.68	141.49	222	4,368.96	31,410.78	-
001399	C惠科	2026-06-16	6个月	新股流通受限	10.12	27.73	934	9,452.08	25,899.82	-
001248	华润新能源	2026-06-24	1个月内(含)	新股未上市	10.11	10.11	2,371	23,970.81	23,970.81	-
688818	电科蓝天	2026-02-03	6个月	新股流通受限	9.47	70.14	322	3,049.34	22,585.08	-
301682	宏明电子	2026-03-18	6个月	新股流通受限	69.66	160.06	135	9,404.10	21,608.10	-
688635	长进光子	2026-05-20	6个月	新股流通受限	40.98	308.19	69	2,827.62	21,265.11	-
688813	泰金新能	2026-03-24	6个月	新股流通受限	26.28	172.09	111	2,917.08	19,101.99	-
688712	北芯生命	2026-01-28	6个月	新股流通受限	17.52	35.92	425	7,446.00	15,266.00	-
001257	盛龙股份	2026-03-24	6个月	新股流通受限	7.82	20.74	617	4,824.94	12,796.58	-
688785	恒运昌	2026-01-20	6个月	新股流通受限	92.18	463.15	26	2,396.68	12,041.90	-
688811	有研复材	2026-04-0	6个月	新股流通	6.41	24.13	465	2,980.65	11,220.45	-

		1		受限						
301687	新广益	2025-12-24	6个月	新股流通受限	21.93	77.78	138	3,026.34	10,733.64	-
301669	高特电子	2026-06-02	6个月	新股流通受限	7.08	28.40	329	2,329.32	9,343.60	-
301531	春光集团	2026-04-28	6个月	新股流通受限	13.30	51.56	180	2,394.00	9,280.80	-
301696	三瑞智能	2026-03-31	6个月	新股流通受限	24.68	86.80	94	2,319.92	8,159.20	-
603459	红板科技	2026-03-31	6个月	新股流通受限	17.70	84.32	94	1,663.80	7,926.08	-
603407	长裕集团	2026-04-29	6个月	新股流通受限	13.86	73.46	102	1,413.72	7,492.92	-
301599	理奇智能	2026-04-22	6个月	新股流通受限	13.91	32.47	197	2,740.27	6,396.59	-
001365	天海电子	2026-05-11	6个月	新股流通受限	27.19	31.31	173	4,703.87	5,416.63	-
301513	尚水智能	2026-04-10	6个月	新股流通受限	26.66	50.96	101	2,692.66	5,146.96	-
001393	维通利	2026-05-08	6个月	新股流通受限	30.38	38.99	121	3,675.98	4,717.79	-
001237	惠康科技	2026-05-1	6个月	新股流通	53.26	58.74	73	3,887.98	4,288.02	-

		5		受限						
301683	慧谷新材	2026-03-24	6个月	新股流通受限	78.38	121.77	35	2,743.30	4,261.95	-
603435	嘉德利	2026-05-15	6个月	新股流通受限	15.76	46.71	77	1,213.52	3,596.67	-
688816	易思维	2026-02-04	6个月	新股流通受限	55.95	57.10	48	2,685.60	2,740.80	-
601112	振石股份	2026-01-21	6个月	新股流通受限	11.18	17.59	91	1,017.38	1,600.69	-
603352	至信股份	2026-01-08	6个月	新股流通受限	21.88	25.52	47	1,028.36	1,199.44	-
603293	埃泰克	2026-04-09	6个月	新股流通受限	33.49	33.93	28	937.72	950.04	-
001312	福恩股份	2026-04-14	6个月	新股流通受限	18.38	16.78	56	1,029.28	939.68	-
603284	林平发展	2026-02-03	6个月	新股流通受限	37.88	34.87	23	871.24	802.01	-
001220	世盟股份	2026-01-27	6个月	新股流通受限	28.00	27.78	24	672.00	666.72	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
1137	春风	2026	1个月内	新债	100.0	100.0	570	57,00	57,00	-

04	转债	-06-10	(含)	未上市	0	0		0.00	2.62	
118071	华峰转债	2026-06-23	1个月内(含)	新债未上市	100.00	100.00	130	13,000.00	13,000.23	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型指数基金，采用指数复制投资策略，按照个股在标的指数中的基准权重构建股票组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应地调整，以复制和跟踪标的指数。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，力争获取高于标的指数的投资收益。

本基金管理人按照“全面管理、专业分工、各司其职”的思路，明确风险管理职责并将其融入组织架构、写入制度、嵌入系统，实施多层次、多角度、全方位的风险管理。一是投资决策实施分层授权管理，投资决策委员会、投资总监、投资部门负责人和基金经理对投资行为及相关风险进行管理、监控，根据不同权限实施风险控制；二是按照部门职能执行分工管理，基金经理、中央交易室、研究相关部门、风险管理部、内控合规部、基金运营部等从不同角度、不同环节对投资全过程实行风险监控和管理；三是投资

到结算的全流程，已经形成了一套贯穿“事前风险定位、事中风险管理和事后风险评估”的健全风险监控体系。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级的债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级的同业存单。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
AAA	-	-
AAA以下	70,002.85	-
未评级	-	-
合计	70,002.85	-

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级的同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

本基金于报告期末的卖出回购金融资产款（若有）计息且利息金额不重大；本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（净资产）无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。本期末，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合法律法规的相关要求。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。本期末，本基金组合资产中7个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了交易对手管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的管理人定期对组合中债券投资和资产支持证券投资部分面临的利率风险进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026年06月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	27,794,300.73	-	-	-	27,794,300.73
结算备付金	2,108,679.08	-	-	-	2,108,679.08
存出保证金	-	-	-	2,347,152.00	2,347,152.00
交易性金融资产	-	-	70,002.85	186,958,315.47	187,028,318.32
应收申购款	-	-	-	1,848,504.43	1,848,504.43
资产总计	29,902,979.81	-	70,002.85	191,153,971.90	221,126,954.56
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,778,171.32	2,778,171.32
应付管理人报酬	-	-	-	131,128.05	131,128.05
应付托管费	-	-	-	16,391.02	16,391.02
应付销售服务费	-	-	-	47,760.30	47,760.30
其他负债	-	-	-	89,602.21	89,602.21
负债总计	-	-	-	3,063,052.90	3,063,052.90
利率敏感度缺口	29,902,979.81	-	70,002.85	188,090,919.00	218,063,901.66
上年度末 2025年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	19,752,290.74	-	-	-	19,752,290.74
结算备付金	2,889,363.45	-	-	-	2,889,363.45
存出保证金	-	-	-	1,610,323.20	1,610,323.20

交易性金融资产	-	-	-	134,466,188.99	134,466,188.99
买入返售金融资产	9,995,657.26	-	-	-	9,995,657.26
应收申购款	-	-	-	925,745.63	925,745.63
资产总计	32,637,311.45	-	-	137,002,257.82	169,639,569.27
负债					
应付赎回款	-	-	-	13,198,156.57	13,198,156.57
应付管理人报酬	-	-	-	127,864.74	127,864.74
应付托管费	-	-	-	15,983.09	15,983.09
应付销售服务费	-	-	-	60,447.60	60,447.60
应交税费	-	-	-	7,250.78	7,250.78
其他负债	-	-	-	40,000.00	40,000.00
负债总计	-	-	-	13,449,702.78	13,449,702.78
利率敏感度缺口	32,637,311.45	-	-	123,552,555.04	156,189,866.49

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2026年06月30日，本基金持有的交易性债券投资占基金净资产的比例为0.03%(2025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(2025年12月31日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

本基金持有不以记账本位币计价的资产，因此存在相应的外汇风险。本基金管理人每日对本基金的外汇头寸进行监控。

6.4.13.4.2.1 外汇风险敞口

于2026年06月30日，本基金的所有资产及负债以人民币计价(2025年12月31日：同)。

6.4.13.4.2.2 外汇风险的敏感性分析

于2026年06月30日，本基金的所有资产及负债以人民币计价(2025年12月31日：同)，因此无重大外汇风险(2025年12月31日：同)。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金采用指数增强型投资策略，以中证500指数作为基金投资组合的标的指数，结合深入的宏观面、基本面研究及数量化投资技术，在指数化投资基础上优化调整投资组合。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于股票的资产不低于基金资产的80%，其中投资于港股通标的股票比例占股票资产的0%-50%，投资于标的指数成份股、备选成份股的资产的比例不低于非现金基金资产的80%；每个交易日日终在扣除国债期货、股指期货和股票期权合约需缴纳的交易保证金后，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日		上年度末 2025年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	186,958,315.47	85.74	134,466,188.99	86.09
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-

合计	186,958,315.47	85.74	134,466,188.99	86.09
----	----------------	-------	----------------	-------

注：1、其他包含在期货交易所交易的期货投资(附注6.4.7.3)。在当日无负债结算制度下，期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为0。

2、由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位：人民币元)	
		本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
	业绩比较基准上升5%	11,498,796.03	7,658,158.91
	业绩比较基准下降5%	-11,498,796.03	-7,658,158.91

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

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

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
第一层次	185,471,950.82	133,833,739.79
第二层次	149,922.40	-
第三层次	1,406,445.10	632,449.20
合计	187,028,318.32	134,466,188.99

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	186,958,315.47	84.55
	其中：股票	186,958,315.47	84.55
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	70,002.85	0.03
	其中：债券	70,002.85	0.03
	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	29,902,979.81	13.52
8	其他各项资产	4,195,656.43	1.90
9	合计	221,126,954.56	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	3,934.00	0.00
B	采矿业	5,442,775.00	2.50
C	制造业	135,349,478.30	62.07
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,933,923.00	2.26
E	建筑业	2,390,171.00	1.10
F	批发和零售业	4,758,416.00	2.18
G	交通运输、仓储和邮政业	2,840,586.00	1.30
H	住宿和餐饮业	102,543.00	0.05
I	信息传输、软件和信息技术服务业	10,823,276.79	4.96
J	金融业	8,936,752.60	4.10
K	房地产业	1,150,378.22	0.53
L	租赁和商务服务业	1,699,278.00	0.78
M	科学研究和技术服务业	558,332.30	0.26
N	水利、环境和公共设施管理业	1,575,691.60	0.72
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	233,236.00	0.11
S	综合	-	-

	合计	180,798,771.81	82.91
--	----	----------------	-------

7.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	98,340.58	0.05
C	制造业	4,895,815.81	2.25
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	242,095.55	0.11
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	473,148.00	0.22
G	交通运输、仓储和邮政业	2,341.72	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	437,306.00	0.20
J	金融业	2,482.00	0.00
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	1,980.00	0.00
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	2,676.00	0.00
S	综合	3,358.00	0.00
	合计	6,159,543.66	2.82

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	688498	源杰科技	1,376	2,595,136.00	1.19
2	001309	德明利	2,700	2,545,830.00	1.17
3	300604	长川科技	6,700	2,287,514.00	1.05
4	600105	永鼎股份	29,800	2,010,904.00	0.92
5	002851	麦格米特	12,000	2,006,160.00	0.92
6	300223	北京君正	7,900	1,966,310.00	0.90
7	300857	协创数据	5,620	1,910,238.00	0.88
8	300054	鼎龙股份	17,900	1,896,863.00	0.87
9	600498	烽火通信	25,600	1,884,160.00	0.86
10	688002	睿创微纳	11,665	1,804,458.85	0.83
11	688469	芯联集成	166,056	1,761,854.16	0.81
12	002008	大族激光	11,200	1,681,232.00	0.77
13	002281	光迅科技	6,500	1,670,110.00	0.77
14	300475	香农芯创	5,100	1,530,000.00	0.70
15	601108	财通证券	175,200	1,515,480.00	0.69
16	603290	斯达半导	9,700	1,483,518.00	0.68
17	688200	华峰测控	2,803	1,471,855.30	0.67
18	300136	信维通信	12,300	1,466,775.00	0.67
19	688220	翱捷科技	11,749	1,460,635.68	0.67
20	688120	华海清科	4,490	1,446,588.20	0.66
21	600601	方正科技	102,300	1,415,832.00	0.65
22	000034	神州数码	50,920	1,413,030.00	0.65
23	688347	华虹宏力	4,188	1,408,424.40	0.65
24	300666	江丰电子	3,800	1,400,680.00	0.64
25	002821	凯莱英	8,500	1,377,000.00	0.63
26	688301	奕瑞科技	11,037	1,368,588.00	0.63
27	300346	南大光电	14,700	1,361,955.00	0.62

28	000783	长江证券	139,100	1,356,225.00	0.62
29	002138	顺络电子	18,500	1,352,350.00	0.62
30	300757	罗博特科	2,129	1,317,851.00	0.60
31	002266	浙富控股	258,600	1,308,516.00	0.60
32	600392	盛和资源	43,000	1,280,110.00	0.59
33	000960	锡业股份	29,800	1,272,162.00	0.58
34	000519	中兵红箭	60,200	1,268,414.00	0.58
35	300458	全志科技	31,528	1,244,094.88	0.57
36	002517	恺英网络	75,800	1,231,750.00	0.56
37	688361	中科飞测	2,843	1,222,490.00	0.56
38	603179	新泉股份	24,260	1,204,509.00	0.55
39	601696	中银证券	94,300	1,192,895.00	0.55
40	601233	桐昆股份	54,700	1,184,255.00	0.54
41	000582	北部湾港	109,600	1,176,008.00	0.54
42	301536	星宸科技	9,100	1,171,261.00	0.54
43	000050	深天马 A	115,400	1,143,614.00	0.52
44	603308	应流股份	18,800	1,135,520.00	0.52
45	300620	光库科技	2,900	1,096,780.00	0.50
46	002432	九安医疗	15,500	1,095,540.00	0.50
47	300496	中科创达	17,500	1,081,325.00	0.50
48	688037	芯源微	2,457	1,078,745.85	0.49
49	688676	金盘科技	12,325	1,043,188.00	0.48
50	603486	科沃斯	20,500	1,040,375.00	0.48
51	688313	仕佳光子	5,604	1,034,778.60	0.47
52	000032	深桑达 A	41,200	1,027,940.00	0.47
53	688778	厦钨新能	18,894	1,027,833.60	0.47
54	688322	奥比中光	7,804	1,018,812.20	0.47
55	002841	视源股份	28,500	984,105.00	0.45
56	300487	蓝晓科技	16,500	971,025.00	0.45
57	603596	伯特利	38,800	963,792.00	0.44
58	002465	海格通信	75,000	957,750.00	0.44

59	300115	长盈精密	34,200	955,548.00	0.44
60	000739	普洛药业	56,700	944,622.00	0.43
61	300073	当升科技	19,400	931,976.00	0.43
62	601608	中信重工	194,200	926,334.00	0.42
63	600497	驰宏锌锗	75,500	914,305.00	0.42
64	300570	太辰光	3,700	912,827.00	0.42
65	603885	吉祥航空	88,300	908,607.00	0.42
66	688052	纳芯微	3,128	901,833.68	0.41
67	002436	兴森科技	17,700	901,815.00	0.41
68	600166	福田汽车	309,000	899,190.00	0.41
69	000830	鲁西化工	74,700	896,400.00	0.41
70	603659	璞泰来	30,900	893,937.00	0.41
71	600988	赤峰黄金	33,900	892,248.00	0.41
72	605358	立昂微	11,400	884,640.00	0.41
73	001286	陕西能源	86,600	878,124.00	0.40
74	688099	晶晨股份	8,469	871,460.10	0.40
75	002273	水晶光电	24,500	869,260.00	0.40
76	300548	长芯博创	3,100	861,800.00	0.40
77	603225	新凤鸣	43,700	858,705.00	0.39
78	300567	精测电子	2,700	857,520.00	0.39
79	300623	捷捷微电	19,000	854,810.00	0.39
80	300953	震裕科技	6,300	842,310.00	0.39
81	688188	柏楚电子	7,880	840,796.00	0.39
82	601179	中国西电	56,100	837,012.00	0.38
83	688777	中控技术	6,762	794,535.00	0.36
84	002064	华峰化学	83,700	794,313.00	0.36
85	600985	淮北矿业	54,900	771,345.00	0.35
86	688387	信科移动	38,840	770,585.60	0.35
87	689009	九号公司	20,171	769,523.65	0.35
88	002185	华天科技	34,300	765,233.00	0.35
89	603728	鸣志电器	12,400	755,408.00	0.35

90	300339	润和软件	19,600	754,796.00	0.35
91	000683	博源化工	130,900	753,984.00	0.35
92	300285	国瓷材料	7,300	753,214.00	0.35
93	688018	乐鑫科技	5,867	750,506.64	0.34
94	600153	建发股份	93,700	743,041.00	0.34
95	000831	中国稀土	12,800	710,272.00	0.33
96	000709	河钢股份	353,800	686,372.00	0.31
97	600863	华能蒙电	143,800	675,860.00	0.31
98	600606	绿地控股	549,700	665,137.00	0.31
99	300735	光弘科技	29,199	663,985.26	0.30
100	600352	浙江龙盛	54,700	662,417.00	0.30
101	603379	三美股份	8,700	660,243.00	0.30
102	603816	顾家家居	29,400	657,384.00	0.30
103	001203	大中矿业	21,900	655,905.00	0.30
104	002131	利欧股份	136,900	650,275.00	0.30
105	603345	安井食品	8,100	649,539.00	0.30
106	601611	中国核建	57,900	645,585.00	0.30
107	603939	益丰药房	35,800	643,684.00	0.30
108	600060	海信视像	22,900	638,223.00	0.29
109	688599	天合光能	44,968	634,948.16	0.29
110	600486	扬农化工	12,500	633,750.00	0.29
111	601555	东吴证券	80,000	633,600.00	0.29
112	600378	昊华科技	8,400	633,192.00	0.29
113	000921	海信家电	23,100	631,092.00	0.29
114	601399	国机重装	179,900	629,650.00	0.29
115	600208	衢州发展	221,500	626,845.00	0.29
116	002340	格林美	94,800	626,628.00	0.29
117	688281	华秦科技	12,468	626,267.64	0.29
118	601665	齐鲁银行	108,100	623,737.00	0.29
119	600879	航天电子	29,200	621,668.00	0.29
120	600642	申能股份	71,100	620,703.00	0.28

121	300001	特锐德	16,200	612,846.00	0.28
122	000883	湖北能源	141,400	610,848.00	0.28
123	688629	华丰科技	3,222	604,157.22	0.28
124	300763	锦浪科技	6,600	596,310.00	0.27
125	688615	合合信息	5,217	590,042.70	0.27
126	600704	物产中大	124,300	586,696.00	0.27
127	000786	北新建材	32,200	582,498.00	0.27
128	600711	盛屯矿业	52,800	579,216.00	0.27
129	600816	建元信托	236,400	576,816.00	0.26
130	000987	越秀资本	73,600	575,552.00	0.26
131	603606	东方电缆	13,860	575,328.60	0.26
132	300919	中伟新材	12,800	560,000.00	0.26
133	300207	欣旺达	29,300	556,407.00	0.26
134	688017	绿的谐波	1,327	554,500.22	0.25
135	301377	鼎泰高科	1,000	550,900.00	0.25
136	600109	国金证券	62,500	548,750.00	0.25
137	601869	长飞光纤	1,000	545,900.00	0.25
138	688336	三生国健	10,127	537,743.70	0.25
139	600688	上海石化	181,500	531,795.00	0.24
140	300679	电连技术	8,800	527,912.00	0.24
141	000060	中金岭南	68,900	521,573.00	0.24
142	300699	光威复材	18,000	515,700.00	0.24
143	300390	天华新能	5,500	514,305.00	0.24
144	000027	深圳能源	81,700	506,540.00	0.23
145	688027	国盾量子	1,000	504,010.00	0.23
146	601666	XD平煤股	70,300	502,645.00	0.23
147	300395	菲利华	3,700	494,801.00	0.23
148	688692	达梦数据	2,001	488,824.29	0.22
149	000629	钒钛股份	146,200	488,308.00	0.22
150	603920	世运电路	9,900	475,596.00	0.22
151	603806	福斯特	28,300	475,157.00	0.22

152	603298	杭叉集团	19,900	474,814.00	0.22
153	000932	华菱钢铁	136,300	472,961.00	0.22
154	002414	高德红外	35,100	465,426.00	0.21
155	688192	迪哲医药	11,599	463,148.07	0.21
156	301498	乖宝宠物	11,400	462,726.00	0.21
157	600535	天士力	33,700	445,851.00	0.20
158	600008	首创环保	163,400	444,448.00	0.20
159	600871	石化油服	216,900	440,307.00	0.20
160	301611	珂玛科技	2,400	432,168.00	0.20
161	601615	明阳智能	36,900	426,933.00	0.20
162	688172	燕东微	5,098	426,498.68	0.20
163	002299	圣农发展	28,000	424,480.00	0.19
164	002831	裕同科技	11,919	423,839.64	0.19
165	601699	XD潞安环	29,600	422,688.00	0.19
166	600637	东方明珠	50,600	420,486.00	0.19
167	002487	大金重工	7,200	417,384.00	0.19
168	601128	常熟银行	69,130	402,336.60	0.18
169	600316	洪都航空	14,400	402,336.00	0.18
170	300142	沃森生物	30,800	400,092.00	0.18
171	002407	多氟多	7,900	396,817.00	0.18
172	600595	中孚实业	69,600	391,152.00	0.18
173	688318	财富趋势	5,400	385,074.00	0.18
174	002025	航天电器	5,000	381,100.00	0.17
175	300024	机器人	19,700	380,801.00	0.17
176	601016	节能风电	97,700	379,076.00	0.17
177	000997	新大陆	23,100	376,530.00	0.17
178	688578	艾力斯	3,414	372,808.80	0.17
179	000733	振华科技	6,500	368,160.00	0.17
180	600499	科达制造	26,500	365,700.00	0.17
181	000591	太阳能	78,800	362,480.00	0.17
182	000728	国元证券	48,100	360,269.00	0.17

183	002409	雅克科技	1,600	359,200.00	0.16
184	002078	太阳纸业	28,700	358,463.00	0.16
185	600801	华新建材	22,800	355,680.00	0.16
186	000959	首钢股份	101,000	354,510.00	0.16
187	002120	韵达股份	55,600	353,616.00	0.16
188	300724	捷佳伟创	5,000	353,000.00	0.16
189	300759	康龙化成	12,000	347,160.00	0.16
190	300474	景嘉微	5,600	338,688.00	0.16
191	603737	三棵树	14,020	337,882.00	0.15
192	002271	东方雨虹	28,300	335,921.00	0.15
193	600546	山煤国际	30,700	335,551.00	0.15
194	600339	中油工程	103,500	317,745.00	0.15
195	603160	汇顶科技	5,000	308,550.00	0.14
196	301526	国际复材	6,600	308,022.00	0.14
197	603233	大参林	20,400	306,612.00	0.14
198	002056	横店东磁	10,000	304,800.00	0.14
199	002850	科达利	1,600	302,880.00	0.14
200	688234	天岳先进	1,714	297,396.14	0.14
201	688065	凯赛生物	6,200	296,670.00	0.14
202	603650	彤程新材	3,000	293,940.00	0.13
203	605589	圣泉集团	4,600	292,422.00	0.13
204	000893	亚钾国际	7,000	286,230.00	0.13
205	000967	盈峰环境	26,800	282,204.00	0.13
206	603077	和邦生物	120,600	279,792.00	0.13
207	300972	万辰集团	1,600	277,456.00	0.13
208	600885	宏发股份	8,000	275,920.00	0.13
209	688475	萤石网络	10,083	275,770.05	0.13
210	600312	平高电气	15,500	273,730.00	0.13
211	600299	安迪苏	34,700	272,395.00	0.12
212	603699	纽威股份	5,300	266,590.00	0.12
213	600292	电投水电	22,000	264,880.00	0.12

214	002244	滨江集团	34,600	262,960.00	0.12
215	002410	广联达	32,100	261,936.00	0.12
216	601155	新城控股	25,397	260,573.22	0.12
217	300454	深信服	2,700	259,740.00	0.12
217	000661	长春高新	3,900	259,740.00	0.12
218	600578	京能电力	40,200	259,290.00	0.12
219	603979	金诚信	4,300	253,829.00	0.12
220	002601	龙佰集团	14,900	245,552.00	0.11
221	002966	苏州银行	34,900	242,904.00	0.11
222	603565	中谷物流	23,900	234,459.00	0.11
223	688411	海博思创	800	232,960.00	0.11
224	300058	蓝色光标	16,900	232,544.00	0.11
225	600977	中国电影	17,900	231,268.00	0.11
226	600699	均胜电子	10,700	231,227.00	0.11
227	688166	博瑞医药	6,493	227,319.93	0.10
228	002429	兆驰股份	21,800	226,502.00	0.10
229	603119	浙江荣泰	3,300	218,922.00	0.10
230	600095	湘财股份	28,900	217,617.00	0.10
231	688169	石头科技	2,249	213,587.53	0.10
232	688266	泽璟制药	1,800	209,988.00	0.10
233	000559	万向钱潮	16,200	209,466.00	0.10
234	601997	贵阳银行	40,800	209,304.00	0.10
235	000738	航发控制	11,400	208,506.00	0.10
236	688248	南网科技	2,985	206,502.30	0.09
237	601212	白银有色	40,600	206,248.00	0.09
238	002568	百润股份	12,000	203,040.00	0.09
239	600808	马钢股份	79,700	199,250.00	0.09
240	300432	富临精工	9,700	194,873.00	0.09
241	002203	海亮股份	8,500	194,225.00	0.09
242	600363	联创光电	5,200	186,056.00	0.09
243	002265	建设工业	10,500	182,700.00	0.08

244	688568	XD中科星	4,200	174,174.00	0.08
245	000703	恒逸石化	12,700	172,339.00	0.08
246	002939	长城证券	20,500	170,970.00	0.08
247	000021	深科技	2,600	167,102.00	0.08
248	688582	芯动联科	2,500	162,500.00	0.07
249	601106	中国一重	49,200	162,360.00	0.07
250	002444	巨星科技	5,200	161,720.00	0.07
251	600282	南钢股份	34,800	159,732.00	0.07
252	601000	唐山港	38,200	158,530.00	0.07
253	300373	扬杰科技	1,000	157,230.00	0.07
254	600583	海油工程	30,200	151,906.00	0.07
255	002195	岩山科技	23,200	151,728.00	0.07
256	300748	金力永磁	4,700	144,995.00	0.07
257	688019	安集科技	400	135,784.00	0.06
258	600563	法拉电子	700	133,560.00	0.06
259	002402	和而泰	5,100	131,733.00	0.06
260	301358	湖南裕能	1,700	128,979.00	0.06
261	688213	思特威	1,200	128,484.00	0.06
262	300017	网宿科技	8,600	111,886.00	0.05
263	601577	长沙银行	12,800	111,488.00	0.05
264	002153	石基信息	15,300	110,619.00	0.05
265	000878	云南铜业	6,900	109,572.00	0.05
266	601958	金钼股份	3,800	106,818.00	0.05
267	600754	锦江酒店	5,700	102,543.00	0.05
268	600098	广州发展	16,900	99,879.00	0.05
269	000623	吉林敖东	5,400	95,742.00	0.04
270	600566	XD济川药	4,300	95,417.00	0.04
271	002773	康弘药业	4,500	92,025.00	0.04
272	600369	西南证券	22,800	91,656.00	0.04
273	300558	贝达药业	1,400	91,098.00	0.04
274	002126	银轮股份	1,800	89,640.00	0.04

275	003022	联泓新科	3,400	88,060.00	0.04
276	603766	隆鑫通用	7,200	85,896.00	0.04
277	000539	粤电力 A	12,000	81,720.00	0.04
278	002812	恩捷股份	1,200	80,292.00	0.04
279	688343	云天励飞	893	72,922.38	0.03
280	000415	渤海租赁	17,400	70,818.00	0.03
281	002738	中矿资源	1,100	64,889.00	0.03
282	600298	安琪酵母	1,700	61,540.00	0.03
283	600295	鄂尔多斯	5,400	57,888.00	0.03
284	300751	迈为股份	200	56,492.00	0.03
285	603256	宏和科技	200	53,066.00	0.02
286	001221	悍高集团	1,200	48,264.00	0.02
287	002624	完美世界	3,800	47,196.00	0.02
288	000887	中鼎股份	2,600	46,514.00	0.02
289	600909	华安证券	3,600	39,996.00	0.02
290	688772	珠海冠宇	2,000	39,260.00	0.02
291	600143	金发科技	2,500	38,625.00	0.02
292	600170	上海建工	17,100	37,962.00	0.02
293	600901	江苏金租	6,500	37,375.00	0.02
294	000729	燕京啤酒	3,100	31,403.00	0.01
295	603338	浙江鼎力	700	29,750.00	0.01
296	300677	英科医疗	700	27,419.00	0.01
297	600177	雅戈尔	3,400	25,602.00	0.01
298	003031	中瓷电子	100	18,030.00	0.01
299	000039	中集集团	1,900	15,409.00	0.01
300	600970	中材国际	1,900	13,547.00	0.01
301	688122	西部超导	200	12,562.00	0.01
302	601198	东兴证券	700	9,513.00	0.00
303	600141	兴发集团	200	9,394.00	0.00
304	000423	东阿阿胶	200	9,072.00	0.00
305	002335	科华数据	200	8,490.00	0.00

306	688819	天能股份	365	8,103.00	0.00
307	002032	苏泊尔	200	7,920.00	0.00
308	600256	广汇能源	1,600	7,904.00	0.00
309	600685	中船防务	300	7,632.00	0.00
310	002670	国盛证券	600	6,600.00	0.00
311	600765	中航重机	500	6,460.00	0.00
312	300383	光环新网	500	6,220.00	0.00
313	002252	上海莱士	1,400	6,076.00	0.00
314	000951	中国重汽	300	5,853.00	0.00
315	603087	甘李药业	100	5,676.00	0.00
316	002603	以岭药业	300	4,500.00	0.00
317	002065	东华软件	600	4,284.00	0.00
318	600483	福能股份	400	4,076.00	0.00
319	002157	正邦科技	1,400	3,934.00	0.00
320	000598	兴蓉环境	600	3,852.00	0.00
321	002461	珠江啤酒	500	3,785.00	0.00
322	600862	中航高科	200	3,606.00	0.00
323	601866	中远海发	1,600	3,536.00	0.00
324	300676	华大基因	100	3,506.00	0.00
325	601139	深圳燃气	600	3,396.00	0.00
326	601567	三星电气	200	2,988.00	0.00
327	601598	中国外运	600	2,976.00	0.00
328	603000	人民网	200	2,958.00	0.00
329	600873	梅花生物	400	2,940.00	0.00
330	002683	广东宏大	100	2,929.00	0.00
331	600521	华海药业	200	2,880.00	0.00
332	002152	广电运通	300	2,814.00	0.00
333	002312	川发龙蟒	300	2,751.00	0.00
334	600884	杉杉股份	200	2,710.00	0.00
335	002945	华林证券	200	2,686.00	0.00
336	002984	森麒麟	200	2,614.00	0.00

337	000785	居然智家	1,300	2,600.00	0.00
338	002223	鱼跃医疗	100	2,566.00	0.00
339	600038	中直股份	100	2,529.00	0.00
340	000009	中国宝安	400	2,492.00	0.00
341	002926	华西证券	300	2,451.00	0.00
342	688425	铁建重工	600	2,412.00	0.00
343	000528	柳 工	300	2,265.00	0.00
344	002085	万丰奥威	200	2,218.00	0.00
345	600967	内蒙一机	200	2,170.00	0.00
345	000400	许继电气	100	2,170.00	0.00
346	601991	大唐发电	300	2,124.00	0.00
347	000898	鞍钢股份	1,100	2,057.00	0.00
348	300140	节能环保	400	1,988.00	0.00
349	601098	中南传媒	200	1,968.00	0.00
350	002130	沃尔核材	100	1,896.00	0.00
351	600517	国网英大	400	1,872.00	0.00
352	300146	汤臣倍健	200	1,808.00	0.00
353	601001	晋控煤业	100	1,739.00	0.00
354	601156	东航物流	100	1,612.00	0.00
355	600602	云赛智联	100	1,608.00	0.00
356	601112	振石股份	91	1,600.69	0.00
357	300002	神州泰岳	200	1,562.00	0.00
358	600021	上海电力	100	1,507.00	0.00
359	000750	国海证券	400	1,472.00	0.00
360	601162	天风证券	400	1,348.00	0.00
360	601099	太平洋	400	1,348.00	0.00
361	000723	美锦能源	400	1,340.00	0.00
362	601880	辽港股份	900	1,242.00	0.00
363	003035	南网能源	200	1,164.00	0.00
364	601865	福莱特	100	1,051.00	0.00
365	600998	九州通	200	938.00	0.00

366	603568	伟明环保	20	307.60	0.00
-----	--------	------	----	--------	------

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600549	厦门钨业	9,300	792,360.00	0.36
2	002532	天山铝业	69,100	741,443.00	0.34
3	300450	先导智能	15,000	610,800.00	0.28
4	002294	信立泰	17,900	570,831.00	0.26
5	002080	中材科技	5,900	531,000.00	0.24
6	600739	辽宁成大	46,800	473,148.00	0.22
7	688795	摩尔线程	640	433,241.60	0.20
8	002558	巨人网络	15,500	427,180.00	0.20
9	688802	沐曦股份	466	358,302.74	0.16
10	000543	皖能电力	21,200	160,484.00	0.07
11	301666	大普微	227	105,175.91	0.05
12	300573	兴齐眼药	2,445	99,658.20	0.05
13	002837	英维克	1,250	99,450.00	0.05
14	002128	电投能源	3,700	85,544.00	0.04
15	001248	华润新能源	7,905	79,919.55	0.04
16	688790	昂瑞微	522	66,006.90	0.03
17	688808	联讯仪器	40	63,373.20	0.03
18	688781	视涯科技	1,403	59,150.48	0.03
19	688100	威胜信息	1,200	36,708.00	0.02
20	688797	C臻宝	69	32,338.23	0.01
21	688820	盛合晶微	222	31,410.78	0.01
22	001399	C惠科	934	25,899.82	0.01
23	688818	电科蓝天	322	22,585.08	0.01
24	301682	宏明电子	135	21,608.10	0.01

25	688635	长进光子	69	21,265.11	0.01
26	688813	泰金新能	111	19,101.99	0.01
27	002202	金风科技	725	17,327.50	0.01
28	688712	北芯生命	425	15,266.00	0.01
29	001257	盛龙股份	617	12,796.58	0.01
30	688785	恒运昌	26	12,041.90	0.01
31	688811	有研复材	465	11,220.45	0.01
32	301687	新广益	138	10,733.64	0.00
33	301669	高特电子	329	9,343.60	0.00
34	301531	春光集团	180	9,280.80	0.00
35	002439	启明星辰	700	8,855.00	0.00
36	301696	三瑞智能	94	8,159.20	0.00
37	603459	红板科技	94	7,926.08	0.00
38	603407	长裕集团	102	7,492.92	0.00
39	301599	理奇智能	197	6,396.59	0.00
40	001365	天海电子	173	5,416.63	0.00
41	301513	尚水智能	101	5,146.96	0.00
42	001393	维通利	121	4,717.79	0.00
43	001237	惠康科技	73	4,288.02	0.00
44	301683	慧谷新材	35	4,261.95	0.00
45	603435	嘉德利	77	3,596.67	0.00
46	600673	东阳光	100	3,358.00	0.00
47	600361	创新新材	800	2,880.00	0.00
48	688816	易思维	48	2,740.80	0.00
49	601921	浙版传媒	400	2,676.00	0.00
50	000563	陕国投 A	800	2,208.00	0.00
51	002607	中公教育	1,100	1,980.00	0.00
52	600528	中铁工业	300	1,977.00	0.00
53	000958	电投产融	300	1,692.00	0.00
54	001213	中铁特货	500	1,675.00	0.00
55	603927	中科软	100	1,271.00	0.00

56	603352	至信股份	47	1,199.44	0.00
57	603293	埃泰克	28	950.04	0.00
58	001312	福恩股份	56	939.68	0.00
59	603284	林平发展	23	802.01	0.00
60	001220	世盟股份	24	666.72	0.00
61	002958	青农商行	100	274.00	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	002851	麦格米特	4,868,381.00	3.12
2	600498	烽火通信	4,409,715.00	2.82
3	605358	立昂微	4,379,943.64	2.80
4	000960	锡业股份	3,647,355.00	2.34
5	002008	大族激光	3,638,814.00	2.33
6	688017	绿的谐波	3,627,248.58	2.32
7	002281	光迅科技	3,624,242.00	2.32
8	601231	环旭电子	3,621,416.99	2.32
9	600392	盛和资源	3,461,705.00	2.22
10	600549	厦门钨业	3,438,329.00	2.20
11	688037	芯源微	3,307,345.98	2.12
12	002185	华天科技	3,281,567.00	2.10
13	002080	中材科技	3,242,606.00	2.08
14	300570	太辰光	3,184,819.52	2.04
15	688777	中控技术	3,178,931.44	2.04
16	000831	中国稀土	3,139,280.00	2.01
17	600563	法拉电子	3,127,598.00	2.00
18	603179	新泉股份	3,102,163.40	1.99

19	002138	顺络电子	3,080,813.00	1.97
20	002156	通富微电	3,080,266.00	1.97

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	600487	亨通光电	5,574,009.50	3.57
2	002156	通富微电	5,275,145.70	3.38
3	002281	光迅科技	5,204,400.00	3.33
4	002008	大族激光	5,094,017.90	3.26
5	600549	厦门钨业	4,878,611.00	3.12
6	605358	立昂微	4,352,435.00	2.79
7	002851	麦格米特	3,961,762.00	2.54
8	688017	绿的谐波	3,738,691.32	2.39
9	003031	中瓷电子	3,693,983.00	2.37
10	601231	环旭电子	3,684,170.00	2.36
11	688525	佰维存储	3,669,787.53	2.35
12	002335	科华数据	3,636,602.10	2.33
13	300285	国瓷材料	3,496,058.00	2.24
14	002138	顺络电子	3,382,567.00	2.17
15	000831	中国稀土	3,332,926.00	2.13
16	600563	法拉电子	3,301,456.00	2.11
17	002080	中材科技	3,283,864.00	2.10
18	000657	中钨高新	3,214,913.00	2.06
19	002185	华天科技	3,155,121.00	2.02
20	000021	深科技	3,108,510.00	1.99

注：本项的"卖出金额"均按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	593,704,034.90
卖出股票收入（成交）总额	577,311,205.38

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	70,002.85	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	70,002.85	0.03

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113704	春风转债	570	57,002.62	0.03
2	118071	华峰转债	130	13,000.23	0.01

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金在进行股指期货投资时，将根据风险管理原则，以套期保值为主要目的，采用与中证500指数相关性高、流动性好、交易活跃的期货合约与现货资产进行匹配，通过多头或空头套期保值等策略进行套期保值操作。本基金投资于股指期货，对基金总体风险的影响十分有限，并符合基金合同的相关约定。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

7.12.2 基金投资的前十名股票，均为基金合同约定备选股票库之内的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,347,152.00
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,848,504.43
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,195,656.43

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持 有 人 户 数 (户)	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 00指 数量 化增 强A	461	105,735.02	22,274,452.88	45.7 0%	26,469,392.30	54.30%
天弘 中证5 00指 数量 化增 强C	2,0 87	58,258.53	-	-	121,585,552.26	100.00%

合计	2,498	68,186.31	22,274,452.88	13.08%	148,054,944.56	86.92%
----	-------	-----------	---------------	--------	----------------	--------

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500指数量化增强A	90,761.27	0.19%
	天弘中证500指数量化增强C	44,253.26	0.04%
	合计	135,014.53	0.08%

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500指数量化增强A	0
	天弘中证500指数量化增强C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	天弘中证500指数量化增强A	0~10
	天弘中证500指数量化增强C	0
	合计	0~10

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	天弘中证500指数量化	天弘中证500指数量化
--	-------------	-------------

	增强A	增强C
基金合同生效日(2025年09月12日)基金份额总额	11,354,066.76	389,845,514.91
本报告期期初基金份额总额	10,179,453.91	141,333,306.68
本报告期基金总申购份额	58,209,569.52	167,050,218.69
减：本报告期基金总赎回份额	19,645,178.25	186,797,973.11
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	48,743,845.18	121,585,552.26

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

本报告期内，托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略没有改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金所聘用的会计师事务所未发生变化。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

管理人受调查或处罚等情况	内容
受到调查或处罚等措施的主体	天弘基金管理有限公司
受到调查或处罚等措施的时间	2026年06月26日

采取调查或处罚等措施的机构	国家外汇管理局天津市分局
受到调查或处罚等措施类型	行政处罚
受到的具体措施类型	警告、罚款
受到调查或处罚等措施的原因	其他问题（报告报送的部分内容缺失）
受到处罚的依据	《中华人民共和国外汇管理条例》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	基金管理人已通过补充报送、优化流程等方式完成整改，整改成果已经国家外汇管理局天津市分局验收通过。
其他	-

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内托管人无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

10.7.1 基金租用或者通过证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东方财富证券	3	1,170,169,351.52	100.00%	223,660.50	100.00%	-

注：1、交易单元的选择标准：财务状况良好，经营行为规范，合规风控能力和交易、研究等服务能力较强；具有较强的综合服务能力，能及时、全面提供高质量的关于

宏观策略、行业、资本市场、个股分析的研究服务及丰富全面的信息咨询服务；具有较强的证券交易服务能力，能够提供安全、便捷、优质的证券交易服务及合理的佣金费率。

2、交易单元的选择程序：本基金管理人根据上述标准进行考察后，确定选用交易席位的证券经营机构，再和被选用的证券经营机构签订经纪服务协议。

10.7.2 基金租用或者通过证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
东方财富证券	5,883.32	100.00%	18,060,000.00	100.00%	-	-	-	-

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指数量化增强型证券投资基金2025年第4季度报告	中国证监会规定媒介	2026-01-22
2	天弘中证500指数量化增强型证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会规定媒介	2026-03-07
3	天弘中证500指数量化增强型证券投资基金2025年年度报告	中国证监会规定媒介	2026-03-31
4	天弘基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025年度）	中国证监会规定媒介	2026-03-31
5	天弘中证500指数量化增强型证券投资基金2026年第1季度报告	中国证监会规定媒介	2026-04-22
6	天弘基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定媒介	2026-04-27

7	2025年度天弘基金管理有限公司以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	中国证监会规定媒介	2026-04-30
8	天弘基金管理有限公司关于终止中证金牛（北京）基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会规定媒介	2026-05-29
9	天弘基金管理有限公司关于防范不法分子冒用公司名义进行诈骗活动的风险提示	中国证监会规定媒介	2026-06-13
10	天弘中证500指数量化增强型证券投资基金（A类份额）基金产品资料概要（更新）	中国证监会规定媒介	2026-06-26
11	天弘中证500指数量化增强型证券投资基金（C类份额）基金产品资料概要（更新）	中国证监会规定媒介	2026-06-26

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

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

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金注册的文件
- 2、基金合同
- 3、托管协议
- 4、招募说明书
- 5、报告期内在指定报刊上披露的各项公告

- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 7、中国证监会规定的其他文件

12.2 存放地点

天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层

12.3 查阅方式

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

公司网站：www.thfund.com.cn

天弘基金管理有限公司
二〇二六年八月三十一日