

# 天弘中证 1000 增强策略交易型开放式指数证券投资基金

## 2025 年中期报告

2025 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:2025 年 08 月 29 日

## §1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人光大证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2025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2025年01月01日起至2025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	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	20
§7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	41
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	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	54
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	56
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	57
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	57
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	57
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	57
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	57
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	57
7.12 投资组合报告附注	57
§8 基金份额持有人信息	58
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	58
8.2 期末上市基金前十名持有人	58

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	59
8.4 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.....	59
§9 开放式基金份额变动.....	59
§10 重大事件揭示.....	60
10.1 基金份额持有人大会决议.....	60
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.....	60
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	60
10.4 基金投资策略的改变.....	60
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	60
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	60
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	60
10.8 其他重大事件.....	61
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	64
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.....	64
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	65
§12 备查文件目录.....	65
12.1 备查文件目录.....	65
12.2 存放地点.....	65
12.3 查阅方式.....	66

## §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	17,440,067.00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		95046	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23层	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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网	www.thfund.com.cn

址	
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公地址

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	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 (2025年01月01日-2025年06月30日)	
	本期已实现收益	3,601,212.79
本期利润	3,113,004.28	
加权平均基金份额本期利润	0.1618	
本期加权平均净值利润率	15.80%	
本期基金份额净值增长率	13.74%	
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2025年06月30日)	
	期末可供分配利润	1,903,254.71
	期末可供分配基金份额利润	0.1091
	期末基金资产净值	19,343,321.71
	期末基金份额净值	1.1091
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2025年06月30日)	
	基金份额累计净值增长率	10.91%

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

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	6.87%	0.85%	5.47%	0.94%	1.40%	-0.09%
过去三个月	5.46%	1.80%	2.08%	1.82%	3.38%	-0.02%
过去六个月	13.74%	1.60%	6.69%	1.64%	7.05%	-0.04%
过去一年	40.91%	1.95%	29.82%	1.97%	11.09%	-0.02%
自基金合同生效日起至今	10.91%	1.66%	-6.11%	1.69%	17.02%	-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2025年06月30日，公司共管理运作223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	-	10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。
张戈	本基金基金经理	2023年03月	2025年03月	12年	男，管理科学与工程专业博士。历任建信基金管理有限责任公司研究员、投资经理，大家保险资产管理公司投资经理。2022年9月加盟本公司。
杨超	指数与数量投资部总经理、本基金基金经理	2023年03月	-	15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。

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及基金合同的相关约定进行操作，不存在违法违规及未履行基金合同承诺的情况。

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

本报告期内，本基金运作合法合规，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

#### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

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

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易次数为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，市场先抑后扬整体走势平稳，振幅小幅扩大，市场结构及风格分化小幅收敛。具体来说：本报告期内，万得数据显示，中证全指上涨4.28%，沪深300上涨0.03%，中证500上涨3.31%，创业板指上涨0.53%，中证1000上涨6.69%。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2025年06月30日，本基金份额净值为1.1091元，本报告期份额净值增长率13.74%，同期业绩比较基准增长率6.69%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2025年上半年，中国经济保持总体平稳且稳中有进的态势。一季度我国经济开局良好，4月以来受到美国关税政策影响，全球经济增长动能减弱，但我国经济二季度以来仍保持稳定增长。生产端，1-5月份规模以上工业增加值、服务业生产指数同比分别增长6.3%和5.9%，相较一季度保持总体平稳。需求端，1-5月份社会消费品零售总额增长5%，相较一季度有所加快；固定资产投资增长3.7%，保持基本稳定。今年以来，中国持续推进科技创新，带动产业创新，经济向新发展态势持续。人工智能大模型、机器人和芯片等科技前沿领域不断突破，持续促进产业升级。1-5月份，工业机器人产量同比增长32%，智能车载设备制造增加值增长26.8%，规模以上高技术制造业增加值同比增长9.5%。股票市场方面，上半年A股市场波动较大，特别是4月初受到美国关税政策负面影响，整体呈现出N型走势。具体赛道中，医药赛道和科技赛道表现较为亮眼；具体行业中，有色金属领涨，黄金受益于美元信用弱化与避险需求上升；银行板块次之，政策红利与高股息策略驱动估值修复；国防军工居第三，地缘冲突加剧催化军贸扩张预期；传媒、通信、计算机和电子等科技行业受益AI表现较好。具体风格中，以北证50为代表的小微盘风格显著跑赢以沪深300为代表的大盘风格，以国证价值为代表的价值风格小幅跑赢以国证成长为代表的成长风格。

展望2025年下半年，在外部关税压力与内部结构优化的双重背景下，中国经济预计延续温和复苏，政策协同与产业升级成为中国经济的核心驱动力。出口方面，受高基数、欧美需求疲软及关税拖累，全年出口增速或将放缓，但也不乏结构性亮点，“新三样”（新能源汽车、锂电池、光伏）有望依托技术优势，出口维持较高增速，另外东盟、中东等新兴市场占比提升，有望对冲欧美市场下滑风险。消费方面，中央和地方政府近期接连部署，打出促消费“组合拳”，包括即将下达第三批消费品以旧换新资金、新能源汽车下乡和提振消费专项行动方案等，有望提振居民消费需求，同时股票市场回暖和房地产市场止跌回稳，将助力居民和企业资产负债表好转，也有望拉动微观主体的消费能力和意愿。投资方面，制造业受益于技术升级（如半导体、人工智能和新能源）、绿色转型（如储能、氢能等）以及设备更新政策等，制造业投资特别是高新技术产业投资有望保持较高增速；房地产随着市场止跌回稳，整体投资有望好转。股票市场方面，政策端，货币和财政双宽松格局有望维持，后续还有空间进一步降息降准，惠民生、促消费等各项财政

支持政策也有望顺利实施；资金端，在前期推动中长期资金入市的多项政策下，险资和养老金有望继续加大A股配置，带来可观的增量资金。从大势来看，全A整体估值水平不高，积极影响因素较多，下半年市场有望进一步企稳回升。

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。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，同时另一方面在投资时机以及投资品种上进行适度分散化，以更好的对冲风险，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

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

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

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

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

报告期内，本基金管理人未与任何第三方签订与估值相关的定价服务协议。

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

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

本基金自2025年1月1日至2025年6月30日期间存在基金资产净值低于五千万元的情形。本报告期内，自2025年1月1日至2025年6月30日，由本基金管理人承担本基金的固定费用，不再从基金资产中计提。基金管理人已召开基金份额持有人大会，并发布持有人大会决议生效的公告。

### §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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、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：2025年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2025年06月30日	上年度末 2024年12月31日
资产：			

货币资金	6.4.7.1	728,977.36	736,136.78
结算备付金		581,898.94	415,909.74
存出保证金		213,444.05	218,253.20
交易性金融资产	6.4.7.2	17,834,398.84	19,514,092.34
其中：股票投资		17,834,398.84	19,514,092.34
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		1,108,355.34	27,090.59
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	48,359.68
资产总计		20,467,074.53	20,959,842.33
<b>负债和净资产</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2025年06月30日</b>	<b>上年度末 2024年12月31日</b>
<b>负债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		1,099,842.70	7,377.87
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		8,133.07	10,423.93
应付托管费		1,626.62	2,084.79
应付销售服务费		-	-

应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	14,150.43	33,713.99
负债合计		1,123,752.82	53,600.58
<b>净资产：</b>			
实收基金	6.4.7.7	17,440,067.00	21,440,067.00
未分配利润	6.4.7.8	1,903,254.71	-533,825.25
净资产合计		19,343,321.71	20,906,241.75
负债和净资产总计		20,467,074.53	20,959,842.33

注：报告截止日2025年06月30日，基金份额净值1.1091元，基金份额总额17,440,067.00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：2025年01月01日至2025年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2025年01月01日至 2025年06月30日	上年度可比期间 2024年01月01日至202 4年06月30日
<b>一、营业总收入</b>		3,172,169.96	-3,698,030.75
1.利息收入		8,936.62	19,949.57
其中：存款利息收入	6.4.7.9	8,936.62	19,949.57
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息 收入		-	-
买入返售金融资产 收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益（损失以“-” 填列）		3,646,809.84	-3,259,006.57

其中：股票投资收益	6.4.7.10	3,405,618.24	-3,372,626.18
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	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	45,359.21	-188,697.34
股利收益	6.4.7.15	194,983.54	302,316.95
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	-488,208.51	-532,107.30
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	4,632.01	73,133.55
<b>减：二、营业总支出</b>		59,165.68	267,743.58
1.管理人报酬		49,157.63	90,515.98
2.托管费		9,831.48	18,103.18
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		176.57	-
8.其他费用	6.4.7.19	-	159,124.42
<b>三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）</b>		3,113,004.28	-3,965,774.33
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-” 号填列）</b>		3,113,004.28	-3,965,774.33

五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		3,113,004.28	-3,965,774.33

### 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：2025年01月01日至2025年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 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
项目	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	53,440,067.00	-5,809,036.74	47,631,030.26
二、本期期初净资产	53,440,067.00	-5,809,036.74	47,631,030.26
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-22,000,000.00	-885,344.22	-22,885,344.22
（一）、综合收益总额	-	-3,965,774.33	-3,965,774.33
（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）	-22,000,000.00	3,080,430.11	-18,919,569.89
其中：1.基金申购款	96,000,000.00	-18,666,611.18	77,333,388.82
2.基金赎回款	-118,000,000.00	21,747,041.29	-96,252,958.71
（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	31,440,067.00	-6,694,380.96	24,745,686.04

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

高阳

薄贺龙

薄贺龙

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

天弘中证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。

根据《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合同》和《天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，经深圳证券交易所（以下简称“深交所”）深证上[2023]223号文审核同意，本基金281,440,067.00份基金份额于2023年04月03日在深交所挂牌交易。

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颁布的《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》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第3号《半

年度报告的内容与格式》、《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》、《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颁布的其他相关规定。

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2025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2025年06月30日的财务状况以及2025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》、财政部、税务总局、证监会公告2019年第78号《关于继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》、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》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)资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，以管理人为增值税纳税人，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的金融商品转让收入免征增值税；对国债、地方政府债利息收入以及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。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

b)对证券投资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，股权的股息、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。

对投资者从证券投资基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。

c)对基金从上市公司、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。

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

d)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)对基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照证券投资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 2025年06月30日
活期存款	728,977.36
等于：本金	728,817.56
加：应计利息	159.80
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	728,977.36

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	17,510,797.91	-	17,834,398.84	323,600.93
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券	-	-	-	-
基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	17,510,797.91	-	17,834,398.84	323,600.93

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
----	-----

	2025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	1,201,880.00	-	-	-
--股指期货	1,201,880.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	1,201,880.00	-	-	-

#### 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
IM2507	IM2507	1.00	1,257,880.00	56,000.00
合计				56,000.00
减：可抵销 期货暂收 款				56,000.00
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	
	2025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		14,150.43
其中：交易所市场		14,150.43
银行间市场		-
应付利息		-
合计		14,150.43

**6.4.7.7 实收基金**

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2025年01月01日至2025年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	21,440,067.00	21,440,067.00
本期申购	12,000,000.00	12,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-16,000,000.00	-16,000,000.00
本期末	17,440,067.00	17,440,067.00

**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	224,525.48	-758,350.73	-533,825.25
本期期初	224,525.48	-758,350.73	-533,825.25
本期利润	3,601,212.79	-488,208.51	3,113,004.28
本期基金份额交易产生的变动数	-469,760.23	-206,164.09	-675,924.32

其中：基金申购款	1,305,117.94	-1,185,644.81	119,473.13
基金赎回款	-1,774,878.17	979,480.72	-795,397.45
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,355,978.04	-1,452,723.33	1,903,254.71

#### 6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2025年01月01日至2025年06月30日	
活期存款利息收入	5,721.09	
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	3,175.11	
其他	40.42	
合计	8,936.62	

#### 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	
	2025年01月01日至2025年06月30日	
股票投资收益——买卖股票差价收入	3,268,564.84	
股票投资收益——赎回差价收入	137,053.40	
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	3,405,618.24	

##### 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	
	2025年01月01日至2025年06月30日	
卖出股票成交总额	64,530,820.71	

减：卖出股票成本总额	61,195,332.05
减：交易费用	66,923.82
买卖股票差价收入	3,268,564.84

#### 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
	2025年01月01日至2025年06月30日
赎回基金份额对价总额	16,795,397.45
减：现金支付赎回款总额	7,953,732.45
减：赎回股票成本总额	8,704,611.60
减：交易费用	-
赎回差价收入	137,053.40

#### 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
	2025年01月01日至2025年06月30日
债券投资收益——利息收入	0.43
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	848.42
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	848.85

##### 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
	2025年01月01日至2025年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）	3,849.00

成交总额	
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	3,000.00
减：应计利息总额	0.43
减：交易费用	0.15
买卖债券差价收入	848.42

**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 2025年01月01日至2025年06月30日
期货投资	45,359.21

**6.4.7.15 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
股票投资产生的股利收益	194,983.54
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	194,983.54

**6.4.7.16 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期
	2025年01月01日至2025年06月30日
1.交易性金融资产	-591,288.51
——股票投资	-591,288.51
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	103,080.00
——权证投资	-
——期货投资	103,080.00
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	-488,208.51

**6.4.7.17 其他收入**

单位：人民币元

项目	本期
	2025年01月01日至2025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	4,632.01
合计	4,632.01

**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，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**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年01月01日至2025年06月30日		上年度可比期间 2024年01月01日至2024年06月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
光大证券股份有限公司	-	-	257,854,654.94	76.85%

**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**

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年01月01日至2025年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
-	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
光大证券股份有限公司	114,978.14	85.75%	61,821.98	87.97%

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定。

2、根据《公开募集证券投资基金证券交易费用管理规定》，自2024年7月1日起，基金管理人管理的被动股票型基金的股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率，且不得通过交易佣金支付研究服务、流动性服务等其他费用；其他类型基金可以通过交易佣金支付研究服务费用，但股票交易佣金费率原则上不得超过市场平均股票交易佣金费率的两倍，且不得通过交易佣金支付研究服务之外的其他费用。该类佣金协议已根据此规定完成了更新。

### 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 2025年01月01日至20 25年06月30日	上年度可比期间 2024年01月01日至20 24年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	49,157.63	90,515.98
其中：应支付销售机构的客户维护费	11,837.18	9,503.98
应支付基金管理人的净管理费	37,320.45	81,012.00

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 2025年01月01日至2025 年06月30日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	9,831.48	18,103.18

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 2025年01月01日至2025年06月30日		上年度可比期间 2024年01月01日至2024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	728,977.36	5,721.09	1,802,857.96	15,479.79

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（2025年06月30日）本基金持有的流通受限证券

### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

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2025年06月30日，本基金未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2025年06月30日，本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

### 6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

## 6.4.13 金融工具风险及管理

### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是股票型指数基金，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

本基金本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级的债券。

#### 6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级的资产支持证券。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级的同业存单。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险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。

于2025年06月30日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值（净资产）无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金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 2025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	728,977.36	-	-	-	728,977.36
结算备付金	581,898.94	-	-	-	581,898.94
存出保证金	24,762.05	-	-	188,682.00	213,444.05
交易性金融资产	-	-	-	17,834,398.84	17,834,398.84
应收清算款	-	-	-	1,108,355.34	1,108,355.34
资产总计	1,335,638.35	-	-	19,131,436.18	20,467,074.53
负债					
应付清算款	-	-	-	1,099,842.70	1,099,842.70
应付管理人报酬	-	-	-	8,133.07	8,133.07
应付托管费	-	-	-	1,626.62	1,626.62
其他负债	-	-	-	14,150.43	14,150.43
负债总计	-	-	-	1,123,752.82	1,123,752.82
利率敏感度缺口	1,335,638.35	-	-	18,007,683.36	19,343,321.71

上年度末 2024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	736,136.78	-	-	-	736,136.78
结算备付金	415,909.74	-	-	-	415,909.74
存出保证金	39,579.20	-	-	178,674.00	218,253.20
交易性金融资产	-	-	-	19,514,092.34	19,514,092.34
应收清算款	-	-	-	27,090.59	27,090.59
其他资产	-	-	-	48,359.68	48,359.68
资产总计	1,191,625.72	-	-	19,768,216.61	20,959,842.33
负债					
应付清算款	-	-	-	7,377.87	7,377.87
应付管理人报酬	-	-	-	10,423.93	10,423.93
应付托管费	-	-	-	2,084.79	2,084.79
其他负债	-	-	-	33,713.99	33,713.99
负债总计	-	-	-	53,600.58	53,600.58
利率敏感度缺口	1,191,625.72	-	-	19,714,616.03	20,906,241.75

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2025年06月30日，本基金未持有交易性债券投资(2024年12月31日：同)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响(2024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 2025年06月30日		上年度末 2024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	17,834,398.84	92.20	19,514,092.34	93.34
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	17,834,398.84	92.20	19,514,092.34	93.34

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 2025年06月30日	上年度末 2024年12月31日
	业绩比较基准上升5%	920,934.69	1,048,228.51
业绩比较基准下降5%	-920,934.69	-1,048,228.51	

#### 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 2025年06月30日	上年度末 2024年12月31日
第一层次	17,834,398.84	19,514,092.34
第二层次	-	-
第三层次	-	-
合计	17,834,398.84	19,514,092.34

###### 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2025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(2024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	17,834,398.84	87.14
	其中：股票	17,834,398.84	87.14
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	1,310,876.30	6.40
8	其他各项资产	1,321,799.39	6.46
9	合计	20,467,074.53	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	73,776.00	0.38
B	采矿业	181,274.00	0.94
C	制造业	11,473,448.04	59.31
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	455,315.00	2.35
E	建筑业	75,792.00	0.39
F	批发和零售业	865,925.00	4.48
G	交通运输、仓储和邮政业	755,878.00	3.91
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,275,802.00	11.77
J	金融业	201,765.00	1.04
K	房地产业	183,849.00	0.95
L	租赁和商务服务业	155,926.00	0.81
M	科学研究和技术服务业	36,655.20	0.19
N	水利、环境和公共设施管理业	168,971.60	0.87
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	295,098.00	1.53
S	综合	-	-
	合计	17,199,474.84	88.92

### 7.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-

C	制造业	439,602.00	2.27
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	4,305.00	0.02
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	172,855.00	0.89
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
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	18,162.00	0.09
S	综合	-	-
	合计	634,924.00	3.28

### 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	688208	道通科技	8,300	253,980.00	1.31
2	603267	鸿远电子	4,700	236,269.00	1.22
3	603005	晶方科技	7,500	212,925.00	1.10

4	002174	游族网络	17,500	212,275.00	1.10
5	603678	火炬电子	5,300	201,559.00	1.04
6	300755	华致酒行	10,400	200,720.00	1.04
7	000970	中科三环	16,800	197,736.00	1.02
8	688128	中国电研	7,900	193,550.00	1.00
9	301558	三态股份	21,200	191,012.00	0.99
10	300229	拓尔思	10,200	188,088.00	0.97
11	300548	博创科技	2,800	186,956.00	0.97
12	603609	禾丰股份	21,300	175,938.00	0.91
13	002545	东方铁塔	19,700	175,133.00	0.91
14	600073	光明肉业	23,600	174,168.00	0.90
15	300456	赛微电子	10,100	173,619.00	0.90
16	300613	富瀚微	3,400	166,192.00	0.86
17	600179	安通控股	59,100	163,116.00	0.84
18	600812	华北制药	25,800	159,444.00	0.82
19	002913	奥士康	5,400	158,814.00	0.82
20	002267	陕天然气	20,600	155,942.00	0.81
21	002378	章源钨业	19,700	155,827.00	0.81
22	603583	捷昌驱动	4,200	153,384.00	0.79
23	600273	嘉化能源	17,800	150,588.00	0.78
24	601107	四川成渝	24,600	148,092.00	0.77
25	600064	南京高科	19,200	148,032.00	0.77
26	600267	海正药业	15,900	147,075.00	0.76
27	600866	星湖科技	21,000	145,110.00	0.75
28	688523	航天环宇	6,700	144,117.00	0.75
29	605376	博迁新材	3,700	141,821.00	0.73
30	002777	久远银海	7,700	140,602.00	0.73
31	002151	北斗星通	4,900	140,581.00	0.73
32	000719	中原传媒	11,000	136,510.00	0.71
33	001339	智微智能	2,800	135,324.00	0.70
34	600595	中孚实业	30,800	134,904.00	0.70

35	000848	承德露露	14,700	134,211.00	0.69
36	603636	南威软件	10,600	133,984.00	0.69
37	002390	信邦制药	38,500	133,980.00	0.69
38	000761	本钢板材	37,000	133,200.00	0.69
39	688123	聚辰股份	1,600	129,584.00	0.67
40	000813	德展健康	39,800	128,156.00	0.66
41	300232	洲明科技	17,700	128,148.00	0.66
42	600640	国脉文化	10,500	127,260.00	0.66
43	002004	华邦健康	29,500	123,015.00	0.64
44	301171	易点天下	4,500	120,285.00	0.62
45	600315	上海家化	5,700	120,099.00	0.62
46	603308	应流股份	5,200	120,016.00	0.62
47	603983	丸美生物	2,800	117,964.00	0.61
48	603013	亚普股份	6,800	117,504.00	0.61
49	002897	意华股份	3,000	116,370.00	0.60
50	600020	中原高速	24,100	115,198.00	0.60
51	688063	派能科技	2,500	112,700.00	0.58
52	688262	国芯科技	4,200	112,014.00	0.58
53	000600	建投能源	16,000	110,560.00	0.57
54	301363	美好医疗	6,100	107,604.00	0.56
55	002516	旷达科技	20,700	106,605.00	0.55
56	603730	岱美股份	18,480	105,151.20	0.54
57	603638	艾迪精密	6,000	104,940.00	0.54
58	300657	弘信电子	3,700	103,193.00	0.53
59	000915	华特达因	2,900	102,515.00	0.53
60	600961	株冶集团	9,000	100,620.00	0.52
61	603915	国茂股份	6,900	100,326.00	0.52
62	002539	云图控股	10,500	98,490.00	0.51
63	000913	钱江摩托	6,500	97,500.00	0.50
64	000603	盛达资源	6,300	93,807.00	0.48
65	688088	虹软科技	1,900	91,675.00	0.47

66	603444	吉比特	300	90,585.00	0.47
67	600459	贵研铂业	5,800	89,958.00	0.47
68	600548	深高速	8,500	88,995.00	0.46
69	600682	南京新百	13,100	88,032.00	0.46
70	300134	大富科技	7,100	86,833.00	0.45
71	300570	太辰光	900	86,742.00	0.45
72	000581	威孚高科	4,500	85,230.00	0.44
73	600550	保变电气	9,900	85,140.00	0.44
74	300772	运达股份	6,400	82,432.00	0.43
75	002079	苏州固锟	8,400	81,900.00	0.42
76	601619	嘉泽新能	22,800	81,624.00	0.42
77	601900	南方传媒	5,200	81,328.00	0.42
78	002925	盈趣科技	4,500	80,910.00	0.42
79	002139	拓邦股份	5,800	80,098.00	0.41
80	603025	大豪科技	5,700	79,914.00	0.41
81	600057	厦门象屿	11,300	79,439.00	0.41
82	601326	秦港股份	24,400	78,812.00	0.41
83	603297	永新光学	900	78,615.00	0.41
84	300166	东方国信	7,200	78,480.00	0.41
85	605020	永和股份	3,400	78,336.00	0.40
86	301316	慧博云通	1,800	77,544.00	0.40
87	300913	兆龙互连	1,640	76,784.80	0.40
88	002534	西子洁能	6,700	75,308.00	0.39
89	300303	聚飞光电	11,800	74,812.00	0.39
90	600033	福建高速	21,100	74,694.00	0.39
91	002698	博实股份	4,800	74,592.00	0.39
92	603997	继峰股份	5,700	74,328.00	0.38
93	605296	神农集团	2,400	73,776.00	0.38
94	300080	易成新能	17,500	73,150.00	0.38
95	600269	赣粤高速	14,400	72,864.00	0.38
96	603328	依顿电子	7,400	72,594.00	0.38

97	002075	沙钢股份	12,400	72,168.00	0.37
98	601311	骆驼股份	7,900	71,337.00	0.37
99	600502	XD安徽建	15,000	70,500.00	0.36
100	300738	奥飞数据	3,300	69,069.00	0.36
101	002948	青岛银行	13,800	68,724.00	0.36
102	002216	三全食品	5,800	64,206.00	0.33
103	003006	百亚股份	2,300	62,974.00	0.33
104	002233	塔牌集团	8,400	62,160.00	0.32
105	300226	上海钢联	2,700	61,668.00	0.32
106	601515	东峰集团	16,100	61,502.00	0.32
107	002716	湖南白银	15,400	60,060.00	0.31
108	002020	京新药业	4,500	58,725.00	0.30
109	603698	航天工程	3,300	58,146.00	0.30
110	300618	寒锐钴业	1,600	57,152.00	0.30
111	600323	瀚蓝环境	2,300	56,005.00	0.29
112	002212	天融信	7,200	55,440.00	0.29
113	603733	仙鹤股份	2,600	53,924.00	0.28
114	603888	新华网	2,200	52,668.00	0.27
115	688083	中望软件	800	51,528.00	0.27
116	001287	中电港	2,800	51,268.00	0.27
117	300077	国民技术	2,000	51,200.00	0.26
118	300253	卫宁健康	4,800	50,880.00	0.26
119	603193	润本股份	1,600	50,256.00	0.26
120	002091	江苏国泰	6,900	50,163.00	0.26
121	605507	国邦医药	2,500	49,425.00	0.26
122	301291	明阳电气	1,200	49,380.00	0.26
123	601033	永兴股份	3,100	49,011.00	0.25
124	002745	木林森	6,200	48,856.00	0.25
125	600664	哈药股份	12,900	47,472.00	0.25
126	300036	超图软件	3,100	47,306.00	0.24
127	002335	科华数据	1,100	46,948.00	0.24

128	600475	华光环能	4,500	46,890.00	0.24
129	002651	利君股份	3,900	46,878.00	0.24
130	603103	横店影视	2,900	46,545.00	0.24
131	688276	百克生物	2,200	46,200.00	0.24
132	000950	重药控股	9,200	45,908.00	0.24
133	002807	江阴银行	9,300	44,175.00	0.23
134	603057	紫燕食品	2,000	43,720.00	0.23
135	300850	新强联	1,200	42,984.00	0.22
136	002275	桂林三金	3,000	42,930.00	0.22
137	603171	税友股份	1,000	42,910.00	0.22
138	002242	九阳股份	4,500	42,750.00	0.22
139	300009	安科生物	5,100	42,687.00	0.22
140	002368	太极股份	1,800	42,156.00	0.22
141	300633	开立医疗	1,400	41,608.00	0.22
142	688327	云从科技	3,000	41,370.00	0.21
143	002249	大洋电机	6,100	40,138.00	0.21
144	300770	新媒股份	1,000	39,990.00	0.21
145	002985	北摩高科	1,300	39,325.00	0.20
146	300034	钢研高纳	2,300	38,249.00	0.20
147	300870	欧陆通	300	37,950.00	0.20
148	603219	富佳股份	2,600	37,726.00	0.20
149	688279	峰昭科技	200	37,100.00	0.19
150	600458	时代新材	2,700	37,044.00	0.19
151	300183	东软载波	2,200	36,982.00	0.19
152	688110	东芯股份	1,200	36,792.00	0.19
153	002243	力合科创	4,500	36,720.00	0.19
154	300492	华图山鼎	540	36,655.20	0.19
155	000030	富奥股份	6,200	36,518.00	0.19
156	600055	万东医疗	2,100	36,288.00	0.19
157	300475	香农芯创	1,000	35,630.00	0.18
158	600338	西藏珠峰	3,100	34,379.00	0.18

159	688107	安路科技	1,200	33,888.00	0.18
160	601137	博威合金	1,900	33,801.00	0.17
161	002396	星网锐捷	1,500	33,675.00	0.17
162	300777	中简科技	900	32,625.00	0.17
163	600869	远东股份	6,300	32,004.00	0.17
164	000791	甘肃能源	5,000	31,900.00	0.16
165	688630	芯碁微装	400	31,748.00	0.16
166	601519	大智慧	3,100	31,589.00	0.16
167	002895	川恒股份	1,400	31,584.00	0.16
168	600366	宁波韵升	2,900	31,494.00	0.16
169	001311	多利科技	1,520	31,418.40	0.16
170	601279	英利汽车	7,800	31,122.00	0.16
171	600216	浙江医药	2,100	31,059.00	0.16
172	603693	江苏新能	2,300	31,004.00	0.16
173	600114	东睦股份	1,500	30,510.00	0.16
174	300953	震裕科技	300	30,405.00	0.16
175	688584	上海合晶	1,700	30,396.00	0.16
176	601096	宏盛华源	7,300	30,222.00	0.16
177	301087	可孚医疗	900	29,880.00	0.15
178	002405	四维图新	3,400	29,036.00	0.15
179	002314	南山控股	10,800	28,404.00	0.15
180	688266	泽璟制药	264	28,382.64	0.15
181	002705	新宝股份	1,900	27,930.00	0.14
182	600058	五矿发展	3,600	27,828.00	0.14
183	002096	易普力	2,200	27,302.00	0.14
184	300357	我武生物	1,300	26,832.00	0.14
185	000829	天音控股	2,600	26,546.00	0.14
186	000685	中山公用	3,000	26,340.00	0.14
187	600633	浙数文化	1,900	26,296.00	0.14
188	688141	杰华特	800	26,064.00	0.13
189	301606	绿联科技	500	25,715.00	0.13

190	001203	大中矿业	2,700	25,515.00	0.13
191	300393	中来股份	4,400	25,344.00	0.13
192	600285	羚锐制药	1,100	24,937.00	0.13
193	301631	壹连科技	300	24,780.00	0.13
194	600507	方大特钢	5,700	24,738.00	0.13
195	002048	宁波华翔	1,300	23,933.00	0.12
196	301031	中熔电气	300	23,895.00	0.12
197	600751	海航科技	7,200	23,616.00	0.12
198	002434	万里扬	3,200	23,456.00	0.12
199	688652	京仪装备	400	22,928.00	0.12
200	600894	广日股份	2,100	22,029.00	0.11
201	002498	汉缆股份	6,400	21,632.00	0.11
202	002531	天顺风能	3,000	21,420.00	0.11
203	002073	软控股份	2,400	21,336.00	0.11
204	000567	海德股份	3,600	21,312.00	0.11
205	301069	凯盛新材	1,300	20,943.00	0.11
206	300151	昌红科技	1,700	20,927.00	0.11
207	002511	中顺洁柔	3,100	20,832.00	0.11
208	600929	雪天盐业	4,100	20,746.00	0.11
209	600335	国机汽车	3,200	20,640.00	0.11
210	600757	长江传媒	2,200	20,416.00	0.11
211	603118	共进股份	1,800	20,286.00	0.10
212	600420	国药现代	1,900	20,235.00	0.10
213	603667	五洲新春	600	20,106.00	0.10
214	002077	大港股份	1,400	20,076.00	0.10
215	603027	千禾味业	1,700	19,737.00	0.10
216	688709	成都华微	600	19,644.00	0.10
217	301600	慧翰股份	200	19,592.00	0.10
218	688658	悦康药业	1,000	19,040.00	0.10
219	002597	金禾实业	800	18,840.00	0.10
220	603920	世运电路	600	18,306.00	0.09

221	001308	康冠科技	800	18,096.00	0.09
222	300972	万辰集团	100	18,024.00	0.09
223	301381	赛维时代	900	17,955.00	0.09
224	300188	国投智能	1,300	17,940.00	0.09
225	300638	广和通	600	17,178.00	0.09
226	601963	重庆银行	1,500	16,290.00	0.08
227	603132	金徽股份	1,200	15,924.00	0.08
228	002226	江南化工	2,700	15,660.00	0.08
229	301061	匠心家居	200	15,508.00	0.08
230	601163	三角轮胎	1,100	15,455.00	0.08
231	688001	华兴源创	600	15,162.00	0.08
232	600662	外服控股	2,900	14,819.00	0.08
233	603919	金徽酒	800	14,480.00	0.07
234	002755	奥赛康	900	14,382.00	0.07
235	000019	深粮控股	2,100	13,986.00	0.07
236	300768	迪普科技	800	13,720.00	0.07
237	002315	焦点科技	300	13,707.00	0.07
238	300660	江苏雷利	300	13,272.00	0.07
239	002649	博彦科技	900	13,077.00	0.07
240	688232	新点软件	400	12,016.00	0.06
241	688185	康希诺	200	11,926.00	0.06
242	688439	振华风光	200	11,650.00	0.06
243	003021	兆威机电	100	10,815.00	0.06
244	301109	军信股份	720	10,713.60	0.06
245	301153	中科江南	400	10,480.00	0.05
246	603530	神马电力	400	10,368.00	0.05
247	688127	蓝特光学	400	10,284.00	0.05
248	688343	云天励飞	200	9,884.00	0.05
249	000597	东北制药	1,900	9,804.00	0.05
250	300133	华策影视	1,300	9,763.00	0.05
251	300319	麦捷科技	900	9,666.00	0.05

252	600388	龙净环保	800	9,600.00	0.05
253	603613	国联股份	400	9,476.00	0.05
254	002978	安宁股份	300	9,474.00	0.05
255	603169	兰石重装	1,200	9,456.00	0.05
256	300100	双林股份	200	9,416.00	0.05
257	688116	XD天奈科	200	9,154.00	0.05
258	300257	开山股份	900	9,063.00	0.05
259	603306	华懋科技	200	8,700.00	0.04
260	600710	苏美达	900	8,649.00	0.04
261	002468	申通快递	800	8,552.00	0.04
262	601609	金田股份	1,200	8,412.00	0.04
263	601089	福元医药	500	8,340.00	0.04
264	301511	德福科技	400	8,280.00	0.04
265	002327	富安娜	1,100	8,162.00	0.04
266	002149	西部材料	400	7,940.00	0.04
266	000156	华数传媒	1,000	7,940.00	0.04
267	600120	浙江东方	1,300	7,865.00	0.04
268	002171	楚江新材	800	7,784.00	0.04
269	600639	浦东金桥	700	7,413.00	0.04
270	600874	创业环保	1,200	7,164.00	0.04
271	002034	旺能环境	400	6,716.00	0.03
272	601200	上海环境	800	6,352.00	0.03
273	300624	万兴科技	100	6,205.00	0.03
274	688549	中巨芯	800	6,192.00	0.03
275	002484	江海股份	300	6,147.00	0.03
276	002626	金达威	300	6,138.00	0.03
277	301035	润丰股份	100	5,934.00	0.03
278	002125	湘潭电化	400	5,812.00	0.03
279	600206	有研新材	300	5,733.00	0.03
280	601083	锦江航运	500	5,555.00	0.03
281	688548	广钢气体	550	5,511.00	0.03

282	601187	厦门银行	800	5,432.00	0.03
283	000498	山东路桥	900	5,292.00	0.03
284	601369	陕鼓动力	600	5,262.00	0.03
285	000686	东北证券	600	4,578.00	0.02
286	301029	怡合达	200	4,572.00	0.02
287	601222	林洋能源	800	4,560.00	0.02
288	688779	五矿新能	800	4,352.00	0.02
289	601777	千里科技	500	4,245.00	0.02
290	002215	诺普信	400	4,132.00	0.02
291	000544	中原环保	500	4,065.00	0.02
292	603358	XD华达科	100	3,311.00	0.02
293	603699	纽威股份	100	3,117.00	0.02
294	600305	恒顺醋业	400	3,092.00	0.02
295	000682	东方电子	300	3,072.00	0.02
296	301510	固高科技	100	3,005.00	0.02
297	603877	太平鸟	200	2,900.00	0.01
298	600330	天通股份	400	2,868.00	0.01
299	301262	海看股份	100	2,636.00	0.01
300	600996	贵广网络	300	2,502.00	0.01
300	301217	铜冠铜箔	200	2,502.00	0.01
301	600997	开滦股份	400	2,356.00	0.01
302	300682	朗新集团	100	2,350.00	0.01
303	300323	华灿光电	300	2,295.00	0.01
304	002518	科士达	100	2,259.00	0.01
305	301487	盟固利	100	2,183.00	0.01
306	000968	蓝焰控股	300	2,175.00	0.01
307	600987	航民股份	300	2,121.00	0.01
308	002839	张家港行	400	1,800.00	0.01
309	002245	蔚蓝锂芯	100	1,283.00	0.01
310	300027	华谊兄弟	200	536.00	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	603565	中谷物流	18,100	172,855.00	0.89
2	605589	圣泉集团	5,900	163,725.00	0.85
3	001269	欧晶科技	900	23,040.00	0.12
4	603989	艾华集团	1,400	21,560.00	0.11
5	688388	嘉元科技	1,000	20,080.00	0.10
6	000528	柳工	1,900	18,259.00	0.09
7	603466	风语筑	1,800	18,162.00	0.09
8	002461	珠江啤酒	1,600	18,064.00	0.09
9	300623	捷捷微电	600	17,880.00	0.09
10	301180	万祥科技	1,200	17,676.00	0.09
11	300115	长盈精密	800	17,120.00	0.09
12	603301	振德医疗	800	16,888.00	0.09
13	300458	全志科技	400	15,876.00	0.08
14	002851	麦格米特	300	15,042.00	0.08
15	300869	康泰医学	1,000	14,340.00	0.07
16	300679	电连技术	300	13,614.00	0.07
17	603566	普莱柯	900	12,249.00	0.06
18	301348	蓝箭电子	400	9,412.00	0.05
19	301216	万凯新材	600	7,482.00	0.04
20	001696	宗申动力	300	6,735.00	0.03
21	301536	星宸科技	100	6,030.00	0.03
22	301246	宏源药业	300	4,530.00	0.02
23	601886	江河集团	700	4,305.00	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	301316	慧博云通	569,990.00	2.73
2	603005	晶方科技	447,302.00	2.14
3	603678	火炬电子	410,681.00	1.96
4	300913	兆龙互连	394,029.00	1.88
5	600446	金证股份	391,667.00	1.87
6	603308	应流股份	384,761.00	1.84
7	600267	海正药业	384,098.00	1.84
8	300083	创世纪	374,095.00	1.79
9	603103	横店影视	362,820.00	1.74
10	000761	本钢板材	342,865.00	1.64
11	300638	广和通	340,812.00	1.63
12	001696	宗申动力	327,748.00	1.57
13	603983	丸美生物	327,271.00	1.57
14	301558	三态股份	324,587.00	1.55
15	002174	游族网络	324,317.00	1.55
16	002534	西子洁能	321,448.00	1.54
17	688608	恒玄科技	318,799.80	1.52
18	688208	道通科技	310,007.12	1.48
19	601279	英利汽车	308,934.00	1.48
20	301511	德福科技	307,472.00	1.47

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	300083	创世纪	527,547.00	2.52

2	603039	泛微网络	473,304.00	2.26
3	300570	太辰光	444,275.00	2.13
4	002534	西子洁能	442,784.00	2.12
5	600446	金证股份	424,891.00	2.03
6	688608	恒玄科技	423,461.96	2.03
7	603881	数据港	422,470.60	2.02
8	301316	慧博云通	418,931.00	2.00
9	688123	聚辰股份	387,033.18	1.85
10	688018	乐鑫科技	385,014.14	1.84
11	603013	亚普股份	384,356.00	1.84
12	603328	依顿电子	371,232.00	1.78
13	603171	税友股份	364,348.00	1.74
14	603236	移远通信	353,794.74	1.69
15	301511	德福科技	338,025.00	1.62
16	605333	沪光股份	336,972.00	1.61
17	600618	氯碱化工	334,833.00	1.60
18	601963	重庆银行	332,954.00	1.59
19	603308	应流股份	328,099.00	1.57
20	603103	横店影视	327,076.00	1.56

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	62,850,095.06
卖出股票收入（成交）总额	64,530,820.71

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

**7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细**

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

**7.10 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，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

**7.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	213,444.05

2	应收清算款	1,108,355.34
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	1,321,799.39

#### 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
265	65,811.57	11,775,328.00	67.52%	5,664,739.00	32.48%

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	招商证券股份有限公司	4,305,693.00	24.69%
2	方正证券股份有限公司	3,216,427.00	18.44%
3	简街香港有限公司—JSQB有限公司（R）	1,378,766.00	7.91%
4	中信证券股份有限公司	1,239,074.00	7.10%
5	华泰证券股份有限公司	1,038,544.00	5.95%
6	王路艺	812,600.00	4.66%
7	胡钢	500,000.00	2.87%
8	BARCLAYS BANK PLC	472,524.00	2.71%
9	李秀仪	300,000.00	1.72%
10	叶蕾	250,017.00	1.43%

注：持有人为场内持有人。

### 8.3 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。

### 8.4 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	21,440,067.00
本报告期基金总申购份额	12,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	16,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	17,440,067.00

## §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，基金管理人根据法律法规及《基金合同》等相关规定以通讯方式召开基金份额持有人大会，大会审议通过《关于持续运作天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金的议案》，本次大会决议自2025年4月1日起生效。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份额持有人大会决议生效的公告》。

### 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，未发生管理人的重大人事变动。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期，无涉及基金托管业务的诉讼。

### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略没有改变。

### 10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金所聘用的会计师事务所未发生变化。

### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

#### 10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员未发生受稽查或处罚的情况。

#### 10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期，基金托管人及其高级管理人员未受稽查或处罚。

### 10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期	佣金	占当期	

	单元数量		股票成交总额的比例		佣金总量的比例	
德邦证券	1	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
华泰证券	2	13,822,308.05	10.85%	2,873.71	10.85%	-
中信建投证券	2	113,558,607.72	89.15%	23,607.49	89.15%	-

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。

### 10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
德邦证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	3,849.00	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	天弘基金管理有限公司关于增聘天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理的公告	中国证监会规定媒介	2025-01-11
2	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	2025-01-14
3	天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会规定媒介	2025-01-14
4	天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金2024年第4季度报告	中国证监会规定媒介	2025-01-22
5	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	2025-01-24
6	天弘基金管理有限公司关于以通讯方式召开天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的公告	中国证监会规定媒介	2025-02-28
7	天弘基金管理有限公司关于以通讯方式召开天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	中国证监会规定媒介	2025-03-03
8	天弘基金管理有限公司关于以通讯方式召开天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公	中国证监会规定媒介	2025-03-04

	告		
9	天弘基金管理有限公司关于调整天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金经理的公告	中国证监会规定媒介	2025-03-06
10	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	2025-03-07
11	天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会规定媒介	2025-03-07
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	2025-03-14
13	天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金2024年年度报告	中国证监会规定媒介	2025-03-31
14	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（2024年下半年度）	中国证监会规定媒介	2025-03-31
15	关于天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会的停牌提示性公告	中国证监会规定媒介	2025-04-01
16	天弘基金管理有限公司关于天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金基金份额持有人大会决议生效的公告	中国证监会规定媒介	2025-04-02
17	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	2025-04-15

18	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1季度报告	中国证监会规定媒介	2025-04-22
19	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	2025-06-27
20	关于天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商终止的公告	中国证监会规定媒介	2025-06-30

### §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	20250101-20250123, 20250127-20250205, 20250207-20250209, 20250211-20250304, 20250327-20250409, 20250414-20250603, 20250605-20250630	4,793,472.00	11,366,477.00	11,854,256.00	4,305,693.00	24.69%

### 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、中国证监会批准天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金募集的文件

2、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合同

3、天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金托管协议

4、天弘中证1000增强策略交易型开放式指数证券投资基金招募说明书

5、报告期内在指定报刊上披露的各项公告

6、中国证监会规定的其他文件

### 12.2 存放地点

天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层

### 12.3 查阅方式

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

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

天弘基金管理有限公司  
二〇二五年八月二十九日