

天弘中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金

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:国泰海通证券股份有限公司

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。

基金托管人国泰海通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	7
2.4 信息披露方式	7
2.5 其他相关资料	8
§3 主要财务指标和基金净值表现	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	9
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
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	16
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	16
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	18
6.3 净资产变动表	20
6.4 报表附注	22
§7 投资组合报告	48
7.1 期末基金资产组合情况	48
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	49
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	49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	66
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	68
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	68
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	69
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	69
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	69
7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细	69
7.11 本基金投资股指期货的投资政策	69
7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	69
7.13 投资组合报告附注	69
§8 基金份额持有人信息	70
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	70

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	71
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.....	71
§9 开放式基金份额变动.....	72
§10 重大事件揭示.....	73
10.1 基金份额持有人大会决议.....	73
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.....	73
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	73
10.4 基金投资策略的改变.....	73
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	73
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.....	73
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	73
10.8 其他重大事件.....	76
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	78
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.....	78
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	78
§12 备查文件目录.....	78
12.1 备查文件目录.....	78
12.2 存放地点.....	78
12.3 查阅方式.....	78

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金		
基金简称	天弘中证500ETF联接		
基金主代码	000962		
基金运作方式	契约型开放式		
基金合同生效日	2015年01月20日		
基金管理人	天弘基金管理有限公司		
基金托管人	国泰海通证券股份有限公司		
报告期末基金份额总额	1,876,200,558.13份		
基金合同存续期	不定期		
下属分级基金的基金简称	天弘中证500 ETF联接A	天弘中证500 ETF联接C	天弘中证500 ETF联接Y
下属分级基金的交易代码	000962	005919	022961
报告期末下属分级基金的份额总额	1,240,865,934.92份	633,940,834.41份	1,393,788.80份

2.1.1 目标基金基本情况

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

2.2 基金产品说明

投资目标	通过投资于目标ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
------	--------------------------------------

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

2.2.1 目标基金产品说明

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

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		天弘基金管理有限公司	国泰海通证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	童建林	帅芳
	联系电话	022-83310208	021-38031815
	电子邮箱	service@thfund.com.cn	tgrxp@tg.gtja.com
客户服务电话		95046	021-38917599-5
传真		022-83865564	021-38677819
注册地址		天津自贸试验区（中心商务区）新华路3678号宝风大厦23层	中国（上海）自由贸易试验区商城路618号
办公地址		天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层	上海市静安区新闻路669号博华广场19楼
邮政编码		300203	200041
法定代表人		黄辰立	朱健

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.thfund.com.cn

基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公地址
------------	------------------

2.5 其他相关资料

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2025年01月01日-2025年06月30日)		
	天弘中证500ETF联接A	天弘中证500ETF联接C	天弘中证500ETF联接Y
本期已实现收益	-2,042,686.79	-1,910,517.35	-1,452.25
本期利润	63,475,063.89	34,670,482.87	71,260.45
加权平均基金份额本期利润	0.0481	0.0505	0.0626
本期加权平均净值利润率	4.30%	4.46%	5.58%
本期基金份额净值增长率	4.20%	4.10%	4.21%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2025年06月30日)		
	天弘中证500ETF联接A	天弘中证500ETF联接C	天弘中证500ETF联接Y
期末可供分配利润	-50,106,647.08	108,896,709.36	-56,085.36
期末可供分配基金份额利润	-0.0404	0.1718	-0.0402
期末基金资产净值	1,439,238,621.33	742,837,543.77	1,616,797.31
期末基金份额净值	1.1599	1.1718	1.1600
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	15.99%	17.18%	1.10%
-------------	--------	--------	-------

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

天弘中证500ETF联接A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	4.76%	0.74%	4.09%	0.75%	0.67%	-0.01%
过去三个月	1.93%	1.42%	0.97%	1.43%	0.96%	-0.01%
过去六个月	4.20%	1.28%	3.21%	1.29%	0.99%	-0.01%
过去一年	20.36%	1.62%	18.83%	1.64%	1.53%	-0.02%
过去三年	-3.00%	1.28%	-7.61%	1.29%	4.61%	-0.01%
自基金合同 生效日起至 今	15.99%	1.54%	13.36%	1.53%	2.63%	0.01%

天弘中证500ETF联接C

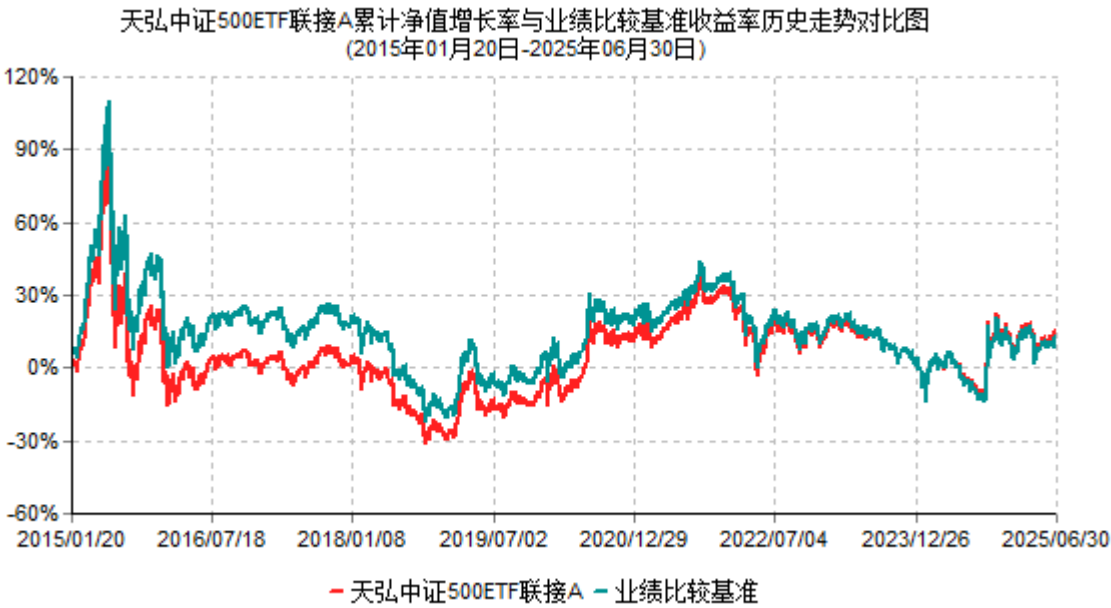
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	4.74%	0.74%	4.09%	0.75%	0.65%	-0.01%
过去三个月	1.88%	1.42%	0.97%	1.43%	0.91%	-0.01%
过去六个月	4.10%	1.28%	3.21%	1.29%	0.89%	-0.01%
过去一年	20.12%	1.62%	18.83%	1.64%	1.29%	-0.02%

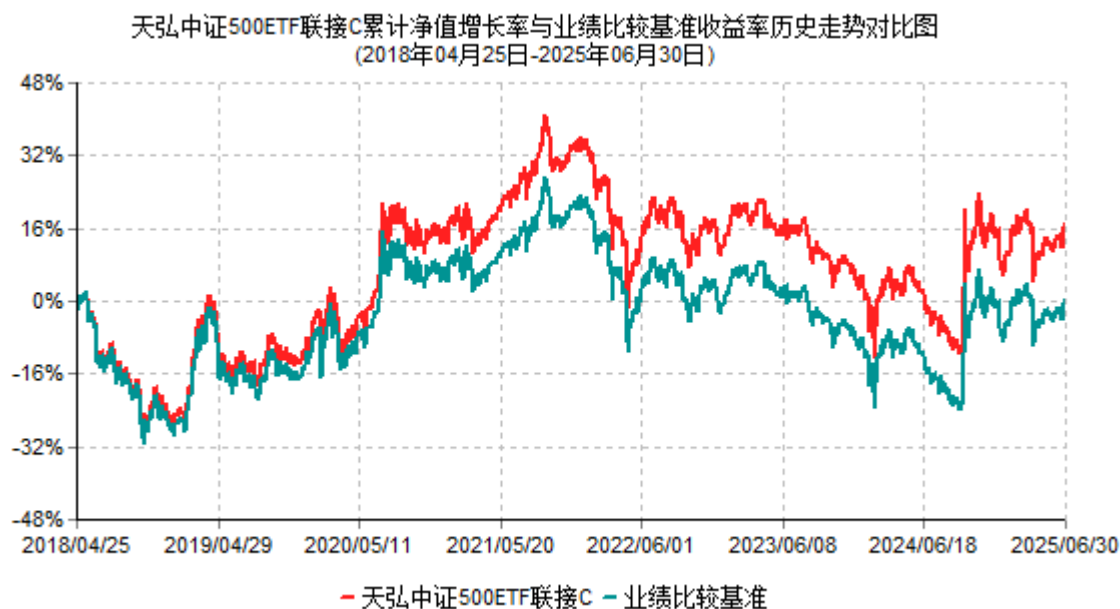
过去三年	-3.58%	1.28%	-7.61%	1.29%	4.03%	-0.01%
自基金份额 首次确认日 起至今	17.18%	1.32%	0.28%	1.33%	16.90%	-0.01%

天弘中证500ETF联接Y

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	4.76%	0.74%	4.09%	0.75%	0.67%	-0.01%
过去三个月	1.94%	1.42%	0.97%	1.43%	0.97%	-0.01%
过去六个月	4.21%	1.28%	3.21%	1.29%	1.00%	-0.01%
自基金份额 首次确认日 起至今	1.10%	1.27%	0.11%	1.28%	0.99%	-0.01%

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2015年01月20日生效。

2、本报告期内，本基金的各项投资比例达到基金合同约定的各项比例要求。

3、本基金自2018年04月24日起增设天弘中证500ETF联接C基金份额。天弘中证500ETF联接C基金份额的首次确认日为2018年04月25日。本基金自2024年12月13日起增设天弘中证500ETF联接Y基金份额。天弘中证500ETF联接Y基金份额的首次确认日为2024年12月17日。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

天弘基金管理有限公司（以下简称"公司"或"本基金管理人"）经中国证监会证监基金字[2004]164号文批准，于2004年11月8日正式成立，注册资本为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		
陈瑶	本基金基金经理	2020年08月	-	14年	女，金融学硕士。2011年7月加盟本公司，历任交易员、交易主管，从事交易管理、程序化交易策略、基差交易策略、融资融券交易策略等研究工作。
尤聪	本基金基金经理助	2024	-	12年	女，计算金融与风险管理专

	理	年08 月			业硕士。历任华盛顿大学资产管理公司量化研究员、北美信托银行信用风险管理顾问、北美信托资产管理公司股票量化投资经理。2021年10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、本基金经理助理协助基金经理进行投资、研究、头寸管理等日常工作。
3、证券从业的含义遵从《证券投资基金经营机构董事、监事、高级管理人员及从业人员监督管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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

本基金由原天弘中证500指数型发起式证券投资基金转型而来。

截至本报告期末，本基金主要持有天弘中证500ETF及指数成分股，仍采用被动复制策略，其目标为跟踪效果与直接持有指数成分股的效果一致。

报告期内本基金秉承合规第一、风控第一的原则，在运作过程中严格遵守基金合同，对指数基金采取被动复制的方式跟踪指数，力争基金净值增长率与基准指数间的高度正相关和跟踪误差最小化。

控制联接基金跟踪误差的前提是控制ETF基金的跟踪误差。报告期内，本基金跟踪误差的来源主要是申购赎回、打新、成分股调整以及ETF对指数的跟踪误差。当由于申赎等情况可能对指数跟踪效果带来影响时，本基金坚持既定的指数化投资策略，对指数基金采取被动复制与组合优化相结合的方式跟踪指数。在ETF的跟踪误差管理上，我们坚持指数化投资原则，同时紧密跟踪成分股的权息事件，及时有效处理，避免权重偏离造成跟踪误差的扩大，争取保障联接基金的跟踪效果。

报告期内，本联接基金整体运行平稳。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2025年06月30日，天弘中证500ETF联接A基金份额净值为1.1599元，天弘中证500ETF联接C基金份额净值为1.1718元，天弘中证500ETF联接Y基金份额净值为1.1600元。报告期内份额净值增长率天弘中证500ETF联接A为4.20%，同期业绩比较基准增长率为3.21%；天弘中证500ETF联接C为4.10%，同期业绩比较基准增长率为3.21%；天弘中证500ETF联接Y为4.21%，同期业绩比较基准增长率为3.21%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从海外经济来看，下半年全球经济复苏的压力增大，同时美国通胀预期仍存，美元继续走弱，经济不确定性在于关税谈判的情况、美联储何时重启降息以及地缘政治风险。对2026年的经济预测，IMF认为海外主要经济体实际GDP增速将较2025年上升。

国内的宏观环境，出口由于关税不确定性，预计6、7月“抢出口”、“抢转口”对我国出口还有支撑，但由于关税压力下全球制造业周期走弱，预计三季度中后段开始一直到明年初，出口可能会有一定压力。但当前关税并未实质性损害我国出口竞争力，明

年年中左右我国出口可能跟随全球经济周期、外需的修复而企稳回升。消费方向，下半年1380亿国补资金陆续到位，支撑消费。投资：地产景气仍在下滑，需要政策呵护。新增专项债剔除其他用途后，用于基建的金额相比2024年总体平稳。制造业方向，今年以来政策反复提及反内卷，我们认为反内卷是A股制造业改革的中长期主线，重点关注各个行业具体方案落地情况。

综合来看，当前的宏观环境处于稳步修复，同时有增量政策托底的阶段，对资本市场形成较为温和的投资环境。与此同时，资金面保持适度宽松，股票市场微观流动性比较充裕，股市成交活跃，流动性环境整体利好股票市场。整体上，我们对股票市场的观点偏积极，成长和价值板块均有表现机会。

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

本报告期内本基金管理人无应说明预警信息。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况（如有）、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整。

§6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金

报告截止日：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	117,837,567.14	108,704,878.35
结算备付金		1,030.11	619,827.76
存出保证金		199,535.21	363,469.52
交易性金融资产	6.4.7.2	2,077,229,601.13	2,248,580,507.72
其中：股票投资		70,655,148.05	76,843,488.01

基金投资		2,002,507,971.98	2,156,491,398.70
债券投资		4,066,481.10	15,245,621.01
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		9,475,520.04	6,139,567.76
应收股利		-	-
应收申购款		1,906,089.23	2,963,786.67
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		2,206,649,342.86	2,367,372,037.78
负债和净资产	附注号	本期末 2025年06月30日	上年度末 2024年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	-
应付赎回款		22,627,782.43	10,743,686.80
应付管理人报酬		73,432.10	87,521.91
应付托管费		14,688.61	17,504.57
应付销售服务费		122,171.49	146,481.90
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	118,305.82	248,076.94

负债合计		22,956,380.45	11,243,272.12
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	1,876,200,558.13	2,108,309,333.73
未分配利润	6.4.7.8	307,492,404.28	247,819,431.93
净资产合计		2,183,692,962.41	2,356,128,765.66
负债和净资产总计		2,206,649,342.86	2,367,372,037.78

注：报告截止日2025年06月30日，天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金A类基金份额净值1.1599元，天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金C类基金份额净值1.1718元，天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金Y类基金份额净值1.1600元；基金份额总额1,876,200,558.13份，其中天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金A类基金份额1,240,865,934.92份，天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金C类基金份额633,940,834.41份，天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金Y类基金份额1,393,788.80份。

6.2 利润表

会计主体：天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：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
一、营业总收入		99,649,022.85	-168,120,849.11
1.利息收入		816,152.41	992,243.64
其中：存款利息收入	6.4.7.9	816,152.41	992,243.64
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）		-3,366,146.85	-26,751,753.80

其中：股票投资收益	6.4.7.10	-453,421.80	-6,566,882.25
基金投资收益	6.4.7.11	-3,670,105.28	-21,297,234.20
债券投资收益	6.4.7.12	63,557.48	28,314.23
资产支持证券投资 收益	6.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	693,822.75	1,084,048.42
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失 以“-”号填列）	6.4.7.17	102,171,463.60	-142,406,452.15
4.汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5.其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.18	27,553.69	45,113.20
减：二、营业总支出		1,432,215.64	1,475,389.27
1.管理人报酬		466,960.66	498,655.88
2.托管费		93,402.62	99,731.19
3.销售服务费		772,078.16	764,573.89
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6.信用减值损失	6.4.7.19	-	-
7.税金及附加		-	-
8.其他费用	6.4.7.20	99,774.20	112,428.31
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		98,216,807.21	-169,596,238.38
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		98,216,807.21	-169,596,238.38

五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		98,216,807.21	-169,596,238.38

6.3 净资产变动表

会计主体：天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：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	2,108,309,333.73	247,819,431.93	2,356,128,765.66
二、本期期初净资产	2,108,309,333.73	247,819,431.93	2,356,128,765.66
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-232,108,775.60	59,672,972.35	-172,435,803.25
（一）、综合收益总额	-	98,216,807.21	98,216,807.21
（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）	-232,108,775.60	-38,543,834.86	-270,652,610.46
其中：1.基金申购款	527,776,666.88	65,410,649.40	593,187,316.28
2.基金赎回款	-759,885,442.48	-103,954,484.26	-863,839,926.74
（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	1,876,200,558.13	307,492,404.28	2,183,692,962.41
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	2,197,687,298.42	102,886,213.60	2,300,573,512.02
二、本期期初净资产	2,197,687,298.42	102,886,213.60	2,300,573,512.02
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	20,465,085.25	-174,529,498.34	-154,064,413.09
（一）、综合收益总额	-	-169,596,238.38	-169,596,238.38
（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）	20,465,085.25	-4,933,259.96	15,531,825.29
其中：1.基金申购款	615,830,620.56	4,293,760.72	620,124,381.28
2.基金赎回款	-595,365,535.31	-9,227,020.68	-604,592,555.99
（三）、本期向基金份额持有人分配利润产生的净资产变动（净资产减少以“-”号填列）	-	-	-
四、本期期末净资产	2,218,152,383.67	-71,643,284.74	2,146,509,098.93

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500交易型开放式指数证券投资基金联接基金（以下简称“本基金”）由天弘中证500指数型发起式证券投资基金转型而来，天弘中证500指数型发起式证券投资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[2014]1364号《关于准予天弘中证500指数型发起式证券投资基金注册的批复》的准许，由基金管理人天弘基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于2015年01月20日生效，首次设立募集规模为10,000,000.00份基金份额。本基金的运作方式为契约型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为天弘基金管理有限公司，基金托管人为国泰海通证券股份有限公司。

国泰海通证券股份有限公司是由原国泰君安证券股份有限公司更名而来，根据国泰海通证券股份有限公司发布的《国泰海通证券股份有限公司关于完成公司名称变更、注册资本变更、公司章程修订及相应市场主体变更登记的公告》，自2025年04月03日起，本基金基金托管人中文名称变更为“国泰海通证券股份有限公司”。根据上述变更，基金管理人及基金托管人对《基金合同》《托管协议》等法律文件进行了相应修订，修订后的法律文件自2025年04月03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旗下部分基金更新基金托管人信息并修改基金合同等法律文件的公告》。

根据基金管理人于2020年08月08日发布的《关于天弘中证500指数型发起式证券投资基金变更为天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金并相应修订基金合同的公告》，原天弘中证500指数型发起式证券投资基金于2020年08月08日变更为天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金。

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，以目标ETF、标的指数成份股以及备选成份股为主要投资对象。为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于其他股票（非标的指数成份股及其备选成份股，含中小板、创业板及其他经中国证监会核准的上市股票）、存托凭证、银行存款、债券、债券回购、权证、股指期货、资产支持证券、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金投资于目标ETF的资产比例不低于基金资产的90%（已申购但尚未确认的目标ETF份额可计入在内）；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备

付金、存出保证金和应收申购款等。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

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	117,837,567.14
等于：本金	117,793,546.18
加：应计利息	44,020.96
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	117,837,567.14

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		68,194,007.02	-	70,655,148.05	2,461,141.03
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	4,053,510.00	59,981.10	4,066,481.10	-47,010.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	4,053,510.00	59,981.10	4,066,481.10	-47,010.00
资产支持证券		-	-	-	-

基金	1,991,341,964.66	-	2,002,507,971.98	11,166,007.32
其他	-	-	-	-
合计	2,063,589,481.68	59,981.10	2,077,229,601.13	13,580,138.35

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

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	4,652.80
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	18,405.05
其中：交易所市场	18,405.05
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	95,247.97
合计	118,305.82

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 天弘中证500ETF联接A

金额单位：人民币元

项目 (天弘中证500ETF联接A)	本期 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	1,374,875,883.63	1,374,875,883.63
本期申购	153,041,342.99	153,041,342.99
本期赎回（以“-”号填列）	-287,051,291.70	-287,051,291.70
本期末	1,240,865,934.92	1,240,865,934.92

6.4.7.7.2 天弘中证500ETF联接C

金额单位：人民币元

项目 (天弘中证500ETF联接C)	本期 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	733,049,420.54	733,049,420.54
本期申购	373,346,299.46	373,346,299.46
本期赎回（以“-”号填列）	-472,454,885.59	-472,454,885.59
本期末	633,940,834.41	633,940,834.41

6.4.7.7.3 天弘中证500ETF联接Y

金额单位：人民币元

项目 (天弘中证500ETF联接Y)	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	384,029.56	384,029.56
本期申购	1,389,024.43	1,389,024.43
本期赎回（以“-”号填列）	-379,265.19	-379,265.19
本期末	1,393,788.80	1,393,788.80

注：申购含转换转入份额；赎回含转换转出份额。

6.4.7.8 未分配利润**6.4.7.8.1 天弘中证500ETF联接A**

单位：人民币元

项目 (天弘中证500ETF联接 A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-53,415,436.85	209,025,709.27	155,610,272.42
本期期初	-53,415,436.85	209,025,709.27	155,610,272.42
本期利润	-2,042,686.79	65,517,750.68	63,475,063.89
本期基金份额交易产生的变动数	5,351,476.56	-26,064,126.46	-20,712,649.90
其中：基金申购款	-6,049,446.41	23,274,906.74	17,225,460.33
基金赎回款	11,400,922.97	-49,339,033.20	-37,938,110.23
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-50,106,647.08	248,479,333.49	198,372,686.41

6.4.7.8.2 天弘中证500ETF联接C

单位：人民币元

项目 (天弘中证500ETF联接 C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	198,571,676.59	-106,405,962.52	92,165,714.07
本期期初	198,571,676.59	-106,405,962.52	92,165,714.07
本期利润	-1,910,517.35	36,581,000.22	34,670,482.87
本期基金份额交易产生的变动数	-26,627,648.61	8,688,161.03	-17,939,487.58
其中：基金申购款	100,725,750.34	-52,697,164.36	48,028,585.98
基金赎回款	-127,353,398.95	61,385,325.39	-65,968,073.56
本期已分配利润	-	-	-
本期末	170,033,510.63	-61,136,801.27	108,896,709.36

6.4.7.8.3 天弘中证500ETF联接Y

单位：人民币元

项目 (天弘中证500ETF联接Y)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-14,935.75	58,381.19	43,445.44
本期期初	-14,935.75	58,381.19	43,445.44
本期利润	-1,452.25	72,712.70	71,260.45
本期基金份额交易产生的变动数	-39,697.36	147,999.98	108,302.62
其中：基金申购款	-54,792.61	211,395.70	156,603.09
基金赎回款	15,095.25	-63,395.72	-48,300.47
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-56,085.36	279,093.87	223,008.51

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	807,572.12
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	312.03
其他	8,268.26
合计	816,152.41

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	2,623,918.21
股票投资收益——赎回差价收入	-

股票投资收益——申购差价收入	-3,077,340.01
股票投资收益——证券出借差价收入	-
合计	-453,421.80

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	171,174,224.30
减：卖出股票成本总额	168,407,005.89
减：交易费用	143,300.20
买卖股票差价收入	2,623,918.21

6.4.7.10.3 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
申购基金份额总额	79,714,500.00
减：现金支付申购款总额	41,370,011.11
减：申购股票成本总额	41,421,828.90
减：交易费用	-
申购差价收入	-3,077,340.01

6.4.7.11 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
卖出/赎回基金成交总额	329,467,908.75
减：卖出/赎回基金成本总额	333,133,961.87
减：买卖基金差价收入应缴纳增值税额	-
减：交易费用	4,052.16
基金投资收益	-3,670,105.28

6.4.7.12 债券投资收益

6.4.7.12.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
债券投资收益——利息收入	97,508.06
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-33,950.58
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	63,557.48

6.4.7.12.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 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）成交总额	13,396,279.48
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	13,221,139.50
减：应计利息总额	209,089.06
减：交易费用	1.50
买卖债券差价收入	-33,950.58

6.4.7.13 资产支持证券投资收益

本基金本报告期未取得资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期未取得贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期未取得买卖权证差价收入。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期未取得其他衍生工具投资收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
股票投资产生的股利收益	693,822.75
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	693,822.75

6.4.7.17 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	102,171,463.60
——股票投资	2,855,007.18
——债券投资	-1,645.50
——资产支持证券投资	-
——基金投资	99,318,101.92
——贵金属投资	-
——其他	-
2.衍生工具	-
——权证投资	-
3.其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增	-

值税	
合计	102,171,463.60

6.4.7.18 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	25,745.10
基金转换费收入	1,808.59
合计	27,553.69

6.4.7.19 信用减值损失

本基金本报告期内未发生信用减值损失。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年06月30日
审计费用	31,240.60
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
银行间账户维护费	9,000.00
存托服务费	26.23
合计	99,774.20

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
天弘基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
国泰海通证券股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
内蒙古君正能源化工集团股份有限公司	基金管理人的股东
天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金	本基金是该基金的联接基金

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
国泰海通证券股份有限公司	41,196,551.67	19.10%	18,900,879.56	8.59%

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

金额单位：人民币元

关联方名	本期	上年度可比期间
------	----	---------

称	2025年01月01日至2025年06月30日		2024年01月01日至2024年06月30日	
	成交金额	占当期 债券买 卖成交 总额的 比例	成交金额	占当期 债券买 卖成交 总额的 比例
国泰海通 证券股份 有限公司	1,009,692.98	47.21%	-	-

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 基金交易

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 基金成 交总额 的比例	成交金额	占当期 基金成 交总额 的比例
国泰海通 证券股份 有限公司	4,408,539.30	54.97%	-	-

6.4.10.1.6 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

国泰海通 证券股份 有限公司	8,565.82	19.52%	8,565.82	46.54%
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
国泰海通 证券股份 有限公司	4,648.37	4.93%	4,648.37	14.78%

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	466,960.66	498,655.88
其中：应支付销售机构的客户维护费	2,155,420.06	2,128,713.55
应支付基金管理人的净管理费	-1,688,459.40	-1,630,057.67

注:1、本基金基金财产中投资于目标ETF的部分不收取管理费，支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值扣除所持有目标ETF基金份额部分的基金资产后的余额乘以前一日各级基金资产净值占比（若为负数，则取0）的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。天弘中证500ETF联接A约定的管理费年费率为0.50%，天弘

中证500ETF联接C约定的管理费年费率为0.50%，天弘中证500ETF联接Y约定的管理费年费率为0.15%。其计算公式为：日管理人报酬=(前一日基金资产净值-前一日所持有目标ETF基金份额部分的基金资产)×前一日各级基金资产净值占比（若为负数，则取0）×该日适用费率/当年天数。

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

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 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	93,402.62	99,731.19

注:本基金基金财产中投资于目标ETF的部分不收取托管费，支付基金托管人国泰海通证券股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值扣除所持有目标ETF基金份额部分的基金资产后的余额乘以前一日各级基金资产净值占比（若为负数，则取0）的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。天弘中证500ETF联接A约定的托管费年费率为0.10%，天弘中证500ETF联接C约定的托管费年费率为0.10%，天弘中证500ETF联接Y约定的托管费年费率为0.05%。其计算公式为：日托管费=（前一日基金资产净值-前一日所持有目标ETF基金份额部分的基金资产）×前一日各级基金资产净值占比（若为负数，则取0）×该日适用费率/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售 服务费的 各关联方 名称	本期 2025年01月01日至2025年06月30日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	天弘中证500ETF联 接A	天弘中证500ETF 联接C	天弘中证500ETF联 接Y	合计
天弘基金	-	6,796.49	-	6,796.4

管理有限公司				9
国泰海通 证券股份 有限公司	-	90.83	-	90.83
合计	-	6,887.32	-	6,887.32
获得销售 服务费的 各关联方 名称	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年06月30日			
	当期发生的基金应支付的销售服务费			
	天弘中证500ETF联 接A	天弘中证500ETF 联接C	天弘中证500ETF联 接Y	合计
天弘基金 管理有限公司	-	13,331.81	-	13,331.81
国泰海通 证券股份 有限公司	-	175.42	-	175.42
合计	-	13,507.23	-	13,507.23

注：1、支付基金销售机构的销售服务费按前一日各级基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给天弘基金管理有限公司，再由天弘基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。天弘中证500ETF联接C的销售服务费率为0.20%。销售服务费的计算公式为：

日销售服务费=前一日各级基金资产净值×该日适用费率/当年天数。

2、天弘中证500ETF联接A和天弘中证500ETF联接Y不收取销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

天弘中证500ETF联接A

本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

天弘中证500ETF联接C

本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

天弘中证500ETF联接Y

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
国泰海通 证券股份 有限公司	117,837,567.14	807,572.12	118,335,543.50	987,428.63

注：本基金由基金托管人国泰海通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

本报告期末，本基金持有2,008,936,569.00份目标ETF基金份额（上年度末：2,257,160,769.00份），占其总份额的比例为94.92%（上年度末：94.19%）。本报告期末，本基金（因追踪指数成份股而被动）持有君正集团的股票32,300股（上年度末：37,300股），估值总额为人民币178,296.00元（上年度末：196,198.00元），占基金净资产的比例为0.01%（上年度末：0.01%）。

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

本基金为目标ETF的联接基金，目标ETF是采用完全复制法实现对标的指数紧密跟踪的全被动指数基金。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是通过投资于目标ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。

本基金管理人按照“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国泰海通证券股份有限公司开立于具有基金托管资格的银行的托管账户及其他具有基金托管资格的国有银行和大型股份制银行，并实施不同区间的额度管理，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2025年06月30日	上年度末 2024年12月31日
A-1	-	-

A-1以下	-	-
未评级	1,008,973.15	12,202,239.37
合计	1,008,973.15	12,202,239.37

注：未评级债券为国债、政策性金融债、央票或其他未经第三方评级机构进行债项评级的债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级的同业存单。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2025年06月30日	上年度末 2024年12月31日
AAA	-	-
AAA以下	-	-
未评级	3,057,507.95	3,043,381.64
合计	3,057,507.95	3,043,381.64

注：未评级债券为国债、政策性金融债、央票或其他未经第三方评级机构进行债项评级的债券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级的同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

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

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

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

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

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查

与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了交易对手管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	117,837,567.14	-	-	-	117,837,567.14
结算备付金	1,030.11	-	-	-	1,030.11
存出保证金	199,535.21	-	-	-	199,535.21
交易性金融资产	4,066,481.10	-	-	2,073,163,120.03	2,077,229,601.13
应收清算款	-	-	-	9,475,520.04	9,475,520.04
应收申购款	-	-	-	1,906,089.23	1,906,089.23
资产总计	122,104,613.56	-	-	2,084,544,729.30	2,206,649,342.86
负债					

应付赎回款	-	-	-	22,627,782.43	22,627,782.43
应付管理人报酬	-	-	-	73,432.10	73,432.10
应付托管费	-	-	-	14,688.61	14,688.61
应付销售服务费	-	-	-	122,171.49	122,171.49
其他负债	-	-	-	118,305.82	118,305.82
负债总计	-	-	-	22,956,380.45	22,956,380.45
利率敏感度缺口	122,104,613.56	-	-	2,061,588,348.85	2,183,692,962.41
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	108,704,878.35	-	-	-	108,704,878.35
结算备付金	619,827.76	-	-	-	619,827.76
存出保证金	363,469.52	-	-	-	363,469.52
交易性金融资产	15,245,621.01	-	-	2,233,334,886.71	2,248,580,507.72
应收清算款	-	-	-	6,139,567.76	6,139,567.76
应收申购款	-	-	-	2,963,786.67	2,963,786.67
资产总计	124,933,796.64	-	-	2,242,438,241.14	2,367,372,037.78
负债					
应付赎回款	-	-	-	10,743,686.80	10,743,686.80
应付管理人报酬	-	-	-	87,521.91	87,521.91
应付托管费	-	-	-	17,504.57	17,504.57
应付销售服务费	-	-	-	146,481.90	146,481.90
其他负债	-	-	-	248,076.94	248,076.94
负债总计	-	-	-	11,243,272.12	11,243,272.12
利率敏感度缺口	124,933,796.64	-	-	2,231,194,969.02	2,356,128,765.66

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，本基金持有的交易性债券投资占基金净资产的比例为0.19%(2024年12月31日：0.65%)，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。本基金主要投资于能通过股票组合赎回或二级市场交易卖出的目标ETF份额以及证券交易所上市的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金通过把全部或接近全部的基金资产投资于目标ETF、标的指数成份股和备选成份股进行被动式指数化投资，实现对业绩比较基准的紧密跟踪。本基金的其他价格风险与目标ETF基金类似。本基金管理人通常用敏感性指标来衡量市场价格风险。

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	70,655,148.05	3.24	76,843,488.01	3.26
交易性金融资产—基金投资	2,002,507,971.98	91.70	2,156,491,398.70	91.53
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-

衍生金融资产	-	-	-	-
—权证投资				
其他	-	-	-	-
合计	2,073,163,120.03	94.94	2,233,334,886.71	94.79

注：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%	109,043,744.80	116,978,848.05
	业绩比较基准下降5%	-109,043,744.80	-116,978,848.05

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	2,073,163,120.03	2,233,334,886.71
第二层次	4,066,481.10	15,245,621.01
第三层次	-	-
合计	2,077,229,601.13	2,248,580,507.72

6.4.14.2 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	70,655,148.05	3.20
	其中：股票	70,655,148.05	3.20
2	基金投资	2,002,507,971.98	90.75
3	固定收益投资	4,066,481.10	0.18
	其中：债券	4,066,481.10	0.18
	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	117,838,597.25	5.34
8	其他各项资产	11,581,144.48	0.52
9	合计	2,206,649,342.86	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	174,992.00	0.01
B	采矿业	2,520,749.78	0.12
C	制造业	44,746,181.32	2.05
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	2,284,219.40	0.10
E	建筑业	620,833.00	0.03
F	批发和零售业	1,547,525.48	0.07
G	交通运输、仓储和邮政业	1,177,462.00	0.05
H	住宿和餐饮业	188,337.00	0.01
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,531,639.37	0.30
J	金融业	6,957,337.66	0.32
K	房地产业	870,598.00	0.04
L	租赁和商务服务业	613,103.00	0.03
M	科学研究和技术服务业	480,974.96	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	300,077.12	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	147,798.00	0.01
Q	卫生和社会工作	327,791.96	0.02
R	文化、体育和娱乐业	999,219.00	0.05
S	综合	166,309.00	0.01
	合计	70,655,148.05	3.24

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300476	胜宏科技	6,000	806,280.00	0.04
2	000988	华工科技	9,801	460,745.01	0.02
3	600988	赤峰黄金	15,831	393,875.28	0.02
4	300339	润和软件	7,700	391,391.00	0.02
5	002966	苏州银行	43,590	382,720.20	0.02
6	600839	四川长虹	35,400	344,088.00	0.02
7	601555	东吴证券	37,950	332,062.50	0.02
8	601162	天风证券	66,400	327,352.00	0.01
9	689009	九号公司	5,494	325,079.98	0.01
10	002517	恺英网络	16,700	322,477.00	0.01
11	002340	格林美	49,900	316,865.00	0.01
12	002195	岩山科技	55,367	311,716.21	0.01
13	002558	巨人网络	13,200	310,860.00	0.01
14	688521	芯原股份	3,205	309,282.50	0.01
15	002156	通富微电	11,900	304,878.00	0.01
16	603893	瑞芯微	2,000	303,720.00	0.01
17	002261	拓维信息	9,800	303,310.00	0.01
18	300251	光线传媒	14,300	289,861.00	0.01
19	002797	第一创业	40,900	289,572.00	0.01
20	600487	亨通光电	18,900	289,170.00	0.01
21	300207	欣旺达	14,400	288,864.00	0.01
22	600157	永泰能源	212,600	284,884.00	0.01
23	000066	中国长城	18,900	279,720.00	0.01
24	300803	指南针	3,425	276,260.50	0.01
25	002273	水晶光电	13,602	271,631.94	0.01
26	002465	海格通信	19,400	270,436.00	0.01
27	600096	云天化	12,300	270,231.00	0.01
28	688608	恒玄科技	769	267,596.62	0.01

29	688120	华海清科	1,585	267,389.50	0.01
30	688777	中控技术	5,926	266,136.66	0.01
31	601168	西部矿业	16,000	266,080.00	0.01
32	300450	先导智能	10,700	265,895.00	0.01
33	600879	航天电子	25,200	263,844.00	0.01
34	600536	中国软件	5,616	262,660.32	0.01
35	000831	中国稀土	7,200	260,064.00	0.01
36	688213	XD思特威	2,510	256,572.20	0.01
37	002294	信立泰	5,400	255,582.00	0.01
38	601099	太平洋	65,000	255,450.00	0.01
39	300017	网宿科技	23,800	255,136.00	0.01
40	000933	神火股份	15,300	254,592.00	0.01
41	002185	华天科技	25,100	253,510.00	0.01
42	600352	浙江龙盛	24,800	251,968.00	0.01
43	600885	宏发股份	11,172	249,247.32	0.01
44	601108	财通证券	31,200	246,792.00	0.01
45	688235	百济神州	1,050	245,322.00	0.01
46	002595	豪迈科技	4,000	236,880.00	0.01
47	002130	沃尔核材	9,900	235,818.00	0.01
48	300454	深信服	2,500	235,450.00	0.01
49	000423	东阿阿胶	4,500	235,350.00	0.01
50	601128	常熟银行	31,735	233,886.95	0.01
51	688099	晶晨股份	3,282	233,054.82	0.01
52	688002	睿创微纳	3,336	232,585.92	0.01
53	002085	万丰奥威	14,600	231,994.00	0.01
54	002281	光迅科技	4,656	229,633.92	0.01
55	601577	长沙银行	23,100	229,614.00	0.01
56	600079	人福医药	10,900	228,682.00	0.01
57	000997	新大陆	7,050	228,279.00	0.01
58	300058	蓝色光标	34,500	226,320.00	0.01
59	002532	天山铝业	27,200	226,032.00	0.01

60	688469	芯联集成	47,319	225,711.63	0.01
61	300002	神州泰岳	19,100	225,380.00	0.01
62	000783	长江证券	32,400	224,532.00	0.01
63	002472	双环传动	6,700	224,383.00	0.01
64	002738	中矿资源	6,960	223,833.60	0.01
65	300474	景嘉微	3,050	222,650.00	0.01
66	300458	全志科技	5,600	222,264.00	0.01
67	002138	顺络电子	7,900	222,148.00	0.01
68	300223	北京君正	3,200	221,440.00	0.01
69	002078	太阳纸业	16,392	220,636.32	0.01
70	002436	兴森科技	16,500	218,460.00	0.01
71	600109	国金证券	24,900	218,373.00	0.01
72	603596	伯特利	4,140	218,136.60	0.01
73	300765	新诺威	4,200	217,098.00	0.01
74	603129	春风动力	1,000	216,500.00	0.01
75	002410	广联达	16,100	215,901.00	0.01
76	688122	西部超导	4,157	215,665.16	0.01
77	002851	麦格米特	4,300	215,602.00	0.01
78	002850	科达利	1,900	215,023.00	0.01
79	601933	永辉超市	43,400	212,660.00	0.01
80	300346	南大光电	6,700	211,988.00	0.01
81	002353	杰瑞股份	6,020	210,700.00	0.01
82	300136	信维通信	9,400	210,560.00	0.01
83	002065	东华软件	21,900	210,240.00	0.01
84	300395	菲利华	4,100	209,510.00	0.01
85	300054	鼎龙股份	7,300	209,364.00	0.01
86	300024	机器人	12,185	209,338.30	0.01
87	600580	卧龙电驱	10,560	208,771.20	0.01
88	600862	中航高科	8,000	208,640.00	0.01
89	688525	佰维存储	3,091	208,333.40	0.01
90	600143	金发科技	20,200	208,262.00	0.01

91	600298	安琪酵母	5,900	207,503.00	0.01
92	002202	金风科技	20,200	207,050.00	0.01
93	000034	神州数码	5,500	207,020.00	0.01
94	601198	东兴证券	18,500	206,275.00	0.01
95	002223	鱼跃医疗	5,790	206,124.00	0.01
96	002673	西部证券	26,100	205,668.00	0.01
97	600873	梅花生物	19,200	205,248.00	0.01
98	600363	联创光电	3,500	204,155.00	0.01
99	002008	大族激光	8,300	202,271.00	0.01
100	002624	完美世界	13,300	201,761.00	0.01
101	603606	东方电缆	3,900	201,669.00	0.01
102	688578	艾力斯	2,163	201,245.52	0.01
103	000728	国元证券	25,500	201,195.00	0.01
104	601615	明阳智能	17,500	201,075.00	0.01
105	300496	中科创达	3,500	200,270.00	0.01
106	300383	光环新网	14,000	200,200.00	0.01
107	000021	深科技	10,608	198,793.92	0.01
108	300857	协创数据	2,300	197,938.00	0.01
109	300115	长盈精密	9,200	196,880.00	0.01
110	688617	惠泰医疗	661	196,317.00	0.01
111	300604	长川科技	4,300	193,113.00	0.01
112	600549	厦门钨业	9,200	192,464.00	0.01
113	603160	汇顶科技	2,700	191,781.00	0.01
114	300012	华测检测	16,400	191,716.00	0.01
115	603659	璞泰来	10,200	191,556.00	0.01
116	000426	兴业银锡	12,100	191,180.00	0.01
117	002155	湖南黄金	10,685	190,727.25	0.01
118	603605	珀莱雅	2,300	190,417.00	0.01
119	000733	振华科技	3,800	190,190.00	0.01
120	600895	张江高科	7,400	190,180.00	0.01
121	688220	翱捷科技	2,401	187,998.30	0.01

122	688072	拓荆科技	1,220	187,526.20	0.01
123	603087	甘李药业	3,400	186,252.00	0.01
124	600171	上海贝岭	5,400	184,950.00	0.01
125	300627	华测导航	5,280	184,800.00	0.01
126	300699	光威复材	5,780	183,052.60	0.01
127	000519	中兵红箭	8,247	180,526.83	0.01
128	300037	新宙邦	5,120	180,224.00	0.01
129	000750	国海证券	43,570	179,508.40	0.01
130	601216	君正集团	32,300	178,296.00	0.01
131	000932	华菱钢铁	40,480	178,112.00	0.01
132	600392	盛和资源	13,500	177,795.00	0.01
133	300003	乐普医疗	12,900	177,762.00	0.01
134	605589	圣泉集团	6,400	177,600.00	0.01
135	000729	燕京啤酒	13,700	177,141.00	0.01
136	002444	巨星科技	6,940	177,039.40	0.01
137	002821	凯莱英	2,000	176,500.00	0.01
138	601665	齐鲁银行	27,900	176,328.00	0.01
139	601997	贵阳银行	28,100	175,344.00	0.01
140	688180	君实生物	5,136	174,521.28	0.01
141	000878	云南铜业	13,700	174,264.00	0.01
142	300001	特锐德	7,189	172,320.33	0.01
143	600153	建发股份	16,600	172,142.00	0.01
144	300142	沃森生物	15,600	171,600.00	0.01
145	002414	高德红外	16,730	171,482.50	0.01
146	300073	当升科技	3,900	171,093.00	0.01
147	601233	桐昆股份	16,100	170,660.00	0.01
148	601990	南京证券	21,100	170,488.00	0.01
149	601717	郑煤机	10,256	170,454.72	0.01
150	600060	海信视像	7,400	170,348.00	0.01
151	601696	中银证券	15,900	169,971.00	0.01
152	002837	英维克	5,700	169,347.00	0.01

153	002007	华兰生物	10,700	167,669.00	0.01
154	600673	东阳光	14,300	166,309.00	0.01
155	000893	亚钾国际	5,500	165,770.00	0.01
156	600369	西南证券	38,100	165,735.00	0.01
157	600699	均胜电子	9,500	165,680.00	0.01
158	688361	中科飞测	1,949	164,086.31	0.01
159	002152	广电运通	12,100	162,624.00	0.01
160	603979	金诚信	3,500	162,540.00	0.01
161	600521	华海药业	8,700	162,081.00	0.01
162	000738	航发控制	7,800	161,850.00	0.01
163	688027	国盾量子	587	161,430.87	0.01
164	600177	雅戈尔	22,100	161,330.00	0.01
165	300748	金力永磁	6,760	161,158.40	0.01
166	300373	扬杰科技	3,100	160,890.00	0.01
167	603345	安井食品	2,000	160,840.00	0.01
168	600118	中国卫星	5,600	159,992.00	0.01
169	600398	海澜之家	22,900	159,384.00	0.01
170	600435	北方导航	10,200	159,018.00	0.01
171	688052	纳芯微	911	158,960.39	0.01
172	600316	洪都航空	4,200	158,340.00	0.01
173	000623	吉林敖东	9,315	157,889.25	0.01
174	600704	物产中大	29,800	157,046.00	0.01
175	002044	美年健康	30,500	156,770.00	0.01
176	600909	XD华安证	26,890	156,768.70	0.01
177	002318	久立特材	6,700	156,713.00	0.01
178	002958	青农商行	43,400	156,674.00	0.01
179	000009	中国宝安	17,620	156,465.60	0.01
180	688249	晶合集成	7,679	155,653.33	0.01
181	688065	凯赛生物	3,298	155,335.80	0.01
182	600497	驰宏锌锗	29,300	154,997.00	0.01
183	002409	雅克科技	2,800	153,132.00	0.01

184	600765	中航重机	9,020	152,257.60	0.01
185	300724	捷佳伟创	2,800	152,040.00	0.01
186	600038	中直股份	3,900	151,359.00	0.01
187	000528	柳 工	15,700	150,877.00	0.01
188	603228	景旺电子	3,600	150,624.00	0.01
189	001696	宗申动力	6,700	150,415.00	0.01
190	603179	新泉股份	3,200	150,304.00	0.01
191	000400	许继电气	6,900	150,213.00	0.01
192	600141	兴发集团	7,300	149,869.00	0.01
193	002683	广东宏大	4,400	149,336.00	0.01
194	600155	华创云信	21,300	148,248.00	0.01
195	600562	国睿科技	4,700	148,003.00	0.01
196	300919	中伟股份	4,500	147,960.00	0.01
197	002607	中公教育	48,300	147,798.00	0.01
198	000960	锡业股份	9,597	146,834.10	0.01
199	688385	复旦微电	2,949	145,297.23	0.01
200	600637	东方明珠	19,300	144,171.00	0.01
201	300623	捷捷微电	4,800	143,040.00	0.01
202	600884	杉杉股份	15,100	142,846.00	0.01
203	002841	视源股份	4,100	141,860.00	0.01
204	000039	中集集团	17,959	141,157.74	0.01
205	600498	烽火通信	6,700	140,901.00	0.01
206	603939	益丰药房	5,752	140,751.44	0.01
207	002739	万达电影	12,300	140,589.00	0.01
208	000415	渤海租赁	42,200	140,526.00	0.01
209	600529	山东药玻	6,300	139,482.00	0.01
210	300558	贝达药业	2,400	139,080.00	0.01
211	002025	航天电器	2,700	138,807.00	0.01
212	002926	华西证券	15,369	137,398.86	0.01
213	301358	湖南裕能	4,400	137,236.00	0.01
214	002385	大北农	33,600	135,744.00	0.01

215	300285	国瓷材料	7,800	135,330.00	0.01
216	002653	海思科	3,200	135,104.00	0.01
217	300757	罗博特科	900	134,973.00	0.01
218	600486	扬农化工	2,320	134,560.00	0.01
219	000887	中鼎股份	7,646	134,493.14	0.01
220	600901	江苏金租	22,100	133,926.00	0.01
221	688568	中科星图	3,713	133,705.13	0.01
222	688188	柏楚电子	1,005	132,318.30	0.01
223	300763	锦浪科技	2,300	131,997.00	0.01
224	300679	电连技术	2,900	131,602.00	0.01
225	002939	长城证券	15,700	131,566.00	0.01
226	600563	法拉电子	1,200	130,908.00	0.01
227	300144	宋城演艺	15,300	130,815.00	0.01
228	002568	百润股份	5,100	130,611.00	0.01
229	000723	美锦能源	30,100	130,032.00	0.01
230	600863	内蒙华电	31,200	128,232.00	0.01
231	603486	科沃斯	2,200	128,106.00	0.01
232	600820	隧道股份	21,000	128,100.00	0.01
233	002064	华峰化学	19,300	127,573.00	0.01
234	600008	首创环保	42,220	127,504.40	0.01
235	002080	中材科技	6,500	126,750.00	0.01
236	600132	重庆啤酒	2,300	126,730.00	0.01
237	000513	丽珠集团	3,510	126,500.40	0.01
238	603568	伟明环保	6,620	126,309.60	0.01
239	002312	川发龙蟒	11,000	126,280.00	0.01
240	000703	恒逸石化	21,400	125,832.00	0.01
241	600390	五矿资本	21,500	125,345.00	0.01
242	600516	方大炭素	27,000	125,280.00	0.01
243	300676	华大基因	2,500	124,425.00	0.01
244	688538	和辉光电	53,154	124,380.36	0.01
245	600998	九州通	24,136	124,059.04	0.01

246	688582	芯动联科	1,842	123,782.40	0.01
247	688114	华大智造	1,905	123,501.15	0.01
248	600166	福田汽车	45,500	123,305.00	0.01
249	300487	蓝晓科技	2,450	123,235.00	0.01
250	600763	通策医疗	2,982	123,096.96	0.01
251	002262	恩华药业	5,900	122,602.00	0.01
252	603816	顾家家居	4,800	122,496.00	0.01
253	002500	山西证券	20,940	122,289.60	0.01
254	600170	上海建工	51,000	121,890.00	0.01
255	603589	口子窖	3,500	121,800.00	0.01
256	002203	海亮股份	11,800	121,776.00	0.01
257	000683	博源化工	25,400	121,666.00	0.01
258	600208	衢州发展	40,800	120,768.00	0.01
259	601179	中国西电	19,600	120,344.00	0.01
260	002432	九安医疗	3,300	120,219.00	0.01
261	600312	平高电气	7,800	120,042.00	0.01
262	002244	滨江集团	12,100	117,975.00	0.01
263	605358	立昂微	5,060	117,898.00	0.01
264	600021	上海电力	13,400	117,786.00	0.01
265	601155	新城控股	8,600	117,648.00	0.01
266	000403	派林生物	6,480	117,482.40	0.01
267	000591	太阳能	26,700	117,213.00	0.01
268	688183	生益电子	2,285	116,992.00	0.01
269	600985	淮北矿业	10,300	116,802.00	0.01
270	000060	中金岭南	25,500	116,790.00	0.01
271	600126	杭钢股份	12,900	116,100.00	0.01
272	000629	钒钛股份	45,300	115,968.00	0.01
273	600380	健康元	10,500	115,815.00	0.01
274	600583	海油工程	21,200	115,752.00	0.01
275	000921	海信家电	4,500	115,650.00	0.01
276	002603	以岭药业	8,200	115,620.00	0.01

277	600348	华阳股份	17,350	115,551.00	0.01
278	688728	格科微	7,469	115,022.60	0.01
279	601000	唐山港	28,300	114,898.00	0.01
280	688017	绿的谐波	917	114,524.13	0.01
281	603885	吉祥航空	8,500	114,495.00	0.01
282	000830	鲁西化工	11,100	114,330.00	0.01
283	600872	中炬高新	6,000	114,000.00	0.01
284	603338	浙江鼎力	2,400	113,760.00	0.01
285	601991	大唐发电	35,700	113,169.00	0.01
286	300567	精测电子	1,864	112,977.04	0.01
287	600535	天士力	7,200	112,680.00	0.01
288	002984	森麒麟	6,000	112,500.00	0.01
289	300146	汤臣倍健	10,000	112,400.00	0.01
290	002439	启明星辰	7,000	111,930.00	0.01
291	003031	中瓷电子	2,100	111,741.00	0.01
292	002056	横店东磁	7,860	111,219.00	0.01
293	600816	建元信托	37,600	110,920.00	0.01
294	603379	三美股份	2,300	110,676.00	0.01
295	000062	深圳华强	4,100	110,126.00	0.01
296	600095	湘财股份	10,900	109,327.00	0.01
297	002423	中粮资本	8,900	108,847.00	0.00
298	600685	中船防务	4,000	108,760.00	0.00
299	000636	风华高科	7,892	108,436.08	0.00
300	600970	中材国际	12,600	108,108.00	0.00
301	601016	节能风电	37,320	107,854.80	0.00
302	600499	科达制造	11,000	107,800.00	0.00
303	601880	辽港股份	71,700	107,550.00	0.00
304	000958	电投产融	15,700	107,388.00	0.00
305	300212	易华录	4,920	107,059.20	0.00
306	300390	天华新能	5,610	106,982.70	0.00
307	000563	陕国投 A	29,950	106,921.50	0.00

308	603927	中科软	5,520	106,756.80	0.00
309	000155	川能动力	10,800	106,056.00	0.00
310	603737	三棵树	2,868	105,685.80	0.00
311	601611	中国核建	11,500	105,685.00	0.00
312	601666	平煤股份	14,200	105,222.00	0.00
313	603000	人民网	5,200	105,092.00	0.00
314	301308	江波龙	1,200	104,988.00	0.00
315	600511	国药股份	3,600	104,976.00	0.00
316	603298	杭叉集团	5,000	104,750.00	0.00
317	000598	兴蓉环境	14,500	104,545.00	0.00
318	300677	英科医疗	4,400	104,192.00	0.00
319	600859	王府井	7,500	104,175.00	0.00
320	601966	玲珑轮胎	7,100	104,157.00	0.00
321	603077	和邦生物	59,400	103,950.00	0.00
322	600655	豫园股份	18,700	103,785.00	0.00
323	600004	白云机场	11,400	103,740.00	0.00
324	603156	养元饮品	4,900	103,684.00	0.00
325	601456	国联民生	10,000	103,500.00	0.00
326	600325	华发股份	21,000	102,270.00	0.00
327	000050	深天马 A	12,000	102,240.00	0.00
328	600483	福能股份	10,600	102,184.00	0.00
329	000951	中国重汽	5,800	101,964.00	0.00
330	688520	神州细胞	1,702	101,864.70	0.00
331	002756	永兴材料	3,200	101,600.00	0.00
332	603899	晨光股份	3,500	101,465.00	0.00
333	002773	康弘药业	3,500	101,395.00	0.00
334	300529	健帆生物	4,700	101,379.00	0.00
335	600131	国网信通	5,700	100,890.00	0.00
336	688278	特宝生物	1,399	100,881.89	0.00
337	601958	金钼股份	9,200	100,648.00	0.00
338	000987	越秀资本	14,665	100,601.90	0.00

339	002507	涪陵榨菜	7,857	100,491.03	0.00
340	600378	XD昊华科	3,700	100,159.00	0.00
341	600663	陆家嘴	11,300	100,118.00	0.00
342	600282	南钢股份	23,600	99,120.00	0.00
343	600271	航天信息	10,700	98,868.00	0.00
344	300601	康泰生物	6,500	98,735.00	0.00
345	000559	万向钱潮	12,900	98,685.00	0.00
346	688297	中无人机	1,845	98,523.00	0.00
347	600598	北大荒	6,800	98,056.00	0.00
348	601001	晋控煤业	8,000	97,760.00	0.00
349	600737	中粮糖业	10,300	97,335.00	0.00
350	600739	辽宁成大	8,800	96,800.00	0.00
351	002429	兆驰股份	22,100	96,798.00	0.00
352	600754	锦江酒店	4,300	96,492.00	0.00
353	301536	星宸科技	1,600	96,480.00	0.00
354	601918	新集能源	14,900	96,254.00	0.00
355	300070	碧水源	21,200	95,400.00	0.00
356	300888	稳健医疗	2,320	95,352.00	0.00
357	600566	XD济川药	3,600	94,788.00	0.00
358	600582	天地科技	15,800	94,642.00	0.00
359	002120	韵达股份	14,100	94,470.00	0.00
360	601333	广深铁路	32,400	93,636.00	0.00
361	601231	环旭电子	6,400	93,632.00	0.00
362	002430	杭氧股份	4,800	93,216.00	0.00
363	688772	珠海冠宇	6,502	92,913.58	0.00
364	601866	中远海发	37,600	92,872.00	0.00
365	300735	光弘科技	3,700	92,870.00	0.00
366	603728	鸣志电器	1,600	91,952.00	0.00
367	600258	首旅酒店	6,500	91,845.00	0.00
368	600867	通化东宝	11,200	91,840.00	0.00
369	600764	中国海防	2,700	91,800.00	0.00

370	603688	石英股份	2,600	91,572.00	0.00
371	000032	深桑达 A	4,500	91,035.00	0.00
372	601098	XD中南传	6,900	90,528.00	0.00
373	300751	迈为股份	1,300	90,428.00	0.00
374	600329	达仁堂	2,700	90,072.00	0.00
375	688301	奕瑞科技	1,026	89,887.86	0.00
376	688561	奇安信	2,641	89,741.18	0.00
377	688363	华熙生物	1,746	89,657.10	0.00
378	603290	斯达半导	1,100	89,397.00	0.00
379	603341	龙旗科技	2,200	89,386.00	0.00
380	600995	南网储能	9,100	88,998.00	0.00
381	000027	深圳能源	13,940	88,937.20	0.00
382	601212	白银有色	28,300	88,579.00	0.00
383	600707	彩虹股份	13,700	88,502.00	0.00
384	688234	天岳先进	1,506	88,176.30	0.00
385	002508	老板电器	4,600	87,446.00	0.00
386	000709	河钢股份	40,300	87,048.00	0.00
387	002831	裕同科技	3,684	86,279.28	0.00
388	600578	京能电力	19,200	86,208.00	0.00
389	603858	步长制药	5,300	86,072.00	0.00
390	300573	兴齐眼药	1,660	85,971.40	0.00
391	002299	圣农发展	6,000	85,740.00	0.00
392	000883	湖北能源	19,000	85,690.00	0.00
393	000967	盈峰环境	12,300	85,485.00	0.00
394	002670	国盛金控	5,659	85,167.95	0.00
395	688676	金盘科技	2,531	84,661.95	0.00
396	600906	财达证券	12,400	84,568.00	0.00
397	600517	国网英大	16,500	84,150.00	0.00
398	600546	山煤国际	9,500	82,935.00	0.00
399	601399	国机重装	27,600	82,800.00	0.00
400	601928	凤凰传媒	7,400	82,658.00	0.00

401	603529	爱玛科技	2,400	82,560.00	0.00
402	600848	上海临港	9,100	82,537.00	0.00
403	688778	厦钨新能	1,473	82,370.16	0.00
404	600959	江苏有线	23,900	82,216.00	0.00
405	300595	欧普康视	5,300	80,931.00	0.00
406	688318	财富趋势	704	80,903.68	0.00
407	601156	东航物流	6,100	79,849.00	0.00
408	000739	普洛药业	5,696	79,744.00	0.00
409	000825	太钢不锈	22,200	79,698.00	0.00
410	600968	海油发展	19,500	79,560.00	0.00
411	600808	马钢股份	23,000	79,350.00	0.00
412	002572	索菲亚	5,621	78,750.21	0.00
413	002266	浙富控股	25,444	78,367.52	0.00
414	301301	川宁生物	6,500	78,260.00	0.00
415	600528	中铁工业	10,600	78,228.00	0.00
416	603225	新凤鸣	7,300	77,745.00	0.00
417	603565	中谷物流	8,100	77,355.00	0.00
418	601636	旗滨集团	15,400	77,154.00	0.00
419	000543	皖能电力	11,000	77,000.00	0.00
420	600801	华新水泥	6,500	76,960.00	0.00
421	601118	海南橡胶	16,300	76,936.00	0.00
422	301498	乖宝宠物	700	76,559.00	0.00
423	601608	中信重工	17,500	76,475.00	0.00
424	600977	中国电影	7,100	76,112.00	0.00
425	600871	石化油服	38,900	75,855.00	0.00
426	300957	贝泰妮	1,700	75,174.00	0.00
427	601598	中国外运	15,200	74,936.00	0.00
428	600062	华润双鹤	4,000	74,640.00	0.00
429	000582	北部湾港	9,000	74,250.00	0.00
430	688387	信科移动	13,127	74,167.55	0.00
431	000785	居然智家	24,300	74,115.00	0.00

432	600056	中国医药	7,100	73,414.00	0.00
433	601106	中国一重	26,100	73,080.00	0.00
434	603233	大参林	4,440	72,372.00	0.00
435	603650	彤程新材	2,200	70,730.00	0.00
436	002153	石基信息	7,992	69,210.72	0.00
437	600925	苏能股份	13,200	69,036.00	0.00
438	688702	盛科通信	1,127	68,837.16	0.00
439	600373	中文传媒	6,700	68,809.00	0.00
440	000429	粤高速 A	5,100	67,983.00	0.00
441	601965	中国汽研	3,800	67,450.00	0.00
442	000537	中绿电	8,000	66,880.00	0.00
443	600606	绿地控股	40,500	66,015.00	0.00
444	002372	伟星新材	6,220	64,439.20	0.00
445	001286	陕西能源	7,400	64,380.00	0.00
446	003022	联泓新科	4,000	63,320.00	0.00
447	600098	广州发展	10,100	63,125.00	0.00
448	688281	华秦科技	1,042	63,051.42	0.00
449	601568	北元集团	15,120	62,748.00	0.00
450	600361	创新新材	15,700	62,643.00	0.00
451	688425	铁建重工	15,303	62,436.24	0.00
452	688563	航材股份	1,097	62,123.11	0.00
453	600688	上海石化	21,200	60,420.00	0.00
454	603658	安图生物	1,600	60,000.00	0.00
455	600612	老凤祥	1,200	59,700.00	0.00
456	000937	冀中能源	10,259	58,989.25	0.00
457	688349	三一重能	2,350	58,609.00	0.00
458	601019	山东出版	6,000	56,820.00	0.00
459	000898	鞍钢股份	23,300	54,056.00	0.00
460	002608	江苏国信	7,300	53,509.00	0.00
461	601139	深圳燃气	8,300	52,788.00	0.00
462	600339	中油工程	16,100	52,647.00	0.00

463	600032	浙江新能	6,900	52,164.00	0.00
464	301165	锐捷网络	840	51,626.40	0.00
465	688100	威胜信息	1,389	51,462.45	0.00
466	000959	首钢股份	15,100	51,340.00	0.00
467	603707	健友股份	4,585	51,122.75	0.00
468	600720	中交设计	6,600	51,018.00	0.00
469	003035	南网能源	11,100	50,949.00	0.00
470	600928	西安银行	12,800	50,176.00	0.00
471	600295	鄂尔多斯	5,600	48,776.00	0.00
472	002461	珠江啤酒	4,300	48,547.00	0.00
473	603556	海兴电力	1,900	48,393.00	0.00
474	301267	华夏眼科	2,500	47,925.00	0.00
475	601228	广州港	14,400	46,512.00	0.00
476	688248	南网科技	1,476	46,434.96	0.00
477	688172	燕东微	2,306	45,335.96	0.00
478	688375	国博电子	741	44,467.41	0.00
479	688475	萤石网络	1,389	43,781.28	0.00
480	002563	森马服饰	7,800	41,028.00	0.00
481	601061	中信金属	5,100	40,341.00	0.00
482	600927	永安期货	2,700	39,987.00	0.00
483	600007	中国国贸	1,900	39,102.00	0.00
484	000539	粤电力A	8,600	39,044.00	0.00
485	603786	科博达	700	38,787.00	0.00
486	002945	华林证券	2,600	37,362.00	0.00
487	300140	节能环保	6,000	37,020.00	0.00
488	600299	安迪苏	3,800	36,670.00	0.00
489	603826	坤彩科技	1,840	36,008.80	0.00
490	001213	中铁特货	8,600	34,916.00	0.00
491	688032	禾迈股份	348	34,751.28	0.00
492	601921	浙版传媒	4,200	33,852.00	0.00
493	688819	天能股份	1,143	31,729.68	0.00

494	601858	中国科传	1,500	29,175.00	0.00
495	601158	重庆水务	5,500	25,520.00	0.00
496	600956	新天绿能	3,000	23,160.00	0.00
497	688153	唯捷创芯	668	20,714.68	0.00
498	688295	中复神鹰	896	18,636.80	0.00
499	001389	广合科技	300	17,631.00	0.00
500	603868	飞科电器	400	14,348.00	0.00
501	002373	千方科技	97	902.10	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002625	光启技术	603,984.00	0.03
2	300339	润和软件	443,766.00	0.02
3	002384	东山精密	428,851.00	0.02
4	002966	苏州银行	398,269.00	0.02
5	000423	东阿阿胶	372,982.00	0.02
6	688608	恒玄科技	360,106.75	0.02
7	300476	胜宏科技	341,243.00	0.01
8	301236	软通动力	328,534.00	0.01
9	002340	格林美	328,288.00	0.01
10	002850	科达利	320,845.00	0.01
11	002156	通富微电	320,267.00	0.01
12	688235	百济神州	319,828.25	0.01
13	002273	水晶光电	319,172.00	0.01
14	002797	第一创业	316,783.00	0.01
15	300207	欣旺达	307,407.00	0.01
16	000066	中国长城	303,212.00	0.01

17	002281	光迅科技	289,377.00	0.01
18	002185	华天科技	284,137.00	0.01
19	000831	中国稀土	283,865.00	0.01
20	000988	华工科技	274,501.00	0.01

注：本项的"买入金额"均按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002625	光启技术	2,756,359.00	0.12
2	300339	润和软件	2,211,873.00	0.09
3	002384	东山精密	2,134,956.00	0.09
4	300476	胜宏科技	2,034,554.00	0.09
5	301236	软通动力	1,664,471.00	0.07
6	000988	华工科技	1,656,573.00	0.07
7	002850	科达利	1,596,736.00	0.07
8	002340	格林美	1,465,125.00	0.06
9	000423	东阿阿胶	1,464,860.00	0.06
10	002273	水晶光电	1,464,640.00	0.06
11	002966	苏州银行	1,454,858.00	0.06
12	300207	欣旺达	1,439,051.00	0.06
13	002156	通富微电	1,411,108.00	0.06
14	300251	光线传媒	1,403,481.00	0.06
15	000066	中国长城	1,401,234.00	0.06
16	002797	第一创业	1,395,399.00	0.06
17	002195	岩山科技	1,355,576.25	0.06
18	300866	安克创新	1,320,029.10	0.06
19	002517	恺英网络	1,301,876.00	0.06

20	300017	网宿科技	1,301,817.00	0.06
----	--------	------	--------------	------

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	44,513,344.65
卖出股票收入（成交）总额	171,174,224.30

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	4,066,481.10	0.19
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	4,066,481.10	0.19

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	019723	23国债20	30,000	3,057,507.95	0.14
2	019758	24国债21	10,000	1,008,973.15	0.05

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金	股票型	交易型开放式	天弘基金管理有限公司	2,002,507,971.98	91.70

7.11 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 本基金投资的前十名证券发行主体中，【东吴证券股份有限公司】于2024年11月08日收到中国证券监督管理委员会出具责令改正、公开处罚、公开批评的通报；【苏州银行股份有限公司】于2024年07月31日收到国家金融监督管理总局江苏监管局出具公开处罚的通报。本基金为指数型基金，上述主体所发行的证券系标的指数成份股，对上述主体发行的相关证券的投资决策程序符合相关法律法规及基金合同的要求。

7.13.2 基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

7.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	199,535.21
2	应收清算款	9,475,520.04
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	1,906,089.23
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	11,581,144.48

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

7.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持 有 人 户 数	户均持有的 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	持有份额	占总份 额比例

	(户)			比例		
天弘 中证5 00ETF F联接 A	29 1,6 36	4,254.84	224.14	0.00%	1,240,865,710.78	100.00%
天弘 中证5 00ETF F联接 C	76, 440	8,293.31	940,288.99	0.15%	633,000,545.42	99.85%
天弘 中证5 00ETF F联接 Y	346	4,028.29	-	-	1,393,788.80	100.00%
合计	36 5,2 94	5,136.14	940,513.13	0.05%	1,875,260,045.00	99.95%

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

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比 例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	天弘中证500ETF 联接A	870,639.75	0.07%
	天弘中证500ETF 联接C	96,156.76	0.02%
	天弘中证500ETF 联接Y	80,324.35	5.76%
	合计	1,047,120.86	0.06%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	天弘中证500ETF联接A	天弘中证500ETF联接C	天弘中证500ETF联接Y
基金合同生效日(2015年01月20日)基金份额总额	10,000,000.00	-	-
本报告期期初基金份额总额	1,374,875,883.63	733,049,420.54	384,029.56
本报告期基金总申购份额	153,041,342.99	373,346,299.46	1,389,024.43
减：本报告期基金总赎回份额	287,051,291.70	472,454,885.59	379,265.19
本报告期基金拆分变动份额	-	-	-

本报告期期末基金份额总额	1,240,865,934.92	633,940,834.41	1,393,788.80
--------------	------------------	----------------	--------------

§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，未发生管理人的重大人事变动。

本报告期内，本基金的基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期内，未发生涉及基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略没有改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金所聘用的会计师事务所未发生变化。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

10.6.1 管理人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人及其高级管理人员未发生受稽查或处罚的情况。

10.6.2 托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人及其高级管理人员未发生受稽查或处罚的情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元	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	佣金	占当期佣金总	

	元 数 量		交总额 的比例		量的比 例	
东方 财富 证券	2	-	-	-	-	-
东方 证券	1	-	-	-	-	-
方正 证券	5	174,491,017.28	80.90%	35,309.69	80.48%	-
光大 证券	2	-	-	-	-	-
广发 证券	3	-	-	-	-	-
国盛 证券	2	-	-	-	-	-
国泰 海通 证券	10	41,196,551.67	19.10%	8,565.82	19.52%	-
国投 证券	1	-	-	-	-	-
华鑫 证券	1	-	-	-	-	-
江海 证券	2	-	-	-	-	-
开源 证券	1	-	-	-	-	-
平安 证券	2	-	-	-	-	-
首创 证券	2	-	-	-	-	-
西部 证券	1	-	-	-	-	-

信达 证券	1	-	-	-	-	-
中国 银河 证券	2	-	-	-	-	-
中国 中金 财富 证券	1	-	-	-	-	-
中金 公司	1	-	-	-	-	-
中信 建投 证券	2	-	-	-	-	-
中信 证券	2	-	-	-	-	-

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：中信证券上海交易单元1个，中信证券深圳交易单元1个。

4、本基金报告期内停止租用交易单元：国投证券上海交易单元1个，华鑫证券深圳交易单元1个。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例

东方财富证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	1,129,101.50	52.79%	-	-	-	-	3,610,784.60	45.03%
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰海通证券	1,009,692.98	47.21%	-	-	-	-	4,408,539.30	54.97%
国投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中国银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中国中金财富证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金2024年第4季度报告	中国证监会规定媒介	2025-01-22
2	天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金2024年年度报告	中国证监会规定媒介	2025-03-31
3	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
4	天弘中证500交易型开放式	中国证监会规定媒介	2025-04-04

	指数证券投资基金联接基金基金合同		
5	天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议	中国证监会规定媒介	2025-04-04
6	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金更新基金托管人信息并修改基金合同等法律文件的公告	中国证监会规定媒介	2025-04-04
7	天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书（更新）	中国证监会规定媒介	2025-04-09
8	天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金（A类份额）基金产品资料概要（更新）	中国证监会规定媒介	2025-04-09
9	天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金（C类份额）基金产品资料概要（更新）	中国证监会规定媒介	2025-04-09
10	天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金（Y类份额）基金产品资料概要（更新）	中国证监会规定媒介	2025-04-09
11	天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金2025年第1季度报告	中国证监会规定媒介	2025-04-22
12	天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金（A类份额）基金产品资料概要（更新）	中国证监会规定媒介	2025-06-27
13	天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金	中国证监会规定媒介	2025-06-27

	(C类份额)基金产品资料概要(更新)		
14	天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金(Y类份额)基金产品资料概要(更新)	中国证监会规定媒介	2025-06-27

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

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

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，根据国泰海通证券股份有限公司2025年4月4日发布的《国泰海通证券股份有限公司关于完成公司名称变更、注册资本变更、公司章程修订及相应市场主体变更登记的公告》，自2025年4月3日起，本基金基金托管人中文名称由“国泰君安证券股份有限公司”变更为“国泰海通证券股份有限公司”。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旗下部分基金更新基金托管人信息并修改基金合同等法律文件的公告》。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准天弘中证500指数型发起式证券投资基金募集的文件
- 2、天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同
- 3、天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议
- 4、天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书
- 5、报告期内在指定报刊上披露的各项公告
- 6、中国证监会规定的其他文件

12.2 存放地点

天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层

12.3 查阅方式

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

公司网站：www.thfund.com.cn

天弘基金管理有限公司
二〇二五年八月二十九日