

天弘中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

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:光大证券股份有限公司

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。

基金托管人光大证券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	10
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	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	17
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	40
7.1 期末基金资产组合情况	40
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	40
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	42
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	51
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	53
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	53
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	53
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	53
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	53
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	54
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	54
7.12 投资组合报告附注	54
§8 基金份额持有人信息	55
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	55
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	55

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.....	55
§9 开放式基金份额变动.....	55
§10 重大事件揭示.....	56
10.1 基金份额持有人大会决议.....	56
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	56
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	56
10.4 基金投资策略的改变	56
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	56
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	56
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	57
10.8 其他重大事件	58
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	59
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.....	59
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	60
§12 备查文件目录.....	60
12.1 备查文件目录	61
12.2 存放地点.....	61
12.3 查阅方式.....	61

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	天弘中证1000增强策略ETF
场内简称	1000增强ETF天弘
基金主代码	159685
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2023年03月15日
基金管理人	天弘基金管理有限公司
基金托管人	光大证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	13,440,067.00份
基金合同存续期	不定期
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04月03日

2.2 基金产品说明

投资目标	在对标的指数进行有效跟踪被动投资基础上，通过量化策略进行组合投资，并结合增强型的主动投资力争获取超越业绩比较基准的超额收益，实现基金资产的长期增值。
投资策略	本基金采用指数增强型投资策略，以中证1000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，力争控制本基金份额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6.5%，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。主要产品投资策略包括：资产配置策略、股票投资策略、存托凭证投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、股票期权投资策略、国债期货投资策略、参与融资及转融通证券出借业务的投资策略。
业绩比较基准	中证1000指数收益率
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，其预期风险与收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

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	光大证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	童建林	李庆庆
	联系电话	022-83310208	021-22167432
	电子邮箱	service@thfund.com.cn	gztg@ebscn.com
客户服务电话		400-986-8888	021-22167436
传真		022-83865564	021-22167424
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	上海市新闻路1508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	上海市新闻路1508号
邮政编码		300203	200040
法定代表人		黄辰立	刘秋明

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告的	www.thfund.com.cn

管理人互联网网址	
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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

§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)
本期已实现收益	3,685,031.76
本期利润	4,283,745.90
加权平均基金份额本期利润	0.3100
本期加权平均净值利润率	20.11%
本期基金份额净值增长率	21.93%
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	9,014,798.30
期末可供分配基金份额利润	0.6707
期末基金资产净值	22,454,865.30
期末基金份额净值	1.6707
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	67.07%

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

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	15.64%	1.59%	15.62%	1.61%	0.02%	-0.02%
过去六个月	21.93%	1.63%	15.99%	1.62%	5.94%	0.01%
过去一年	50.64%	1.36%	38.60%	1.38%	12.04%	-0.02%
过去三年	65.15%	1.63%	33.44%	1.65%	31.71%	-0.02%
自基金合同 生效日起至 今	67.07%	1.57%	30.13%	1.60%	36.94%	-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



注：1、本基金合同于2023年03月15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		
林心龙	本基金基金经理	2025年01月11日	-	11年	男，光学工程专业硕士。历任南方基金管理股份有限公司研究员、新华基金管理股份有限公司基金经理助理。2019年8月加盟本公司，历任高级研究员。
杨超	量化投资部总经理、本基金基金经理	2023年03月15日	-	16年	男，金融数学与计算硕士。历任建信基金管理有限责任公司基金经理助理、泰达宏利基金管理有限公司基金经理。2019年1月加盟本公司，历任指数与数量投资部总经理。

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遵规守信情况的说明

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

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

本报告期内，本基金运作合法合规，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况，公司旗下各基金不存在因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，市场整体震荡上行，成长风格显著占优，市场结构分化延续扩大态势。具体来说：本报告期内，万得数据显示，中证全指上涨10.69%，沪深300上涨7.55%，中证500上涨20.97%，创业板指上涨35.58%，科创综指上涨53.99%，中证1000上涨15.99%。受益于增强策略的有效性，本基金在报告期内相较对标指数中证1000取得了一定程度的超额回报和正收益。未来我们将持续优化针对中证1000的增强选股策略，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，本基金份额净值为1.6707元，本报告期份额净值增长率21.93%，同期业绩比较基准增长率15.99%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2026年上半年，中国经济延续恢复态势，经济运行总体平稳。在全球经济增长放缓、国际贸易环境复杂变化的背景下，国内经济展现出较强韧性，产业升级和科技创新持续推进，新质生产力逐步成为经济增长的重要动力。同时，内需修复力度、房地产调整以及外部环境变化等因素仍对经济运行带来一定压力。经济运行方面，上半年我国工业生产保持稳定增长，规模以上工业增加值同比增长5.4%，其中制造业增加值同比增长5.6%，高技术制造业增加值同比增长13.3%，产业结构持续优化。消费方面，上半年社会消费品零售总额同比增长1.3%，网上商品零售额同比增长4.8%，消费需求保持恢复趋势，但居民消费信心和消费能力仍有进一步提升空间。整体来看，当前中国经济呈现生产端韧性较强、产业升级持续推进、需求端逐步修复的特点。资本市场方面，2026年上半年A股市场呈现明显结构分化特征，科技成长板块成为市场主要投资方向。上证指数整体表现平稳，创业板指、科创50指数表现相对突出，人工智能、半导体、通信设备等相关产业链受到市场重点关注，反映投资者对于科技创新、国产替代以及产业升级趋势的积极预期。相比之下，部分传统行业和消费板块表现相对偏弱，市场资金进一步向产业趋势明确、成长空间较大的方向集中。

展望2026年下半年，预计中国经济仍将处于温和复苏和结构转型阶段，政策支持、产业升级和科技创新将继续发挥重要作用。宏观政策方面，积极财政政策和适度宽松货币政策有望延续，通过扩大内需、推动产业升级以及稳定市场预期，为经济平稳运行提供支撑。随着政策效果逐步显现，消费需求有望进一步改善，制造业投资和产业升级相关投资仍有望保持较强韧性。科技创新和产业升级仍将是下半年资本市场的重要投资主线。人工智能领域，随着大模型技术持续迭代，AI应用从基础设施建设逐步向应用端拓展，算力、服务器、通信设备、半导体等产业链仍有较好的发展空间。同时，国产半导体产业链在政策支持和技术进步推动下持续完善，先进制造、关键设备和核心零部件领域具备长期成长潜力。高端制造领域，智能制造、工业机器人、航空航天、自动化设备等方向有望受益于制造业转型升级和设备更新需求。中国制造业正在由规模优势向技术和效率优势转变，具备全球竞争力的优势制造企业有望持续提升市场份额。新能源产业方面，经过前期快速发展和行业调整，产业链竞争格局逐步优化，技术进步和成本下降仍是长期发展趋势。新能源汽车、储能、智能电网等领域仍具备较好的产业前景，具备技术优势和成本优势的企业有望获得更好的发展机会。资本市场方面，随着国内经济逐步企稳、流动性环境保持合理充裕以及中长期资金持续入市，A股市场中长期投资价值有望进一步体现。从估值水平来看，当前市场整体估值仍处于相对合理区间，权益资产配置价值逐步提升。未来市场或仍将呈现结构分化特征，具备产业趋势、盈利成长能力

和竞争优势的优质企业有望获得更多关注。海外方面，全球经济仍面临一定不确定性。美国经济在高利率环境下逐步承压，同时财政赤字和债务压力增加，未来货币政策存在调整空间。全球流动性环境变化、国际贸易摩擦以及地缘政治风险仍可能对市场风险偏好造成扰动。国内方面，消费恢复节奏、房地产市场修复进程以及部分行业供需结构调整仍需持续关注。此外，部分科技成长板块经过阶段上涨后估值有所提升，后续市场表现仍需要产业趋势和企业盈利增长进一步验证。

总体来看，2026年下半年中国经济有望在政策支持和产业升级推动下保持稳健运行，资本市场仍具备结构性投资机会。在积极把握科技创新、高端制造和产业升级带来的长期机遇的同时，也需关注宏观环境变化和市场波动风险。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，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

本基金本报告期内存在连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元的情形，基金管理人已向中国证监会报告并采取适当措施。本报告期内，自2026年01月01日起至2026年06月30日，由本基金管理人承担本基金的信息披露费、审计费等固定费用，不再从基金资产中计提。

§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，光大证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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、基金费用开支、基金收益分配等方面进行了认真地复核，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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、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1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金
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	865,202.63	792,040.63
结算备付金		690,368.29	516,575.96
存出保证金		274,686.09	277,425.65
交易性金融资产	6.4.7.2	20,648,507.75	16,857,820.94
其中：股票投资		20,627,373.48	16,857,820.94
基金投资		-	-
债券投资		21,134.27	-
资产支持证券		-	-

投资			
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收清算款		131,167.27	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		22,609,932.03	18,443,863.18
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		128,771.44	5,175.30
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		9,787.56	7,639.97
应付托管费		1,957.52	1,527.99
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		1,341.39	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	13,208.82	14,317.97
负债合计		155,066.73	28,661.23
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	13,440,067.00	13,440,067.00

未分配利润	6.4.7.8	9,014,798.30	4,975,134.95
净资产合计		22,454,865.30	18,415,201.95
负债和净资产总计		22,609,932.03	18,443,863.18

注：报告截止日2026年06月30日，基金份额净值1.6707元，基金份额总额13,440,067.00份。

6.2 利润表

会计主体：天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金

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06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至202 5年06月30日
一、营业总收入		4,347,643.57	3,172,169.96
1.利息收入		7,250.50	8,936.62
其中：存款利息收入	6.4.7.9	7,250.50	8,936.62
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）		3,715,476.91	3,646,809.84
其中：股票投资收益	6.4.7.10	3,304,434.10	3,405,618.24
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	1.15	848.85
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	269,549.30	45,359.21
股利收益	6.4.7.15	141,492.36	194,983.54

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	598,714.14	-488,208.51
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	26,202.02	4,632.01
减：二、营业总支出		63,897.67	59,165.68
1.管理人报酬		52,438.53	49,157.63
2.托管费		10,487.62	9,831.48
3.销售服务费		-	-
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		971.52	176.57
8.其他费用	6.4.7.19	-	-
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		4,283,745.90	3,113,004.28
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		4,283,745.90	3,113,004.28
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		4,283,745.90	3,113,004.28

6.3 净资产变动表

会计主体：天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金

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	13,440,067.00	4,975,134.95	18,415,201.95
二、本期期初净资产	13,440,067.00	4,975,134.95	18,415,201.95
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-	4,039,663.35	4,039,663.35
（一）、综合收益总额	-	4,283,745.90	4,283,745.90
（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）	-	-244,082.55	-244,082.55
其中：1.基金申购款	4,000,000.00	2,162,153.51	6,162,153.51
2.基金赎回款	-4,000,000.00	-2,406,236.06	-6,406,236.06
（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	13,440,067.00	9,014,798.30	22,454,865.30
项 目	上年度可比期间		
	2025年01月01日至2025年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	21,440,067.00	-533,825.25	20,906,241.75
二、本期期初净资产	21,440,067.00	-533,825.25	20,906,241.75

三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-4,000,000.00	2,437,079.96	-1,562,920.04
（一）、综合收益总额	-	3,113,004.28	3,113,004.28
（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）	-4,000,000.00	-675,924.32	-4,675,924.32
其中：1.基金申购款	12,000,000.00	119,473.13	12,119,473.13
2.基金赎回款	-16,000,000.00	-795,397.45	-16,795,397.45
（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	17,440,067.00	1,903,254.71	19,343,321.71

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1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金（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[2022]3020号《关于准予天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》的准许，由基金管理人天弘基金管理有限公司向社会公开发行人募集，基金合同于2023年03月15日生效，首次设立募集规模为281,440,067.00份基金份额。本基金的运作方式为交易型开放式，

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，基金托管人为光大证券股份有限公司。

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（含主板、创业板及其他中国证监会注册或核准上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、地方政府债券、可转换债券、可交换债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、衍生品（包括股指期货、股票期权、国债期货）、资产支持证券、货币市场工具、同业存单、债券回购、银行存款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。本基金可根据法律法规的规定参与融资、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。本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的80%，投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产不低于非现金基金资产的80%，因法律法规规定而受限的情形除外。股指期货、国债期货、股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。如法律法规或中国证监会变更上述投资品种的比例限制，以变更后的比例为准，基金管理人在依法履行适当程序后，可对本基金的投资比例做相应调整。

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会发布的《中国证券监督管理委员会关于证券投资基金估值业务的指导意见》、《公开募集证券投资基金信息披露管理办法》、《公开募集证券投资基金信息披露内容与格式准则第2号——定期报告的内容与格式》、《证券投资基金信息披露编报规则第3号〈会计报表附注的编制及披露〉》，中国证券投资基金业协会发布的《公开募集证券投资基金信息披露XBRL模板第3号——年度报告和中期报告》以及中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的其他相关规定。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

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

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号文《关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2012]85号文《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部 税务总局公告2024年第8号《关于延续实施全国中小企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2025]4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

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

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

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

对投资者从本基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

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

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

d) 本基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日
活期存款	865,202.63
等于：本金	865,002.17
加：应计利息	200.46
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	865,202.63

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		19,941,296.62	-	20,627,373.48	686,076.86
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	13,800.00	1.15	21,134.27	7,333.12
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	13,800.00	1.15	21,134.27	7,333.12
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		19,955,096.62	1.15	20,648,507.75	693,409.98

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款估值增值。

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	1,671,880.00	-	-	-
--股指期货	1,671,880.00	-	-	-

其他衍生工具	-	-	-	-
合计	1,671,880.00	-	-	-

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
IM2607	IM2607	1.00	1,737,920.00	66,040.00
合计				66,040.00
减：可抵销 期货暂收 款				66,040.00
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	13,208.82
其中：交易所市场	13,208.82
银行间市场	-
应付利息	-
合计	13,208.82

6.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	13,440,067.00	13,440,067.00
本期申购	4,000,000.00	4,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-4,000,000.00	-4,000,000.00
本期末	13,440,067.00	13,440,067.00

6.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	6,436,722.92	-1,461,587.97	4,975,134.95
本期期初	6,436,722.92	-1,461,587.97	4,975,134.95
本期利润	3,685,031.76	598,714.14	4,283,745.90
本期基金份额交易产生的变动数	37,732.66	-281,815.21	-244,082.55
其中：基金申购款	2,647,352.06	-485,198.55	2,162,153.51
基金赎回款	-2,609,619.40	203,383.34	-2,406,236.06
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,159,487.34	-1,144,689.04	9,014,798.30

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	3,039.86
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	4,166.90
其他	43.74
合计	7,250.50

6.4.7.10 股票投资收益

6.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	3,137,797.93
股票投资收益——赎回差价收入	166,636.17
股票投资收益——申购差价收入	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	3,304,434.10

6.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
卖出股票成交总额	60,728,106.26
减：卖出股票成本总额	57,526,936.08
减：交易费用	63,372.25
买卖股票差价收入	3,137,797.93

6.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2026年01月01日至2026年06月30日
赎回基金份额对价总额	6,406,236.06
减：现金支付赎回款总额	3,073,063.06
减：赎回股票成本总额	3,166,536.83
减：交易费用	-
赎回差价收入	166,636.17

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	1.15
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
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	1.15

6.4.7.12 资产支持证券投资基金收益

本基金本报告期未取得资产支持证券投资基金收益。

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	269,549.30
------	------------

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	141,492.36
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	141,492.36

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	592,354.14
——股票投资	585,021.02
——债券投资	7,333.12
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	6,360.00
——权证投资	-
——期货投资	6,360.00
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	598,714.14

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	-
基金转换费收入	-
ETF基金替代损益	26,202.02
合计	26,202.02

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

基金固定费用为其他费用项下的“信息披露费”、“审计费”等费用，本报告期内，自2026年01月01日至2026年06月30日，本基金的固定费用由基金管理人承担。

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
光大证券股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至20 26年06月30日	上年度可比期间 2025年01月01日至20 25年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	52,438.53	49,157.63
其中：应支付销售机构的客户维护费	14,360.52	11,837.18
应支付基金管理人的净管理费	38,078.01	37,320.45

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

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2026年01月01日至2026年06月30日	2025年01月01日至2025年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	10,487.62	9,831.48

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2026年01月01日至2026年06月30日		2025年01月01日至2025年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入

光大证券 股份有限 公司	865,202.63	3,039.86	728,977.36	5,721.09
--------------------	------------	----------	------------	----------

注：本基金由基金托管人光大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

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券交易。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间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
001248	华润新能源	2026-06-23	1个月内（含）	新股未上市	10.11	10.11	500	5,055.00	5,055.00	-
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
118072	鼎通转债	2026-06-24	1个月内（含）	新债未上市	100.00	100.00	10	1,000.00	1,000.03	-

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

本基金是股票型指数基金，紧密跟踪标的指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似，本基金预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。本基金在对标的指数进行有效跟踪被动投资基础上，通过量化策略进行组合投资，并结合增强型的主动投资力争获取超越业绩比较基准的超额收益，实现基金资产的长期增值。

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光大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

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	21,134.27	-
未评级	-	-
合计	21,134.27	-

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来自调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金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。

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	865,202.63	-	-	-	865,202.63
结算备付金	690,368.29	-	-	-	690,368.29
存出保证金	13,998.09	-	-	260,688.00	274,686.09
交易性金融资产	-	-	21,134.27	20,627,373.48	20,648,507.75
应收清算款	-	-	-	131,167.27	131,167.27
资产总计	1,569,569.01	-	21,134.27	21,019,228.75	22,609,932.03
负债					
应付清算款	-	-	-	128,771.44	128,771.44
应付管理人报酬	-	-	-	9,787.56	9,787.56
应付托管费	-	-	-	1,957.52	1,957.52
应交税费	-	-	-	1,341.39	1,341.39
其他负债	-	-	-	13,208.82	13,208.82
负债总计	-	-	-	155,066.73	155,066.73

利率敏感度缺口	1,569,569.01	-	21,134.27	20,864,162.02	22,454,865.30
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	792,040.63	-	-	-	792,040.63
结算备付金	516,575.96	-	-	-	516,575.96
存出保证金	50,037.65	-	-	227,388.00	277,425.65
交易性金融资产	-	-	-	16,857,820.94	16,857,820.94
资产总计	1,358,654.24	-	-	17,085,208.94	18,443,863.18
负债					
应付清算款	-	-	-	5,175.30	5,175.30
应付管理人报酬	-	-	-	7,639.97	7,639.97
应付托管费	-	-	-	1,527.99	1,527.99
其他负债	-	-	-	14,317.97	14,317.97
负债总计	-	-	-	28,661.23	28,661.23
利率敏感度缺口	1,358,654.24	-	-	17,056,547.71	18,415,201.95

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0.09%(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。

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金采用指数增强型投资策略，以中证1000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。本基金投资于股票资产的比例不低于基金资产的80%，投资于标的指数成份股及其备选成份股的资产不低于非现金基金资产的80%，因法律法规规定而受限的情形除外。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	20,627,373.48	91.86	16,857,820.94	91.54
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	20,627,373.48	91.86	16,857,820.94	91.54

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%	1,188,268.13	852,989.10
	业绩比较基准下降5%	-1,188,268.13	-852,989.10

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	20,642,452.72	16,857,820.94
第二层次	6,055.03	-
第三层次	-	-
合计	20,648,507.75	16,857,820.94

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	20,627,373.48	91.23
	其中：股票	20,627,373.48	91.23
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	21,134.27	0.09
	其中：债券	21,134.27	0.09
	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	1,555,570.92	6.88
8	其他各项资产	405,853.36	1.80
9	合计	22,609,932.03	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	115,519.20	0.51
B	采矿业	807,965.00	3.60
C	制造业	13,915,945.56	61.97
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	445,873.00	1.99
E	建筑业	295,642.00	1.32
F	批发和零售业	367,421.00	1.64
G	交通运输、仓储和邮政业	490,069.72	2.18
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,797,098.00	8.00
J	金融业	468,710.00	2.09
K	房地产业	284,321.00	1.27
L	租赁和商务服务业	115,222.00	0.51
M	科学研究和技术服务业	42,794.00	0.19
N	水利、环境和公共设施管理业	259,200.00	1.15
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	302,576.00	1.35
S	综合	-	-
	合计	19,708,356.48	87.77

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	38,935.00	0.17

C	制造业	519,511.00	2.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	41,575.00	0.19
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	270,000.00	1.20
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	48,996.00	0.22
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	919,017.00	4.09

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	605376	博迁新材	1,800	488,340.00	2.17
2	603083	剑桥科技	1,500	382,305.00	1.70
3	688110	东芯股份	1,700	346,290.00	1.54

4	605111	新洁能	3,300	327,162.00	1.46
5	603283	赛腾股份	3,840	310,963.20	1.38
6	002643	万润股份	12,800	268,160.00	1.19
7	300323	华灿光电	13,100	267,240.00	1.19
8	603588	高能环境	13,500	259,200.00	1.15
9	300398	飞凯材料	4,100	253,175.00	1.13
10	688690	纳微科技	5,700	251,370.00	1.12
11	300613	富瀚微	3,100	248,248.00	1.11
12	002484	江海股份	2,300	241,500.00	1.08
13	603063	禾望电气	4,400	232,716.00	1.04
14	688262	国芯科技	5,300	229,119.00	1.02
15	688107	安路科技	4,800	218,880.00	0.97
16	000810	创维数字	16,300	215,975.00	0.96
17	300184	力源信息	12,300	215,865.00	0.96
18	300687	赛意信息	6,900	213,900.00	0.95
19	300806	斯迪克	1,900	212,800.00	0.95
20	002174	游族网络	16,700	210,587.00	0.94
21	300861	美畅股份	8,000	201,520.00	0.90
22	002948	青岛银行	39,400	200,152.00	0.89
23	002518	科士达	3,700	198,283.00	0.88
24	002716	湖南白银	24,500	198,205.00	0.88
25	600366	宁波韵升	13,500	198,180.00	0.88
26	300363	博腾股份	12,000	194,880.00	0.87
27	002077	大港股份	10,000	192,900.00	0.86
28	300102	乾照光电	7,400	192,696.00	0.86
29	603638	艾迪精密	8,200	192,290.00	0.86
30	002979	雷赛智能	3,400	189,652.00	0.84
31	002534	西子洁能	10,000	185,500.00	0.83
32	688559	海目星	2,200	184,624.00	0.82
33	688141	杰华特	1,200	184,200.00	0.82
34	301500	飞南资源	7,000	182,350.00	0.81

35	000990	诚志股份	21,900	179,142.00	0.80
36	600773	西藏城投	13,800	177,606.00	0.79
37	600961	株冶集团	5,400	174,906.00	0.78
38	300327	中颖电子	5,400	173,070.00	0.77
39	002840	华统股份	23,700	172,773.00	0.77
40	600971	恒源煤电	24,500	169,050.00	0.75
41	600929	雪天盐业	37,100	168,434.00	0.75
42	002947	恒铭达	2,200	167,310.00	0.75
43	600158	中体产业	24,800	167,152.00	0.74
44	002745	木林森	13,300	166,915.00	0.74
45	603567	珍宝岛	38,100	166,878.00	0.74
46	603317	天味食品	12,800	166,528.00	0.74
47	002563	森马服饰	32,900	165,816.00	0.74
48	300224	正海磁材	12,300	163,959.00	0.73
49	600888	新疆众和	10,200	162,078.00	0.72
50	603025	大豪科技	11,800	160,952.00	0.72
51	600509	天富能源	19,000	160,550.00	0.71
52	600746	江苏索普	30,000	156,900.00	0.70
53	600037	歌华有线	25,000	156,750.00	0.70
54	600320	振华重工	37,200	153,636.00	0.68
55	688766	普冉股份	200	153,320.00	0.68
56	688658	悦康药业	11,900	153,034.00	0.68
57	603162	海通发展	16,876	151,377.72	0.67
58	601208	东材科技	2,100	148,659.00	0.66
59	688779	五矿新能	17,646	143,109.06	0.64
60	688627	精智达	200	143,000.00	0.64
61	601975	招商南油	38,000	141,740.00	0.63
62	002396	星网锐捷	7,190	137,832.30	0.61
63	000543	皖能电力	18,200	137,774.00	0.61
64	300693	盛弘股份	2,800	136,500.00	0.61
65	688552	航天南湖	4,800	135,024.00	0.60

66	002922	伊戈尔	4,000	131,200.00	0.58
67	301510	固高科技	4,100	130,913.00	0.58
68	601858	中国科传	7,500	129,825.00	0.58
69	601969	海南矿业	16,400	129,724.00	0.58
70	002516	旷达科技	23,200	129,456.00	0.58
71	688123	聚辰股份	600	127,560.00	0.57
72	600123	兰花科创	23,500	125,490.00	0.56
73	002405	四维图新	19,200	124,224.00	0.55
74	000567	海德股份	20,600	122,982.00	0.55
75	300171	东富龙	11,000	121,660.00	0.54
76	601107	四川成渝	24,900	121,512.00	0.54
77	600963	岳阳林纸	38,400	116,736.00	0.52
78	601519	大智慧	13,500	116,505.00	0.52
79	002158	汉钟精机	3,100	114,948.00	0.51
80	002373	千方科技	16,000	114,880.00	0.51
81	601068	中铝国际	26,500	114,480.00	0.51
82	600075	新疆天业	27,900	112,716.00	0.50
83	002204	大连重工	21,100	111,408.00	0.50
84	002458	益生股份	13,960	108,469.20	0.48
85	605599	菜百股份	7,400	101,380.00	0.45
86	600072	中船科技	11,600	98,484.00	0.44
87	688182	灿勤科技	2,200	94,754.00	0.42
88	300085	银之杰	2,700	94,419.00	0.42
89	601101	昊华能源	8,800	92,928.00	0.41
90	688516	奥特维	1,600	91,824.00	0.41
91	600057	厦门象屿	16,400	88,888.00	0.40
92	688443	智翔金泰	3,800	88,350.00	0.39
93	600403	大有能源	16,400	86,756.00	0.39
94	603305	旭升集团	7,100	86,052.00	0.38
95	600094	大名城	24,800	85,808.00	0.38
96	601619	嘉泽新能	18,700	80,410.00	0.36

97	301678	新恒汇	1,000	78,840.00	0.35
98	688127	蓝特光学	800	78,080.00	0.35
99	688001	华兴源创	900	77,130.00	0.34
100	601677	明泰铝业	4,600	76,360.00	0.34
101	688668	鼎通科技	200	74,660.00	0.33
102	688536	思瑞浦	200	72,818.00	0.32
103	688167	炬光科技	200	70,842.00	0.32
104	688006	杭可科技	1,900	69,445.00	0.31
105	688433	华曙高科	800	68,480.00	0.30
106	300811	铂科新材	700	66,423.00	0.30
107	601918	新集能源	7,600	65,284.00	0.29
108	688390	固德威	600	65,106.00	0.29
109	603730	岱美股份	5,700	63,669.00	0.28
110	688097	博众精工	1,000	63,050.00	0.28
111	600395	盘江股份	13,500	61,560.00	0.27
112	300322	硕贝德	2,400	60,480.00	0.27
113	688062	迈威生物	2,100	59,325.00	0.26
114	002182	宝武镁业	3,700	57,609.00	0.26
115	000962	东方钽业	600	54,360.00	0.24
116	600206	有研新材	800	53,280.00	0.24
117	300682	朗新科技	5,100	50,490.00	0.22
118	002416	爱施德	5,600	50,176.00	0.22
119	000901	航天科技	2,600	46,254.00	0.21
120	000727	冠捷科技	16,900	46,137.00	0.21
121	301487	盟固利	2,400	45,960.00	0.20
122	002324	普利特	3,800	45,866.00	0.20
123	603915	国茂股份	3,200	45,408.00	0.20
124	000875	电投绿能	8,800	45,320.00	0.20
125	002163	海南发展	5,400	45,036.00	0.20
126	600063	皖维高新	5,900	44,840.00	0.20
127	300738	奥飞数据	2,200	44,484.00	0.20

128	002468	申通快递	2,800	40,768.00	0.18
129	300775	三角防务	1,800	39,672.00	0.18
130	688195	腾景科技	200	38,516.00	0.17
131	600114	东睦股份	1,000	37,760.00	0.17
132	603619	中曼石油	2,000	37,420.00	0.17
133	002993	奥海科技	500	35,805.00	0.16
134	002245	蔚蓝锂芯	1,900	35,549.00	0.16
135	600012	皖通高速	2,200	34,672.00	0.15
136	002317	众生药业	1,400	34,398.00	0.15
137	688586	江航装备	2,800	32,732.00	0.15
138	605118	力鼎光电	900	31,401.00	0.14
139	600330	天通股份	1,000	30,840.00	0.14
140	688549	中巨芯	800	29,448.00	0.13
141	688102	斯瑞新材	600	28,308.00	0.13
142	301071	力量钻石	300	27,750.00	0.12
143	002544	普天科技	1,500	27,330.00	0.12
144	601963	重庆银行	2,700	27,216.00	0.12
145	603929	亚翔集成	100	27,202.00	0.12
146	688545	兴福电子	200	26,612.00	0.12
147	688503	聚和材料	200	26,540.00	0.12
148	600654	中安科	9,900	26,334.00	0.12
149	000420	吉林化纤	6,500	26,325.00	0.12
150	300236	上海新阳	200	26,300.00	0.12
151	301215	中汽股份	4,600	23,874.00	0.11
152	301219	腾远钴业	400	21,920.00	0.10
153	000534	万泽股份	800	21,888.00	0.10
154	002254	泰和新材	1,200	21,828.00	0.10
155	300455	航天智装	1,000	21,540.00	0.10
156	002545	东方铁塔	1,300	21,086.00	0.09
157	000603	盛达资源	900	20,790.00	0.09
158	300602	飞荣达	400	20,480.00	0.09

159	600552	凯盛科技	600	19,548.00	0.09
160	002250	联化科技	1,400	19,138.00	0.09
161	688131	皓元医药	200	18,920.00	0.08
162	300342	天银机电	400	18,800.00	0.08
163	600266	城建发展	4,800	18,768.00	0.08
164	300772	运达股份	1,500	18,450.00	0.08
165	601636	旗滨集团	1,800	18,414.00	0.08
166	688700	东威科技	200	17,880.00	0.08
167	000970	中科三环	1,100	16,709.00	0.07
168	688717	艾罗能源	200	16,514.00	0.07
169	601777	千里科技	1,900	15,504.00	0.07
170	600338	西藏珠峰	1,000	15,240.00	0.07
171	600740	山西焦化	4,600	14,674.00	0.07
172	600226	亨通股份	1,500	14,385.00	0.06
173	000973	佛塑科技	1,000	14,350.00	0.06
174	300459	汤姆猫	4,100	13,899.00	0.06
175	002531	天顺风能	1,600	13,488.00	0.06
176	688400	凌云光	200	13,240.00	0.06
177	002838	道恩股份	400	12,248.00	0.05
178	688726	拉普拉斯	200	10,570.00	0.05
179	688523	航天环宇	200	10,480.00	0.05
180	600502	安徽建工	2,400	10,440.00	0.05
181	300353	东土科技	500	10,390.00	0.05
182	002017	东信和平	700	10,241.00	0.05
183	603663	三祥新材	100	9,630.00	0.04
184	603013	亚普股份	600	9,474.00	0.04
185	603496	恒为科技	400	9,192.00	0.04
186	301550	斯菱智驱	100	9,143.00	0.04
187	301275	汉朔科技	200	8,980.00	0.04
188	688165	埃夫特	400	8,160.00	0.04
189	605090	九丰能源	200	7,434.00	0.03

190	688352	颀中科技	300	7,254.00	0.03
191	300134	大富科技	800	6,840.00	0.03
192	603327	福蓉科技	800	6,784.00	0.03
193	002378	章源钨业	200	6,696.00	0.03
194	002041	登海种业	800	6,296.00	0.03
195	002895	川恒股份	200	5,840.00	0.03
196	002338	奥普光电	100	5,720.00	0.03
197	002345	潮宏基	600	5,502.00	0.02
198	001369	双欣材料	400	5,408.00	0.02
199	300253	卫宁健康	800	5,384.00	0.02
200	300341	麦克奥迪	400	5,300.00	0.02
201	300777	中简科技	200	5,256.00	0.02
202	002176	江特电机	500	5,005.00	0.02
203	601801	皖新传媒	1,000	4,930.00	0.02
204	601137	博威合金	200	4,466.00	0.02
205	002706	良信股份	400	4,364.00	0.02
206	601609	金田股份	400	4,320.00	0.02
207	002145	钛能化学	900	4,239.00	0.02
208	300049	福瑞医科	100	3,888.00	0.02
209	603698	航天工程	100	3,856.00	0.02
210	000923	河钢资源	300	3,723.00	0.02
211	300378	鼎捷数智	100	3,610.00	0.02
212	300357	我武生物	100	2,332.00	0.01
213	600064	南京高科	300	2,139.00	0.01
214	002004	华邦健康	500	1,965.00	0.01
215	002807	江阴银行	500	1,855.00	0.01
216	301153	中科江南	100	1,629.00	0.01
217	600882	妙可蓝多	100	1,599.00	0.01
218	601222	林洋能源	300	1,596.00	0.01
218	600596	新安股份	100	1,596.00	0.01
219	603166	福达股份	100	1,337.00	0.01

220	300036	超图软件	100	1,127.00	0.01
221	300296	利亚德	200	1,120.00	0.00
222	300376	易事特	200	1,024.00	0.00
223	002139	拓邦股份	100	952.00	0.00
224	002096	易普力	100	878.00	0.00
225	002701	奥瑞金	200	852.00	0.00
226	000998	隆平高科	100	754.00	0.00
227	601568	北元化工	200	680.00	0.00
228	601921	浙版传媒	100	669.00	0.00
229	002226	江南化工	100	449.00	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	300475	香农芯创	900	270,000.00	1.20
2	002079	苏州固锟	17,900	269,037.00	1.20
3	688343	云天励飞	600	48,996.00	0.22
4	688209	英集芯	1,600	46,528.00	0.21
5	002242	九阳股份	5,100	40,086.00	0.18
6	001203	大中矿业	1,300	38,935.00	0.17
7	600903	贵州燃气	5,500	36,520.00	0.16
8	300183	东软载波	2,800	29,260.00	0.13
9	000657	中钨高新	300	28,716.00	0.13
10	300548	长芯博创	100	27,800.00	0.12
11	600105	永鼎股份	400	26,992.00	0.12
12	688556	高测股份	1,200	15,936.00	0.07
13	688166	博瑞医药	400	14,004.00	0.06
14	605222	起帆电缆	400	9,328.00	0.04
15	300432	富临精工	300	6,027.00	0.03

16	002487	大金重工	100	5,797.00	0.03
17	001248	华润新能源	500	5,055.00	0.02

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	605376	博迁新材	618,090.00	3.36
2	301500	飞南资源	610,672.00	3.32
3	001203	大中矿业	496,796.00	2.70
4	601869	长飞光纤	489,321.00	2.66
5	603083	剑桥科技	482,132.00	2.62
6	601020	华钰矿业	458,604.00	2.49
7	601101	昊华能源	456,941.00	2.48
8	000019	深粮控股	453,375.00	2.46
9	002484	江海股份	433,263.00	2.35
10	002077	大港股份	418,126.00	2.27
11	601208	东材科技	411,111.00	2.23
12	300548	长芯博创	408,360.00	2.22
13	002979	雷赛智能	389,802.00	2.12
14	603063	禾望电气	378,540.00	2.06
15	601068	中铝国际	369,655.00	2.01
16	002716	湖南白银	352,957.00	1.92
17	300080	易成新能	351,934.00	1.91
18	000603	盛达资源	351,801.00	1.91
19	300475	香农芯创	346,851.00	1.88
20	601975	招商南油	343,579.00	1.87

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	601869	长飞光纤	673,864.00	3.66
2	605376	博迁新材	547,677.00	2.97
3	603663	三祥新材	535,965.00	2.91
4	601208	东材科技	520,938.00	2.83
5	301500	飞南资源	494,203.00	2.68
6	000899	赣能股份	476,602.00	2.59
7	000019	深粮控股	459,144.00	2.49
8	603588	高能环境	449,846.00	2.44
9	001203	大中矿业	439,444.00	2.39
10	601101	昊华能源	436,827.00	2.37
11	601020	华钰矿业	422,544.00	2.29
12	600552	凯盛科技	417,353.00	2.27
13	300257	开山股份	410,639.00	2.23
14	000657	中钨高新	408,324.00	2.22
15	002484	江海股份	403,877.00	2.19
16	002815	崇达技术	403,652.00	2.19
17	603103	横店影视	398,666.00	2.16
18	002254	泰和新材	375,608.00	2.04
19	603083	剑桥科技	374,358.00	2.03
20	300080	易成新能	372,823.00	2.02

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	60,593,671.43
卖出股票收入（成交）总额	60,728,106.26

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)	21,134.27	0.09
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	21,134.27	0.09

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	123272	中汽转债	128	20,134.24	0.09
2	118072	鼎通转债	10	1,000.03	0.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金使用股指期货进行仓位管理。即当有较大资金申购时，会利用股指期货进行买入套期保值，快速提高产品权益仓位，提高资金利用效率，避免由于仓位骤降导致产品净值大幅偏离基准涨跌。反之亦然。

此外，本基金仅使用中证1000股指期货，并在计算股指期货年化升/贴水的基础上，优选对产品净值最有利的股指期货合约进行投资。本基金不进行投机，对冲等操作。

在申赎相对较少时，本基金可能不使用股指期货。

管理人将持续关注股指期货升贴水、流动性以及合约期限等因素，根据产品实际情况进行投资决策。

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	274,686.09
2	应收清算款	131,167.27
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	405,853.36

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

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
357	37,647.25	8,491,495.00	63.18%	4,948,572.00	36.82%

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

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	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	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2023年03月15日)基金份额总额	281,440,067.00
本报告期期初基金份额总额	13,440,067.00
本报告期基金总申购份额	4,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	4,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	13,440,067.00

§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，光大证券资产托管部总经理变更为毛宇轩先生。具体信息参见光大证券网站公告《关于光大证券资产托管部高级管理人员变更的公告》。

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，未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，基金托管人未受调查或处罚。

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，基金托管人相关从业人员未受调查或处罚。

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

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	
德邦证券	1	5,113.00	0.00%	0.64	0.00%	-
光大证券	2	28,500.00	0.02%	-	-	-
华泰证券	2	5,840,803.56	4.81%	1,214.58	4.82%	-
中信	2	115,440,876.73	95.16%	24,003.13	95.18%	-

建投 证券						
----------	--	--	--	--	--	--

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

2、交易单元的选择程序：本基金管理人根据上述标准进行考察后，确定选用交易单元的证券公司，再和被选用的证券公司签订证券交易单元租用协议和综合服务协议。

3、本基金报告期内新租用交易单元：无。

4、本基金报告期内停止租用交易单元：无。

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1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金2025年第4季度报告	中国证监会规定媒介	2026-01-22
2	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金新增申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会规定媒介	2026-02-10
3	天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金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1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金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	中国证监会规定媒介	2026-04-30

	票信息披露		
8	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金新增申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会规定媒介	2026-05-20
9	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
10	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金新增申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会规定媒介	2026-06-12
11	天弘基金管理有限公司关于防范不法分子冒用公司名义进行诈骗活动的风险提示	中国证监会规定媒介	2026-06-13
12	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金新增申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会规定媒介	2026-06-17
13	天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要（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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20260128-20260201, 20260204-	2,012,311.00	13,829,801.00	13,190,692.00	2,651,420.00	19.73%

		20260205, 20260209- 20260209, 20260529- 20260603, 20260605- 20260609, 20260611- 20260614, 20260623- 20260623, 20260626- 20260629					
产品特有风险							
基金管理人秉承谨慎勤勉、独立决策、规范运作、充分披露原则，公平对待投资者，保障投资者合法权益。当单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%时，由此可能导致的特有风险主要包括： （1）超出基金管理人允许的单一投资者持有基金份额比例的申购申请不被确认的风险； （2）极端市场环境下投资者集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对赎回申请的风险； （3）持有基金份额占比较高的投资者大额赎回可能引发基金净值大幅波动的风险； （4）持有基金份额占比较高的投资者在召开基金份额持有人大会并对重大事项进行投票表决时，可能拥有较大话语权； （5）极端情况下，持有基金份额占比较高的投资者大量赎回后，可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平，面临转换基金运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等风险。							

注：1、申购份额包括申购或者买入基金份额，赎回份额包括赎回或者卖出基金份额。

2、份额占比精度处理方式四舍五入。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会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