

天弘上证科创板综合指数增强型证券投资基金

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:招商银行股份有限公司

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。

基金托管人招商银行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04月22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	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 净资产变动表	18
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	47
7.1 期末基金资产组合情况	47
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	48
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	64
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	66
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	66
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	66
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	67
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	67
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	67
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	67
7.12 投资组合报告附注	67
§8 基金份额持有人信息	68
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	68
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	69

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.....	69
§9 开放式基金份额变动.....	69
§10 重大事件揭示.....	70
10.1 基金份额持有人大会决议.....	70
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	70
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	70
10.4 基金投资策略的改变	70
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	70
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	70
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	71
10.8 其他重大事件	72
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	73
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.....	73
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	73
§12 备查文件目录.....	73
12.1 备查文件目录	73
12.2 存放地点.....	73
12.3 查阅方式.....	74

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	天弘上证科创板综合指数增强型证券投资基金	
基金简称	天弘上证科创板综合指数增强	
基金主代码	023895	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2025年04月22日	
基金管理人	天弘基金管理有限公司	
基金托管人	招商银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	849,836,293.74份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	天弘上证科创板综合指数增强A	天弘上证科创板综合指数增强C
下属分级基金的交易代码	023895	023896
报告期末下属分级基金的份额总额	611,280,924.53份	238,555,369.21份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票型指数增强基金，在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，力争获取高于标的指数的投资收益。
投资策略	本基金采用指数增强型投资策略，以上证科创板综合指数作为基金投资组合的标的指数，结合深入的宏观面、基本面研究及数量化投资技术，在指数化投资基础上优化调整投资组合，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，年跟踪误差不超过7.75%，以实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。如因指数编制规则调整或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人将采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。本基金运作过程中，当标的指数成份股发生明显负面事件面临退市，且指数编制机构暂未作出调整的，基金管理人应当按照基金份

	额持有人利益优先的原则，履行内部决策程序后及时对相关成份股进行调整。本基金的投资策略包括：资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、其他类型资产投资策略。
业绩比较基准	上证科创板综合指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。

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	招商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	童建林	张姗
	联系电话	022-83310208	400-61-95555
	电子邮箱	service@thfund.com.cn	zhangshan_1027@cmbchina.com
客户服务电话		95046	400-61-95555
传真		022-83865564	0755-83195201
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	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
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	深圳市深南大道7088号招商银行大厦
邮政编码		300203	518040
法定代表人		黄辰立	缪建民

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
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04月22日（基金合同生效日）-2025年06月30日)	
	天弘上证科创板综合指数增强A	天弘上证科创板综合指数增强C
本期已实现收益	21,181,243.36	8,767,680.22
本期利润	40,236,373.64	20,158,274.96
加权平均基金份额本期利润	0.0516	0.0559
本期加权平均净值利润率	5.10%	5.53%
本期基金份额净值增长率	6.02%	5.94%
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	17,729,019.84	6,728,765.28
期末可供分配基金份额利润	0.0290	0.0282
期末基金资产净值	648,098,651.06	252,728,202.33
期末基金份额净值	1.0602	1.0594
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	6.02%	5.94%

- 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。
- 4、本基金合同于2025年04月22日生效，合同生效当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

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

天弘上证科创板综合指数增强A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	6.35%	1.02%	5.43%	0.96%	0.92%	0.06%
自基金合同 生效日起至 今	6.02%	0.92%	4.48%	0.92%	1.54%	0.00%

天弘上证科创板综合指数增强C

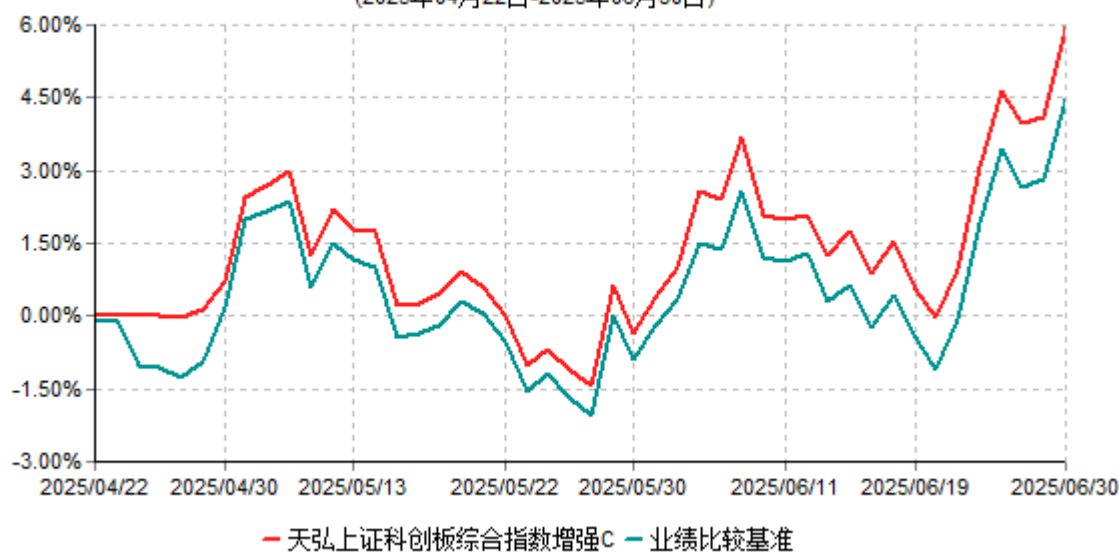
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	6.31%	1.01%	5.43%	0.96%	0.88%	0.05%
自基金合同 生效日起至 今	5.94%	0.92%	4.48%	0.92%	1.46%	0.00%

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

天弘上证科创板综合指数增强A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2025年04月22日-2025年06月30日)



天弘上证科创板综合指数增强C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2025年04月22日-2025年06月30日)



注：1、本基金合同于2025年04月22日生效，本基金合同生效起至披露时点不满1年。

2、按照本基金合同的约定，基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。本基金的建仓期为2025年04月22日至2025年10月21日，截止本报告期末本基金仍处于建仓期。

§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04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。

注：1、上述任职日期/离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金按照国家法律法规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%，科创综指上涨9.93%。

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科创综指均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科创综指的增强选股策略，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，天弘上证科创板综合指数增强A基金份额净值为1.0602元，天弘上证科创板综合指数增强C基金份额净值为1.0594元。报告期内份额净值增长率天弘上证科创板综合指数增强A为6.02%，同期业绩比较基准增长率为4.48%；天弘上证科创板综合指数增强C为5.94%，同期业绩比较基准增长率为4.48%。

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，险资和养老资金有望继续加大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。

具体行业赛道方面，在海外降息、国内货币和财政双宽松背景下，成长板块，特别是政策支持的新兴产业，相对更受益。今年可重点关注三大类机会：一是AI产业周期驱动下的TMT板块。人工智能是大国竞争的关键所在，其中智能算力又是AI的基础，国产算力(如昇腾等AI芯片)、国产大模型(如DeepSeek R1等)，叠加国内擅长的AI应用(如字节头条的豆包等)，国产AI生态正在逐步完善。国产算力建设相较海外滞后1-2年，随着昇腾910C等AI芯片的性能突破，国产算力规模有望快速增长。另外中国大模型的低成本路线使得大模型成本持续下降，AI应用有望迎来爆发式发展，并持续赋能实体经济，创造新的业绩增长点。二是在大国博弈背景下具有战略地位的行业，如国防军工、高端装备等细分赛道，一方面这些行业央企国企占比较高，做大做强仍是国企改革的重点方向，另一方面在地缘政治环境不确定性加大的情形下，战略性行业承担保障安全、突破封锁的任务，具备拥有持续估值溢价的可能性。三是具有全球范围内比较优势的新能源产业，经过三年多的深度调整以及924行情后的调整，估值又重新回到低位。同时产业也有积极变化，锂电行业在供需改善、技术突破与全球化布局加速等方面取得进展，光伏行业则处于供给侧改革的关键阶段，在政策引导、技术创新与市场自律三重驱动下加速整合，行业竞争趋于理性，景气度有望持续回升。本基金将持续跟踪各细分赛道的发展趋势和相关企业业绩兑现情况，并密切关注海外通胀、美联储政策、国内货币和财政政策变化对A股的潜在影响。

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

托管人声明：

招商银行具备完善的公司治理结构、内部稽核监控制度和风险控制制度，招商银行在履行托管职责中，严格遵守有关法律法规、托管协议的规定，尽职尽责地履行托管义务并安全保管托管资产。

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

招商银行根据法律法规、托管协议约定的投资监督条款，对托管产品的投资行为进行监督，并根据监管要求履行报告义务。

招商银行按照托管协议约定的统一记账方法和会计处理原则，独立地设置、登录和保管本产品的全套账册，进行会计核算和资产估值并与管理人建立对账机制。

本中期报告中利润分配情况真实、准确。

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

本中期报告中财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告内容真实、准确，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§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：天弘上证科创板综合指数增强型证券投资基金
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
资 产：		
货币资金	6.4.7.1	55,557,521.91
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	6.4.7.2	859,994,463.15
其中：股票投资		859,765,458.13
基金投资		-
债券投资		229,005.02
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	36,400,000.00
应收清算款		-
应收股利		-

应收申购款		4,272,235.09
递延所得税资产		-
其他资产	6.4.7.5	-
资产总计		956,224,220.15
负债和净资产	附注号	本期末 2025年06月30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		54,480,521.91
应付管理人报酬		663,836.17
应付托管费		124,469.28
应付销售服务费		97,017.59
应付投资顾问费		-
应交税费		0.16
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.6	31,521.65
负债合计		55,397,366.76
净资产:		
实收基金	6.4.7.7	849,836,293.74
未分配利润	6.4.7.8	50,990,559.65
净资产合计		900,826,853.39
负债和净资产总计		956,224,220.15

注：1.报告截止日2025年06月30日，天弘上证科创板综合指数增强型证券投资基金A类基金份额净值1.0602元，天弘上证科创板综合指数增强型证券投资基金C类基金份额净值1.0594元；基金份额总额849,836,293.74份，其中天弘上证科创板综合指数增强型证

券投资基金A类基金份额611,280,924.53份，天弘上证科创板综合指数增强型证券投资基金C类基金份额238,555,369.21份。

2.本财务报表的实际编制期间为2025年04月22日(基金合同生效日)至2025年06月30日，无上一年度可比期间(下同)。

6.2 利润表

会计主体：天弘上证科创板综合指数增强型证券投资基金

本报告期：2025年04月22日（基金合同生效日）至2025年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025年04月22日（基金合同 生效日）至2025年06月30 日
一、营业总收入		62,765,286.52
1.利息收入		375,839.76
其中：存款利息收入	6.4.7.9	47,849.59
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		327,990.17
其他利息收入		-
2.投资收益（损失以“-”填列）		31,882,085.12
其中：股票投资收益	6.4.7.10	28,590,737.77
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	4.87
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	-
股利收益	6.4.7.15	3,291,342.48
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	30,445,725.02
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	61,636.62
减：二、营业总支出		2,370,637.92
1.管理人报酬		1,744,697.79
2.托管费		327,130.83
3.销售服务费		277,127.80
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		0.01
8.其他费用	6.4.7.19	21,681.49
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		60,394,648.60
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		60,394,648.60
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		60,394,648.60

6.3 净资产变动表

会计主体：天弘上证科创板综合指数增强型证券投资基金

本报告期：2025年04月22日（基金合同生效日）至2025年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2025年04月22日（基金合同生效日）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	-	-	-
二、本期期初净资产	1,331,973,374.76	-	1,331,973,374.76
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-482,137,081.02	50,990,559.65	-431,146,521.37

（一）、综合收益总额	-	60,394,648.60	60,394,648.60
（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）	-482,137,081.02	-9,404,088.95	-491,541,169.97
其中：1.基金申购款	322,925,901.01	5,706,545.25	328,632,446.26
2.基金赎回款	-805,062,982.03	-15,110,634.20	-820,173,616.23
（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	849,836,293.74	50,990,559.65	900,826,853.39

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

天弘上证科创板综合指数增强型证券投资基金（以下简称“本基金”）系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2025]577号《关于准予天弘上证科创板综合指数增强型证券投资基金注册的批复》的准许，由基金管理人天弘基金管理有限公司自2025年04月01日至2025年04月18日止期间向社会公开发行募集，募集期结束经安永华明会计师事务所（特殊普通合伙）验证并出具安永华明（2025）验字第80007653_B07号验资报告后，向中国证监会报送基金备案材料。基金合同于2025年04月22日正式生效。本基金的运作方式为契约型开放式，存续期限不定。

设立时募集的扣除认购费后的实收基金（本金）为人民币1,331,551,583.15元，募集资金在募集期间产生的利息为人民币421,791.61元，以上实收基金（本息）合计为人民

币1,331,973,374.76元，折合1,331,973,374.76份基金份额，其中A类基金份额830,519,894.01份，C类基金份额501,453,480.75份。本基金的基金管理人为天弘基金管理有限公司，基金托管人为招商银行股份有限公司。

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

6.4.2 会计报表的编制基础

本财务报表系按照财政部颁布的《企业会计准则——基本准则》以及其后颁布及修订的具体会计准则、解释以及《资产管理产品相关会计处理规定》和其他相关规定（统称“企业会计准则”）编制，同时，在信息披露和估值方面，也参考了中国证监会颁布的《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04月22日(基金合同生效日)至2025年06月30日止期间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04月22日(基金合同生效日)至2025年06月30日止期间的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2025年04月22日(基金合同生效日)至2025年06月30日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

本基金根据管理金融资产的业务模式和合同现金流量特征，在初始确认时将金融资产划分为以摊余成本计量的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。本基金未持有以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

本基金将同时符合下列条件且未被指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，分类为以摊余成本计量的金融资产：

- 本基金管理该金融资产的业务模式是以收取合同现金流量为目标；
- 该金融资产的合同条款规定，在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。

除上述以摊余成本计量的金融资产外，本基金将其余所有的金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

(2) 金融负债的分类

本基金将金融负债分类为以摊余成本计量的金融负债。本基金无分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

(1) 金融工具的初始确认

金融资产和金融负债在本基金成为相关金融工具合同条款的一方时，于资产负债表内确认。

在初始确认时，金融资产及金融负债均以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产或金融负债，相关交易费用直接计入当期损益；对于其他类别的金融资产或金融负债，相关交易费用计入初始确认金额。

(2) 金融工具的后续计量

初始确认后，对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债以公允价值进行后续计量，产生的利得或损失(包括利息、股利收入和利息费用)计入当期损益，除非该金融资产属于套期关系的一部分。

初始确认后，对于以摊余成本计量的金融资产和金融负债采用实际利率法以摊余成本计量。以摊余成本计量且不属于任何套期关系的一部分的金融资产所产生的利得或损失，在终止确认、重分类、按照实际利率法摊销或确认减值时，计入当期损益。

(3) 金融工具的终止确认

满足下列条件之一时，本基金终止确认该金融资产：

- 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；
- 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；
- 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产整体转移满足终止确认条件的，本基金将下列两项金额的差额计入当期损益：

- 所转移金融资产在终止确认日的账面价值；
- 因转移金融资产而收到的对价。

金融负债(或其一部分)的现时义务已经解除的，本基金终止确认该金融负债(或该部分金融负债)。

(4) 金融工具的减值

本基金以预期信用损失为基础，对以摊余成本计量的金融资产进行减值会计处理并确认损失准备。

预期信用损失，是指以发生违约的风险为权重的金融工具信用损失的加权平均值。信用损失，是指本基金按照原实际利率折现的、根据合同应收的所有合同现金流量与预期收取的所有现金流量之间的差额，即全部现金短缺的现值。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

公允价值是指市场参与者在计量日发生的有序交易中，出售一项资产所能收到或者转移一项负债所需支付的价格。

本基金在确定相关金融资产和金融负债的公允价值时，根据企业会计准则的规定采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术。

本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场且能够获取相同资产或负债报价的金融工具，在估值日有报价的，除会计准则规定的情况外，将该报价不加调整地应用于该资产或负债的公允价值计量；估值日无报价且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，采用最近交易日的报价确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的报价不能真实反映公允价值的，对报价进行调整，确定公允价值。与上述金融工具相同，但具有不同特征的，以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，本基金不考虑因其大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价；

(2) 对不存在活跃市场的金融工具，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术确定公允价值时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值；

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响证券价格的重大事件，参考类似金融工具的现行市价及重大变化等因素，对估值进行调整并确定公允价值。

6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行的基金份额总额所对应的金额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日确认。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

6.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占净资产比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占净资产比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

6.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

利息收入

存款利息收入是按借出货币资金的时间和实际利率计算确定。

买入返售金融资产在资金实际占用期间内按实际利率法逐日确认为利息收入。

投资收益

股票投资收益和债券投资收益按相关金融资产于处置日成交金额与其初始计量金额的差额确认，处置时产生的交易费用计入投资收益。

股利收益按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额扣除应由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资，在其持有期间，按票面金额和票面利率计算的利息计入投资收益。

公允价值变动收益

公允价值变动收益核算基金持有的采用公允价值模式计量的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、衍生工具、以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债等公允价值变动形成的应计入当期损益的利得或损失。不包括本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的债券投资在持有期间按票面利率计算的利息。

本基金参与的转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率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(以下简称“证金公司”)出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息，以及出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为当期损益。

6.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法确认。

以摊余成本计量的金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

6.4.4.11 基金的收益分配政策

在符合有关基金分红条件的前提下，本基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以公告为准，若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；

本基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资者可选择现金红利或将现金红利自动转为对应类别的基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；基金份额持有人可对A类、C类基金份额分别选择不同的分红方式；

由于本基金A类基金份额不收取销售服务费，而C类基金份额收取销售服务费，各类别基金份额对应的可供分配利润将有所不同，本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

在不违反法律法规且对基金份额持有人利益无实质性不利影响的前提下，基金管理人在履行适当程序后可酌情调整以上基金收益分配原则，但应于变更实施日前在规定媒介公告。

6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

编制财务报表时，本基金需要运用估计和假设，这些估计和假设会对会计政策的应用及资产、负债、收入和支出的金额产生影响。实际情况可能与这些估计不同。本基金对估计涉及的关键假设和不确定因素的判断进行持续评估，会计估计变更的影响在变更当期和未来期间予以确认。

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《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》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

对于在发行时明确一定期限限售期的股票，根据中基协发[2017]6号《关于发布<证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)>的通知》，在估值日按照流通受限股票计算公式确定估值日流通受限股票的价值。

根据《关于固定收益品种的估值处理标准》在银行间债券市场、上海证券交易所、深圳证券交易所、北京证券交易所及中国证券监督管理委员会认可的其他交易场所上市交易或挂牌转让的固定收益品种(估值处理标准另有规定的除外)，采用第三方估值基准服务机构提供的价格数据进行估值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 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	4,013,968.79
等于：本金	4,012,855.85
加：应计利息	1,112.94
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	51,543,553.12
等于：本金	51,543,009.75
加：应计利息	543.37
减：坏账准备	-
合计	55,557,521.91

注：其他存款为存放在证券经纪商证券资金账户的证券交易结算资金。

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末			
		2025年06月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		829,319,733.11	-	859,765,458.13	30,445,725.02
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	229,000.00	5.02	229,005.02	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	229,000.00	5.02	229,005.02	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-

其他	-	-	-	-
合计	829,548,733.11	5.02	859,994,463.15	30,445,725.02

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

单位：人民币元

项目	本期末 2025年06月30日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
交易所市场	36,400,000.00	-
银行间市场	-	-
合计	36,400,000.00	-

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	14,159.55
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	-
其中：交易所市场	-

银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	17,362.10
合计	31,521.65

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 天弘上证科创板综合指数增强A

金额单位：人民币元

项目 (天弘上证科创板综合指数增强A)	本期 2025年04月22日（基金合同生效日）至2025年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	830,519,894.01	830,519,894.01
本期申购	177,716,480.34	177,716,480.34
本期赎回（以“-”号填列）	-396,955,449.82	-396,955,449.82
本期末	611,280,924.53	611,280,924.53

6.4.7.7.2 天弘上证科创板综合指数增强C

金额单位：人民币元

项目 (天弘上证科创板综合指数增强C)	本期 2025年04月22日（基金合同生效日）至2025年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	501,453,480.75	501,453,480.75
本期申购	145,209,420.67	145,209,420.67
本期赎回（以“-”号填列）	-408,107,532.21	-408,107,532.21
本期末	238,555,369.21	238,555,369.21

注：1、申购含转换转入份额；赎回含转换转出份额。

2、本基金合同于2025年04月22日生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,331,973,374.76份基金份额，其中认购资金利息折合421,791.61份基金份额。

6.4.7.8 未分配利润

6.4.7.8.1 天弘上证科创板综合指数增强A

单位：人民币元

项目 (天弘上证科创板综合 指数增强A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期期初(基金合同生 效日)	-	-	-
本期利润	21,181,243.36	19,055,130.28	40,236,373.64
本期基金份额交易产 生的变动数	-3,452,223.52	33,576.41	-3,418,647.11
其中：基金申购款	1,334,720.12	1,934,813.59	3,269,533.71
基金赎回款	-4,786,943.64	-1,901,237.18	-6,688,180.82
本期已分配利润	-	-	-
本期末	17,729,019.84	19,088,706.69	36,817,726.53

6.4.7.8.2 天弘上证科创板综合指数增强C

单位：人民币元

项目 (天弘上证科创板综合 指数增强C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期期初(基金合同生 效日)	-	-	-
本期利润	8,767,680.22	11,390,594.74	20,158,274.96
本期基金份额交易产 生的变动数	-2,038,914.94	-3,946,526.90	-5,985,441.84
其中：基金申购款	1,241,723.76	1,195,287.78	2,437,011.54
基金赎回款	-3,280,638.70	-5,141,814.68	-8,422,453.38
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,728,765.28	7,444,067.84	14,172,833.12

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年04月22日（基金合同生效日）至2025年06月30日
活期存款利息收入	32,563.09
定期存款利息收入	-
其他存款利息收入	15,275.76
结算备付金利息收入	-
其他	10.74
合计	47,849.59

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年04月22日（基金合同生效日）至2025年06月30日
卖出股票成交总额	1,011,582,094.15
减：卖出股票成本总额	981,761,317.48
减：交易费用	1,230,038.90
买卖股票差价收入	28,590,737.77

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04月22日（基金合同生效日）至2025年06月30日
债券投资收益——利息收入	4.87
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	-
债券投资收益——赎回差价收入	-

债券投资收益——申购差价收入	-
合计	4.87

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

本基金本报告期未取得其他衍生工具投资收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年04月22日（基金合同生效日）至2025年06月30日
股票投资产生的股利收益	3,291,342.48
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	3,291,342.48

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04月22日（基金合同生效日）至2025年06月30日
1.交易性金融资产	30,445,725.02
——股票投资	30,445,725.02
——债券投资	-

——资产支持证券投资	-
——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	30,445,725.02

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年04月22日（基金合同生效日）至2025年06月30日
基金赎回费收入	61,471.93
基金转换费收入	164.69
合计	61,636.62

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内未发生信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025年04月22日（基金合同生效日）至2025年06月30日
审计费用	17,362.10
信息披露费	-
证券出借违约金	-
汇划手续费	2,444.20

开户费	1,600.00
存托服务费	275.19
合计	21,681.49

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
招商银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券交易。

6.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025年04月22日（基金合同生效日）至2025年 06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,744,697.79
其中：应支付销售机构的客户维护费	759,848.54
应支付基金管理人的净管理费	984,849.25

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

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025年04月22日（基金合同生效日）至2025年06月 30日
当期发生的基金应支付的托管费	327,130.83

注:支付基金托管人招商银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值0.15%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费＝前一日基金资产净值×该日适用费率/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售	本期
------	----

服务费的各关联方名称	2025年04月22日（基金合同生效日）至2025年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	天弘上证科创板综合指数增强A	天弘上证科创板综合指数增强C	合计
天弘基金管理有限公司	-	39.03	39.03
招商银行股份有限公司	-	18,226.83	18,226.83
合计	-	18,265.86	18,265.86

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。天弘上证科创板综合指数增强C的销售服务费率
为0.40%。销售服务费的计算公式为：

日销售服务费＝前一日各级基金资产净值×该日适用费率/当年天数。

2、天弘上证科创板综合指数增强A不收取销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行过银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期末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

本基金本报告期末未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

天弘上证科创板综合指数增强A

本基金本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

天弘上证科创板综合指数增强C

本基金本报告期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04月22日（基金合同生效日）至2025年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
招商银行股份有限公司	4,013,968.79	32,563.09

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末未在承销期内参与关联方承销证券交易。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期无利润分配事项。

6.4.12 期末（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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购	受限期	流通受限	认购价格	期末估值	数量（单	期末成本	期末估值	备注

		日		类型		单价	位：股)	总额	总额	
688775	影石创新	2025-06-04	6个月	科创板打新限售	47.27	124.16	573	27,085.71	71,143.68	-
001388	信通电子	2025-06-24	1个月内(含)	新股未上市	16.42	16.42	843	13,842.06	13,842.06	-
603400	华之杰	2025-06-12	6个月	新股锁定	19.88	43.81	57	1,133.16	2,497.17	-
603382	海阳科技	2025-06-05	6个月	新股锁定	11.50	22.39	105	1,207.50	2,350.95	-
001388	信通电子	2025-06-24	6个月	新股锁定	16.42	16.42	94	1,543.48	1,543.48	-

6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
118057	甬矽转债	2025-06-26	1个月内(含)	新债未上市	100.00	100.00	2,290	229,000.00	229,005.02	-

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股中需要限售的部分或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名	停牌日	停牌原	期末估	复牌日	复牌开	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	-----	-----	-----	-----	-----	-----	-------	--------	--------	----

码	称	期	因	值 单 价	期	盘 单 价				
688313	仕佳光子	2025-06-30	重大事 项	38.05	2025-07-11	39.98	119,400	3,425,770.06	4,543,170.00	-

注:本基金截至2025年06月30日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

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

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

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

部、基金运营部等从不同角度、不同环节对投资全过程实行风险监控和管理；三是投资到结算的全流程，已经形成了一套贯穿“事前风险定位、事中风险管理和事后风险评估”的健全风险监控体系。

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

6.4.13.2 信用风险

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

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

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末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
AAA	-
AAA以下	229,005.02
未评级	-
合计	229,005.02

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	55,557,521.91	-	-	-	55,557,521.91
交易性金融资产	-	-	229,005.02	859,765,458.13	859,994,463.15
买入返售金融资产	36,400,000.00	-	-	-	36,400,000.00
应收申购款	-	-	-	4,272,235.09	4,272,235.09
资产总计	91,957,521.91	-	229,005.02	864,037,693.22	956,224,220.15
负债					
应付赎回款	-	-	-	54,480,521.91	54,480,521.91
应付管理人报酬	-	-	-	663,836.17	663,836.17
应付托管费	-	-	-	124,469.28	124,469.28
应付销售服务费	-	-	-	97,017.59	97,017.59
应交税费	-	-	-	0.16	0.16
其他负债	-	-	-	31,521.65	31,521.65
负债总计	-	-	-	55,397,366.76	55,397,366.76
利率敏感度缺口	91,957,521.91	-	229,005.02	808,640,326.46	900,826,853.39

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0.03%，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响。

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，以上证科创板综合指数作为基金投资组合的标的指数，结合深入的宏观面、基本面研究及数量化投资技术，在指数化投资基础上优化调整投资组合。

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025年06月30日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产—股票投资	859,765,458.13	95.44
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	859,765,458.13	95.44

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
	业绩比较基准上升5%	47,088,089.40
	业绩比较基准下降5%	-47,088,089.40

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
第一层次	855,130,910.79
第二层次	4,787,560.56
第三层次	75,991.80
合计	859,994,463.15

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。

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	859,765,458.13	89.91
	其中：股票	859,765,458.13	89.91
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	229,005.02	0.02
	其中：债券	229,005.02	0.02
	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	36,400,000.00	3.81
	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	55,557,521.91	5.81
8	其他各项资产	4,272,235.09	0.45
9	合计	956,224,220.15	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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	618,359,684.94	68.64
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	143,181,780.39	15.89
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	19,824,123.66	2.20
N	水利、环境和公共设施管理业	115,670.00	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	781,481,258.99	86.75

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	67,896,840.94	7.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,307,655.20	0.59
J	金融业	3,572,657.00	0.40
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	969,330.00	0.11
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	537,716.00	0.06
S	综合	-	-
	合计	78,284,199.14	8.69

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	688041	海光信息	331,412	46,825,201.48	5.20
2	688256	寒武纪	59,098	35,547,447.00	3.95
3	688981	中芯国际	248,485	21,908,922.45	2.43
4	688111	金山办公	66,087	18,507,664.35	2.05
5	688012	中微公司	92,342	16,833,946.60	1.87
6	688008	澜起科技	170,435	13,975,670.00	1.55
7	688506	百利天恒	46,711	13,832,061.32	1.54
8	688271	联影医疗	94,085	12,018,417.90	1.33
9	688036	传音控股	126,463	10,079,101.10	1.12
10	688396	华润微	200,560	9,458,409.60	1.05
11	688082	盛美上海	79,832	9,096,058.08	1.01
12	688608	恒玄科技	22,067	7,678,874.66	0.85
13	688213	XD思特威	74,488	7,614,163.36	0.85
14	689009	九号公司	127,160	7,524,057.20	0.84
15	688126	沪硅产业	380,561	7,124,101.92	0.79
16	688122	西部超导	137,256	7,120,841.28	0.79
17	688297	中无人机	129,397	6,909,799.80	0.77
18	688223	晶科能源	1,154,637	5,992,566.03	0.67
19	688629	华丰科技	101,375	5,798,650.00	0.64
20	688099	晶晨股份	78,404	5,567,468.04	0.62
21	688778	厦钨新能	96,736	5,409,477.12	0.60
22	688702	盛科通信	87,051	5,317,075.08	0.59
23	688183	生益电子	101,369	5,190,092.80	0.58
24	688047	龙芯中科	38,468	5,131,246.52	0.57
25	688200	华峰测控	32,938	4,749,659.60	0.53
26	688009	中国通号	923,609	4,747,350.26	0.53
27	688208	道通科技	154,838	4,738,042.80	0.53
28	688475	萤石网络	149,650	4,716,968.00	0.52

29	688313	仕佳光子	119,400	4,543,170.00	0.50
30	688303	大全能源	210,599	4,489,970.68	0.50
31	688522	纳睿雷达	86,885	4,450,249.70	0.49
32	688385	复旦微电	89,387	4,404,097.49	0.49
33	688728	格科微	277,967	4,280,691.80	0.48
34	688521	芯原股份	43,266	4,175,169.00	0.46
35	688146	中船特气	143,624	4,152,169.84	0.46
36	688548	广钢气体	395,631	3,964,222.62	0.44
37	688065	凯赛生物	82,808	3,900,256.80	0.43
38	688123	聚辰股份	47,578	3,853,342.22	0.43
39	688018	乐鑫科技	26,280	3,839,508.00	0.43
40	688198	佰仁医疗	37,296	3,829,926.24	0.43
41	688578	艾力斯	40,999	3,814,546.96	0.42
42	688361	中科飞测	44,445	3,741,824.55	0.42
43	688188	柏楚电子	28,298	3,725,714.68	0.41
44	688278	特宝生物	50,289	3,626,339.79	0.40
45	688520	神州细胞	60,211	3,603,628.35	0.40
46	688169	石头科技	22,674	3,549,614.70	0.39
47	688270	臻镭科技	75,531	3,516,723.36	0.39
48	688336	三生国健	64,789	3,514,155.36	0.39
49	688049	炬芯科技	57,106	3,454,913.00	0.38
50	688617	惠泰医疗	11,609	3,447,873.00	0.38
51	688262	国芯科技	128,027	3,414,480.09	0.38
52	688668	鼎通科技	54,426	3,399,447.96	0.38
53	688128	中国电研	138,021	3,381,514.50	0.38
54	688120	华海清科	19,439	3,279,359.30	0.36
55	688372	伟测科技	54,261	3,277,364.40	0.36
56	688249	晶合集成	161,583	3,275,287.41	0.36
57	688232	新点软件	108,595	3,262,193.80	0.36
58	688582	芯动联科	48,142	3,235,142.40	0.36
59	688599	天合光能	217,930	3,166,522.90	0.35

60	688048	长光华芯	54,407	3,141,460.18	0.35
61	688508	芯朋微	55,567	3,101,749.94	0.34
62	688661	和林微纳	77,840	3,095,696.80	0.34
63	688155	先惠技术	59,800	3,086,876.00	0.34
64	688593	新相微	187,700	3,065,141.00	0.34
65	688636	智明达	90,323	3,052,014.17	0.34
66	688158	优刻得	134,242	3,036,554.04	0.34
67	688161	威高骨科	112,221	3,006,400.59	0.33
68	688343	云天励飞	60,659	2,997,767.78	0.33
69	688293	奥浦迈	66,587	2,997,080.87	0.33
70	688469	芯联集成	628,129	2,996,175.33	0.33
71	688035	德邦科技	72,967	2,963,919.54	0.33
72	688277	天智航	213,008	2,960,811.20	0.33
73	688072	拓荆科技	18,903	2,905,580.13	0.32
74	688538	和辉光电	1,235,302	2,890,606.68	0.32
75	688187	时代电气	67,263	2,868,766.95	0.32
76	688488	艾迪药业	207,058	2,867,753.30	0.32
77	688085	三友医疗	149,048	2,866,193.04	0.32
78	688258	卓易信息	58,706	2,843,131.58	0.32
79	688334	西高院	163,281	2,805,167.58	0.31
80	688119	中钢洛耐	665,700	2,782,626.00	0.31
81	688512	慧智微	254,155	2,772,831.05	0.31
82	688023	安恒信息	48,746	2,765,848.04	0.31
83	688088	虹软科技	57,253	2,762,457.25	0.31
84	688103	国力股份	45,393	2,761,710.12	0.31
85	688233	神工股份	86,451	2,746,548.27	0.30
86	688595	芯海科技	73,365	2,743,117.35	0.30
87	688677	海泰新光	69,504	2,711,351.04	0.30
88	688180	君实生物	79,750	2,709,905.00	0.30
89	688683	莱尔科技	106,569	2,687,670.18	0.30
90	688100	威胜信息	72,335	2,680,011.75	0.30

91	688410	山外山	187,617	2,664,161.40	0.30
92	688280	精进电动	366,188	2,662,186.76	0.30
93	688602	康鹏科技	315,663	2,645,255.94	0.29
94	688269	凯立新材	79,064	2,624,924.80	0.29
95	688777	中控技术	58,058	2,607,384.78	0.29
96	688076	诺泰生物	69,955	2,603,725.10	0.29
97	688325	赛微微电	53,800	2,582,400.00	0.29
98	688768	容知日新	56,514	2,508,656.46	0.28
99	688112	鼎阳科技	67,775	2,505,641.75	0.28
100	688162	巨一科技	91,662	2,496,872.88	0.28
101	688348	昱能科技	57,795	2,483,451.15	0.28
102	688600	皖仪科技	105,394	2,476,759.00	0.27
103	688314	康拓医疗	78,980	2,438,902.40	0.27
104	688307	中润光学	84,550	2,404,602.00	0.27
105	688137	近岸蛋白	62,710	2,401,793.00	0.27
106	688328	深科达	105,814	2,396,687.10	0.27
107	688029	南微医学	35,200	2,377,760.00	0.26
108	688558	国盛智科	93,975	2,371,929.00	0.26
109	688279	峰昭科技	12,706	2,356,963.00	0.26
110	688375	国博电子	39,095	2,346,090.95	0.26
111	688015	交控科技	111,336	2,320,242.24	0.26
112	688659	元琛科技	264,573	2,309,722.29	0.26
113	688281	华秦科技	38,142	2,307,972.42	0.26
114	688220	翱捷科技	29,443	2,305,386.90	0.26
115	688472	阿特斯	251,729	2,303,320.35	0.26
116	688031	星环科技	48,749	2,273,165.87	0.25
117	688335	复洁环保	184,349	2,249,057.80	0.25
118	688373	盟科药业	357,063	2,238,785.01	0.25
119	688002	睿创微纳	31,873	2,222,185.56	0.25
120	688591	泰凌微	46,121	2,209,195.90	0.25
121	688630	芯碁微装	27,683	2,197,199.71	0.24

122	688266	泽璟制药	20,352	2,188,043.52	0.24
123	688690	纳微科技	95,634	2,183,324.22	0.24
124	688685	迈信林	38,953	2,175,525.05	0.24
125	688349	三一重能	86,665	2,161,425.10	0.24
126	688177	百奥泰	85,511	2,142,905.66	0.24
127	688306	均普智能	216,593	2,131,275.12	0.24
128	688055	龙腾光电	572,782	2,119,293.40	0.24
129	688027	国盾量子	7,697	2,116,751.97	0.23
130	688026	洁特生物	126,978	2,082,439.20	0.23
131	688383	新益昌	40,482	2,058,914.52	0.23
132	688300	联瑞新材	43,946	2,045,686.30	0.23
133	688333	铂力特	34,068	2,029,090.08	0.23
134	688063	派能科技	45,006	2,028,870.48	0.23
135	688519	南亚新材	45,151	2,022,764.80	0.22
136	688525	佰维存储	29,363	1,979,066.20	0.22
137	688400	凌云光	70,805	1,952,093.85	0.22
138	688017	绿的谐波	15,600	1,948,284.00	0.22
139	688195	腾景科技	43,200	1,944,000.00	0.22
140	688052	纳芯微	11,000	1,919,390.00	0.21
141	688665	四方光电	42,502	1,900,689.44	0.21
142	688299	长阳科技	96,052	1,898,948.04	0.21
143	688716	中研股份	52,276	1,861,025.60	0.21
144	688717	艾罗能源	34,375	1,850,406.25	0.21
145	688711	宏微科技	104,781	1,843,097.79	0.20
146	688499	利元亨	43,780	1,821,685.80	0.20
147	688073	毕得医药	30,726	1,782,722.52	0.20
148	688425	铁建重工	436,321	1,780,189.68	0.20
149	688202	美迪西	49,425	1,775,840.25	0.20
150	688676	金盘科技	53,081	1,775,559.45	0.20
151	688113	联测科技	48,653	1,760,752.07	0.20
152	688692	达梦数据	7,863	1,752,584.07	0.19

153	688612	威迈斯	64,403	1,722,136.22	0.19
154	688536	思瑞浦	12,360	1,714,579.20	0.19
155	688432	有研硅	153,907	1,699,133.28	0.19
156	688039	当虹科技	50,968	1,672,769.76	0.19
157	688772	珠海冠宇	115,962	1,657,096.98	0.18
158	688513	苑东生物	40,200	1,650,612.00	0.18
159	688160	步科股份	19,051	1,632,670.70	0.18
160	688182	灿勤科技	59,044	1,627,252.64	0.18
161	688565	力源科技	174,605	1,615,096.25	0.18
162	688108	赛诺医疗	143,551	1,610,642.22	0.18
163	688315	诺禾致源	113,440	1,601,772.80	0.18
164	688005	容百科技	71,200	1,589,184.00	0.18
165	688610	埃科光电	39,920	1,583,227.20	0.18
166	688329	艾隆科技	80,986	1,558,170.64	0.17
167	688588	凌志软件	106,535	1,552,214.95	0.17
168	688114	华大智造	23,743	1,539,258.69	0.17
169	688428	诺诚健华	62,722	1,532,298.46	0.17
170	688318	财富趋势	12,587	1,446,498.04	0.16
171	688116	XD天奈科	31,513	1,442,350.01	0.16
172	688819	天能股份	51,767	1,437,051.92	0.16
173	688568	中科星图	39,458	1,420,882.58	0.16
174	688235	百济神州	6,067	1,417,493.88	0.16
175	688312	燕麦科技	58,414	1,403,688.42	0.16
176	688561	奇安信	40,574	1,378,704.52	0.15
177	688455	科捷智能	97,584	1,373,006.88	0.15
178	688779	五矿新能	250,257	1,361,398.08	0.15
179	688331	荣昌生物	22,432	1,357,136.00	0.15
180	688260	昀冢科技	82,271	1,355,826.08	0.15
181	688345	博力威	48,853	1,345,900.15	0.15
182	688056	莱伯泰科	39,600	1,321,848.00	0.15
183	688597	煜邦电力	168,384	1,318,446.72	0.15

184	688567	孚能科技	90,903	1,318,093.50	0.15
185	688613	奥精医疗	68,233	1,304,614.96	0.14
186	688192	迪哲医药	21,812	1,304,357.60	0.14
187	688456	有研粉材	36,000	1,294,200.00	0.14
188	688351	微电生理	65,470	1,289,759.00	0.14
189	688563	航材股份	22,552	1,277,119.76	0.14
190	688518	联赢激光	62,400	1,272,336.00	0.14
191	688302	海创药业	27,147	1,270,479.60	0.14
192	688552	航天南湖	31,784	1,268,499.44	0.14
193	688363	华熙生物	24,630	1,264,750.50	0.14
194	688121	卓然股份	103,766	1,253,493.28	0.14
195	688290	景业智能	23,756	1,238,162.72	0.14
196	688010	福光股份	39,798	1,235,329.92	0.14
197	688586	江航装备	108,000	1,215,000.00	0.13
198	688022	瀚川智能	81,815	1,212,498.30	0.13
199	688053	思科瑞	39,098	1,209,301.14	0.13
200	688523	航天环宇	55,800	1,200,258.00	0.13
201	688327	云从科技	85,364	1,177,169.56	0.13
202	688167	炬光科技	14,382	1,161,346.50	0.13
203	688019	安集科技	7,599	1,153,528.20	0.13
204	688107	安路科技	40,393	1,140,698.32	0.13
205	688222	成都先导	68,432	1,100,386.56	0.12
206	688510	航亚科技	45,377	1,097,215.86	0.12
207	688127	蓝特光学	42,600	1,095,246.00	0.12
208	688097	博众精工	39,183	1,093,597.53	0.12
209	688505	复旦张江	123,200	1,066,912.00	0.12
210	688669	聚石化学	56,310	1,062,569.70	0.12
211	688004	博汇科技	53,279	1,060,252.10	0.12
212	688216	气派科技	45,883	1,052,097.19	0.12
213	688639	华恒生物	33,185	1,051,964.50	0.12
214	688671	碧兴物联	48,776	1,041,367.60	0.12

215	688625	呈和科技	34,000	1,039,720.00	0.12
216	688267	中触媒	36,008	1,036,310.24	0.12
217	688680	海优新材	23,348	1,031,981.60	0.11
218	688590	新致软件	49,800	1,022,892.00	0.11
219	688185	康希诺	17,000	1,013,710.00	0.11
220	688356	键凯科技	13,800	974,280.00	0.11
221	688670	金迪克	67,093	935,947.35	0.10
222	688660	电气风电	103,783	900,836.44	0.10
223	688408	中信博	19,200	896,256.00	0.10
224	688382	益方生物	26,800	879,576.00	0.10
225	688234	天岳先进	14,901	872,453.55	0.10
226	688283	坤恒顺维	31,600	867,420.00	0.10
227	688693	锆威特	25,822	852,384.22	0.09
228	688084	晶品特装	9,600	844,800.00	0.09
229	688443	智翔金泰	29,965	831,229.10	0.09
230	688172	燕东微	41,931	824,363.46	0.09
231	688109	品茗科技	26,420	822,454.60	0.09
232	688391	钜泉科技	26,528	787,616.32	0.09
233	688322	奥比中光	13,055	770,375.55	0.09
234	688078	龙软科技	23,559	746,820.30	0.08
235	688380	中微半导	27,486	744,870.60	0.08
236	688166	博瑞医药	13,548	727,663.08	0.08
237	688709	成都华微	21,848	715,303.52	0.08
238	688429	时创能源	49,014	712,663.56	0.08
239	688239	航宇科技	19,800	692,604.00	0.08
240	688399	硕世生物	13,200	666,600.00	0.07
241	688585	上纬新材	85,068	661,829.04	0.07
242	688317	之江生物	36,000	648,720.00	0.07
243	688170	德龙激光	25,742	648,698.40	0.07
244	688050	爱博医疗	9,400	647,190.00	0.07
245	688255	凯尔达	19,200	646,848.00	0.07

246	688507	索辰科技	8,716	639,144.28	0.07
247	688186	广大特材	22,087	631,909.07	0.07
248	688347	华虹公司	11,503	631,629.73	0.07
249	688288	鸿泉物联	21,600	626,616.00	0.07
250	688655	迅捷兴	29,386	622,689.34	0.07
251	688037	芯源微	5,806	622,403.20	0.07
252	688737	中自科技	28,045	602,967.50	0.07
253	688058	宝兰德	21,000	602,070.00	0.07
254	688498	源杰科技	3,077	600,015.00	0.07
255	688021	奥福科技	38,640	590,805.60	0.07
256	688658	悦康药业	30,000	571,200.00	0.06
257	688150	莱特光电	21,456	530,392.32	0.06
258	688526	科前生物	32,103	500,164.74	0.06
259	688611	杭州柯林	14,633	477,474.79	0.05
260	688503	聚和材料	11,470	474,743.30	0.05
261	688365	光云科技	29,800	453,556.00	0.05
262	688163	赛伦生物	22,800	443,460.00	0.05
263	688295	中复神鹰	21,277	442,561.60	0.05
264	688598	金博股份	16,792	426,852.64	0.05
265	688248	南网科技	13,329	419,330.34	0.05
266	688392	骄成超声	5,926	403,738.38	0.04
267	688387	信科移动	68,991	389,799.15	0.04
268	688326	经纬恒润	4,200	374,808.00	0.04
269	688509	正元地信	85,840	368,253.60	0.04
270	688217	睿昂基因	14,067	355,895.10	0.04
271	688516	奥特维	10,326	343,236.24	0.04
272	688362	甬矽电子	11,408	339,730.24	0.04
273	688682	霍莱沃	10,466	327,585.80	0.04
274	688301	奕瑞科技	3,496	306,284.56	0.03
275	688550	瑞联新材	7,084	304,682.84	0.03
276	688013	天臣医疗	10,216	298,613.68	0.03

277	688276	百克生物	13,223	277,683.00	0.03
278	688409	富创精密	4,337	238,578.37	0.03
279	688020	方邦股份	6,000	227,220.00	0.03
280	688339	亿华通	10,400	222,040.00	0.02
281	688686	奥普特	2,200	210,364.00	0.02
282	688141	杰华特	6,422	209,228.76	0.02
283	688450	光格科技	7,622	201,373.24	0.02
284	688484	南芯科技	4,926	194,823.30	0.02
285	688201	信安世纪	14,947	193,563.65	0.02
286	688337	普源精电	5,400	192,618.00	0.02
287	688087	英科再生	7,485	192,364.50	0.02
288	688798	艾为电子	2,785	189,937.00	0.02
289	688093	世华科技	5,951	184,778.55	0.02
290	688378	奥来德	10,431	175,762.35	0.02
291	688291	金橙子	5,785	175,343.35	0.02
292	688319	欧林生物	10,369	162,378.54	0.02
293	688696	极米科技	1,400	160,104.00	0.02
294	688197	首药控股	4,400	159,280.00	0.02
295	688360	德马科技	8,325	154,428.75	0.02
296	688663	新风光	5,405	145,664.75	0.02
297	688285	高铁电气	15,050	123,410.00	0.01
298	688698	伟创电气	2,600	122,720.00	0.01
299	688230	芯导科技	2,200	121,946.00	0.01
300	688196	卓越新能	2,400	115,368.00	0.01
301	688433	华曙高科	3,133	115,137.75	0.01
302	688502	茂莱光学	400	115,064.00	0.01
303	688787	海天瑞声	1,061	112,656.98	0.01
304	688215	瑞晟智能	2,800	106,456.00	0.01
305	688311	盟升电子	2,395	103,104.75	0.01
306	688025	杰普特	1,400	100,100.00	0.01
307	688070	纵横股份	2,000	96,600.00	0.01

308	688701	卓锦股份	11,400	93,936.00	0.01
309	688030	山石网科	5,838	93,349.62	0.01
310	688171	纬德信息	3,000	92,280.00	0.01
311	688700	东威科技	2,326	91,760.70	0.01
312	688221	前沿生物	8,489	85,229.56	0.01
313	688189	南新制药	11,200	83,328.00	0.01
314	688667	菱电电控	1,522	80,985.62	0.01
315	688083	中望软件	1,197	77,098.77	0.01
316	688579	山大地纬	6,800	76,092.00	0.01
317	688627	精智达	839	73,840.39	0.01
318	688090	瑞松科技	2,025	69,639.75	0.01
319	688638	誉辰智能	1,768	68,704.48	0.01
320	688238	和元生物	10,209	63,295.80	0.01
321	688486	龙迅股份	940	62,867.20	0.01
322	688379	华光新材	1,790	62,041.40	0.01
323	688652	京仪装备	1,000	57,320.00	0.01
324	688003	天准科技	1,200	55,080.00	0.01
325	688566	吉贝尔	1,620	44,047.80	0.00
326	688117	圣诺生物	1,214	40,851.10	0.00
327	688584	上海合晶	2,209	39,496.92	0.00
328	688080	映翰通	734	37,353.26	0.00
329	688147	微导纳米	1,162	35,069.16	0.00
330	688143	长盈通	766	29,874.00	0.00
331	688358	祥生医疗	969	28,730.85	0.00
332	688733	壹石通	1,366	25,872.04	0.00
333	688707	振华新材	1,750	23,712.50	0.00
334	688253	英诺特	739	22,805.54	0.00
335	688298	东方生物	800	21,880.00	0.00
336	688179	阿拉丁	1,715	21,814.80	0.00
337	688553	汇宇制药	1,305	21,258.45	0.00
338	688697	纽威数控	1,572	20,970.48	0.00

339	688033	天宜新材	3,200	20,512.00	0.00
340	688181	八亿时空	623	19,387.76	0.00
341	688251	井松智能	869	18,735.64	0.00
342	688148	芳源股份	3,284	17,766.44	0.00
343	688261	东微半导	400	16,500.00	0.00
344	688388	嘉元科技	780	15,662.40	0.00
345	688679	通源环境	1,000	14,970.00	0.00
346	688066	航天宏图	720	14,097.60	0.00
347	688691	灿芯股份	160	9,897.60	0.00
348	688549	中巨芯	1,118	8,653.32	0.00
349	688528	秦川物联	712	7,376.32	0.00
350	688156	路德环境	400	6,764.00	0.00
351	688096	京源环保	400	6,088.00	0.00
352	688577	浙海德曼	120	5,626.80	0.00
353	688152	麒麟信安	120	5,623.20	0.00
354	688130	晶华微	120	2,652.00	0.00
355	688296	和达科技	120	1,575.60	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300308	中际旭创	14,000	2,042,040.00	0.23
2	300803	指南针	25,000	2,016,500.00	0.22
3	300476	胜宏科技	13,600	1,827,568.00	0.20
4	300073	当升科技	36,600	1,605,642.00	0.18
5	300850	新强联	43,500	1,558,170.00	0.17
6	300033	同花顺	5,700	1,556,157.00	0.17
7	300990	同飞股份	30,500	1,521,950.00	0.17
8	300207	欣旺达	75,800	1,520,548.00	0.17

9	300101	振芯科技	66,600	1,507,158.00	0.17
10	300772	运达股份	114,200	1,470,896.00	0.16
11	300373	扬杰科技	28,300	1,468,770.00	0.16
12	300748	金力永磁	61,100	1,456,624.00	0.16
13	301031	中熔电气	18,224	1,451,541.60	0.16
14	300077	国民技术	56,400	1,443,840.00	0.16
15	300363	博腾股份	84,500	1,443,260.00	0.16
16	301069	凯盛新材	89,400	1,440,234.00	0.16
17	300274	阳光电源	21,200	1,436,724.00	0.16
18	301363	美好医疗	81,400	1,435,896.00	0.16
19	300393	中来股份	247,100	1,423,296.00	0.16
20	300623	捷捷微电	47,700	1,421,460.00	0.16
21	300083	创世纪	172,700	1,419,594.00	0.16
22	301029	怡合达	61,900	1,415,034.00	0.16
23	300456	赛微电子	82,100	1,411,299.00	0.16
24	300303	聚飞光电	221,300	1,403,042.00	0.16
25	300257	开山股份	139,200	1,401,744.00	0.16
26	300768	迪普科技	81,600	1,399,440.00	0.16
27	300185	通裕重工	485,900	1,389,674.00	0.15
28	300567	精测电子	22,900	1,387,969.00	0.15
29	300558	贝达药业	23,900	1,385,005.00	0.15
30	300080	易成新能	330,400	1,381,072.00	0.15
31	301090	华润材料	182,000	1,370,460.00	0.15
32	300124	汇川技术	21,200	1,368,884.00	0.15
33	300433	蓝思科技	61,300	1,366,990.00	0.15
34	300395	菲利华	26,700	1,364,370.00	0.15
35	300628	亿联网络	39,200	1,362,592.00	0.15
36	300702	天宇股份	58,300	1,356,058.00	0.15
37	300685	艾德生物	62,900	1,354,237.00	0.15
38	300357	我武生物	65,600	1,353,984.00	0.15
39	300705	九典制药	85,600	1,332,792.00	0.15

40	300458	全志科技	30,120	1,195,462.80	0.13
41	300049	福瑞股份	36,300	1,177,209.00	0.13
42	300072	海新能科	328,800	1,160,664.00	0.13
43	300035	中科电气	68,700	1,159,656.00	0.13
44	300573	兴齐眼药	22,320	1,155,952.80	0.13
45	300454	深信服	12,100	1,139,578.00	0.13
46	301536	星宸科技	18,500	1,115,550.00	0.12
47	300199	翰宇药业	67,200	1,112,160.00	0.12
48	302132	中航成飞	12,500	1,099,250.00	0.12
49	300003	乐普医疗	77,900	1,073,462.00	0.12
50	300763	锦浪科技	17,700	1,015,803.00	0.11
51	300666	江丰电子	13,100	970,710.00	0.11
52	300759	康龙化成	39,500	969,330.00	0.11
53	300655	晶瑞电材	80,200	802,802.00	0.09
54	301205	联特科技	6,200	594,332.00	0.07
55	300750	宁德时代	2,300	580,106.00	0.06
56	300026	红日药业	149,000	549,810.00	0.06
57	300133	华策影视	71,600	537,716.00	0.06
58	300212	易华录	24,400	530,944.00	0.06
59	301018	申菱环境	12,500	474,250.00	0.05
60	300323	华灿光电	59,400	454,410.00	0.05
61	300913	兆龙互连	9,360	438,235.20	0.05
62	300869	康泰医学	23,000	329,820.00	0.04
63	300738	奥飞数据	13,800	288,834.00	0.03
64	300168	万达信息	33,000	253,110.00	0.03
65	300604	长川科技	5,600	251,496.00	0.03
66	300602	飞荣达	9,800	207,858.00	0.02
67	300682	朗新集团	7,700	180,950.00	0.02
68	688775	影石创新	573	71,143.68	0.01
69	300777	中简科技	800	29,000.00	0.00
70	300679	电连技术	600	27,228.00	0.00

71	300224	正海磁材	1,100	15,565.00	0.00
72	001388	信通电子	937	15,385.54	0.00
73	301510	固高科技	500	15,025.00	0.00
74	300348	长亮科技	400	6,956.00	0.00
75	300394	天孚通信	80	6,387.20	0.00
76	603400	华之杰	57	2,497.17	0.00
77	603382	海阳科技	105	2,350.95	0.00
78	301339	通行宝	40	685.20	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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	688041	海光信息	69,033,417.96	7.66
2	688256	寒武纪	57,471,532.06	6.38
3	688981	中芯国际	32,067,425.57	3.56
4	688111	金山办公	26,398,844.69	2.93
5	688012	中微公司	23,475,970.46	2.61
6	688271	联影医疗	21,343,894.62	2.37
7	688506	百利天恒	19,865,574.25	2.21
8	688008	澜起科技	19,263,870.06	2.14
9	688036	传音控股	18,906,948.81	2.10
10	688608	恒玄科技	13,928,859.17	1.55
11	689009	九号公司	12,691,095.33	1.41
12	688223	晶科能源	12,277,445.77	1.36
13	688047	龙芯中科	11,614,050.36	1.29
14	688396	华润微	11,554,126.25	1.28
15	688082	盛美上海	10,663,360.32	1.18
16	688521	芯原股份	10,497,112.41	1.17

17	688009	中国通号	10,243,721.30	1.14
18	688617	惠泰医疗	9,998,584.73	1.11
19	688188	柏楚电子	9,976,850.20	1.11
20	688126	沪硅产业	9,853,094.13	1.09

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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	688041	海光信息	18,384,092.16	2.04
2	688256	寒武纪	14,167,934.26	1.57
3	688981	中芯国际	9,394,196.05	1.04
4	688271	联影医疗	9,076,539.05	1.01
5	688552	航天南湖	8,949,884.73	0.99
6	688036	传音控股	8,743,971.10	0.97
7	688336	三生国健	8,347,000.32	0.93
8	688498	源杰科技	7,595,695.87	0.84
9	688111	金山办公	7,216,542.31	0.80
10	688506	百利天恒	6,948,094.59	0.77
11	688002	睿创微纳	6,917,570.86	0.77
12	688008	澜起科技	6,881,440.71	0.76
13	688700	东威科技	6,461,293.40	0.72
14	688047	龙芯中科	6,413,865.37	0.71
15	688521	芯原股份	6,406,956.89	0.71
16	688617	惠泰医疗	6,355,402.54	0.71
17	688187	时代电气	6,312,940.67	0.70
18	688188	柏楚电子	6,046,871.27	0.67
19	688472	阿特斯	5,986,831.91	0.66

20	688777	中控技术	5,929,441.71	0.66
----	--------	------	--------------	------

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	1,811,081,050.59
卖出股票收入（成交）总额	1,011,582,094.15

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	229,005.02	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	229,005.02	0.03

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	118057	甬矽转债	2,290	229,005.02	0.03

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

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	-
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	4,272,235.09
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,272,235.09

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持 有 人 户 数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总 份额 比例	持有份额	占总份 额比例
天弘 上证 科创 板综 合指 数增 强A	15 8,2 93	3,861.71	1,498,978.64	0.25%	609,781,945.89	99.75%
天弘 上证 科创 板综 合指 数增	15, 941	14,964.89	590,091.78	0.25%	237,965,277.43	99.75%

强C						
合计	17 2,1 28	4,937.23	2,089,070.42	0.25%	847,747,223.32	99.75%

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	天弘上证科创板综合指数增强A	193,036.47	0.03%
	天弘上证科创板综合指数增强C	30,141.08	0.01%
	合计	223,177.55	0.03%

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	天弘上证科创板综合指数增强A	0
	天弘上证科创板综合指数增强C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	天弘上证科创板综合指数增强A	0~10
	天弘上证科创板综合指数增强C	0
	合计	0~10

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	天弘上证科创板综合指数增强A	天弘上证科创板综合指数增强C
基金合同生效日(2025年04月22日)基金份额总额	830,519,894.01	501,453,480.75
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	177,716,480.34	145,209,420.67
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	396,955,449.82	408,107,532.21
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	611,280,924.53	238,555,369.21

注：本基金合同于2025年04月22日生效。

§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，基金托管人无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及基金托管业务的诉讼。

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，基金托管人及其高级管理人员没有受到监管部门稽查或处罚。

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	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰海通证券	3	1,731,991,332.14	61.37%	334,016.63	59.96%	-
国信证券	3	329,155,437.54	11.66%	64,542.39	11.59%	-
华泰证券	3	761,207,039.55	26.97%	158,519.90	28.46%	-
中信证券	3	-	-	-	-	-

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

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

10.7.2 基金租用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	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

				比例				
国泰海通证券	-	-	1,000,600,000.00	35.70%	-	-	-	-
国信证券	-	-	1,097,570,000.00	39.16%	-	-	-	-
华泰证券	-	-	406,900,000.00	14.52%	-	-	-	-
中信证券	-	-	297,900,000.00	10.63%	-	-	-	-

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	天弘上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金份额发售公告	中国证监会规定媒介	2025-03-29
2	天弘上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金合同	中国证监会规定媒介	2025-03-29
3	天弘上证科创板综合指数增强型证券投资基金托管协议	中国证监会规定媒介	2025-03-29
4	天弘上证科创板综合指数增强型证券投资基金招募说明书	中国证监会规定媒介	2025-03-29
5	天弘上证科创板综合指数增强型证券投资基金（A类份额）基金产品资料概要	中国证监会规定媒介	2025-03-29
6	天弘上证科创板综合指数增强型证券投资基金（C类份额）基金产品资料概要	中国证监会规定媒介	2025-03-29
7	天弘上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会规定媒介	2025-04-23
8	天弘上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金合同	中国证监会规定媒介	2025-04-24
9	天弘上证科创板综合指数增强型证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会规定媒介	2025-04-24

10	天弘上证科创板综合指数增强型证券投资基金（A类份额）基金产品资料概要（更新）	中国证监会规定媒介	2025-04-24
11	天弘上证科创板综合指数增强型证券投资基金（C类份额）基金产品资料概要（更新）	中国证监会规定媒介	2025-04-24
12	天弘基金管理有限公司关于天弘上证科创板综合指数增强型证券投资基金开放日常申购、赎回、转换及定期定额投资业务的公告	中国证监会规定媒介	2025-04-30

§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

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

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准天弘上证科创板综合指数增强型证券投资基金募集的文件
- 2、天弘上证科创板综合指数增强型证券投资基金基金合同
- 3、天弘上证科创板综合指数增强型证券投资基金托管协议
- 4、天弘上证科创板综合指数增强型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

天弘基金管理有限公司
二〇二五年八月二十九日