

天弘中证电网设备主题指数型发起式证券投资基金

2026 年中期报告

2026 年 06 月 30 日

基金管理人:天弘基金管理有限公司

基金托管人:中国建设银行股份有限公司

送出日期:2026 年 08 月 31 日

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2026年01月01日起至2026年06月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
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	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	15
6.3 净资产变动表	17
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	49
7.1 期末基金资产组合情况	49
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	50
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	52
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	56
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	62
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	62
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	62
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	62
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	62
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	63
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	63
7.12 投资组合报告附注	63
§8 基金份额持有人信息	64
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	64
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	65

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.....	65
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	65
§9 开放式基金份额变动.....	66
§10 重大事件揭示	66
10.1 基金份额持有人大会决议	66
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	66
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	67
10.4 基金投资策略的改变	67
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	67
10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况	67
10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况	68
10.8 其他重大事件	68
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	70
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.....	70
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	70
§12 备查文件目录.....	70
12.1 备查文件目录	70
12.2 存放地点.....	71
12.3 查阅方式.....	71

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	天弘中证电网设备主题指数型发起式证券投资基金	
基金简称	天弘中证电网设备主题指数发起	
基金主代码	025832	
基金运作方式	契约型开放式、发起式	
基金合同生效日	2025年11月25日	
基金管理人	天弘基金管理有限公司	
基金托管人	中国建设银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	4,492,410,107.09份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	天弘中证电网设备主题指数发起A	天弘中证电网设备主题指数发起C
下属分级基金的交易代码	025832	025833
报告期末下属分级基金的份额总额	1,039,612,201.83份	3,452,797,905.26份

2.2 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，实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。
投资策略	本基金主要采用完全复制法，即按照标的指数的成份股组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化进行相应调整。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。本基金主要投资策略包括：股票投资策略、存托凭证投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、国债期货投资策略、股票期权投资策略、

	参与融资及转融通证券出借业务策略。
业绩比较基准	中证电网设备主题指数收益率×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。本基金为指数型基金，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	中国建设银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	童建林	王小飞
	联系电话	022-83310208	021-60637103
	电子邮箱	service@thfund.com.cn	wangxiaofei.zh@ccb.com
客户服务电话		400-986-8888	021-60637228
传真		022-83865564	021-60635778
注册地址		天津自贸试验区（中心商务区）新华路3678号宝风大厦（新金融大厦）16层02单元3号房间	北京市西城区金融大街25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	北京市西城区闹市口大街1号院1号楼
邮政编码		300203	100033
法定代表人		黄辰立	张金良

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金中期报告的管理人互联网网址	www.thfund.com.cn
基金中期报告置备地	基金管理人及基金托管人的办公地址

点	
---	--

2.5 其他相关资料

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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2026年01月01日-2026年06月30日)	
	天弘中证电网设备主题指数发起A	天弘中证电网设备主题指数发起C
本期已实现收益	59,985,171.58	236,089,868.50
本期利润	133,241,122.11	699,906,955.47
加权平均基金份额本期利润	0.1910	0.1972
本期加权平均净值利润率	13.79%	14.44%
本期基金份额净值增长率	35.21%	35.09%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2026年06月30日)	
期末可供分配利润	72,215,446.56	234,536,154.24
期末可供分配基金份额利润	0.0695	0.0679
期末基金资产净值	1,504,571,244.77	4,991,320,658.87
期末基金份额净值	1.4472	1.4456
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2026年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	44.72%	44.56%

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

天弘中证电网设备主题指数发起A

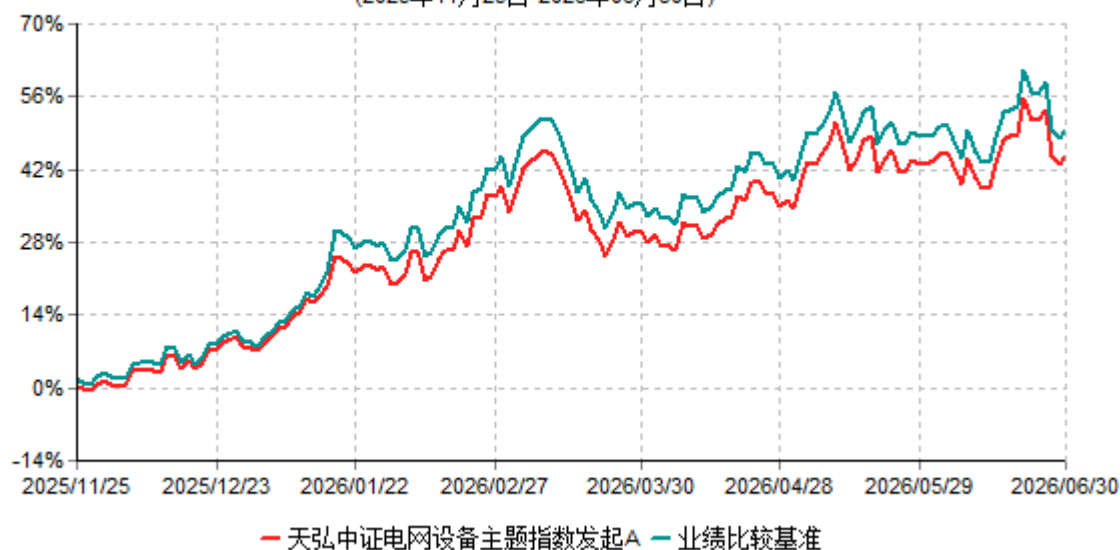
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	13.23%	2.15%	12.45%	2.13%	0.78%	0.02%
过去六个月	35.21%	2.10%	38.40%	2.15%	-3.19%	-0.05%
自基金合同 生效日起至 今	44.72%	1.96%	49.64%	2.02%	-4.92%	-0.06%

天弘中证电网设备主题指数发起C

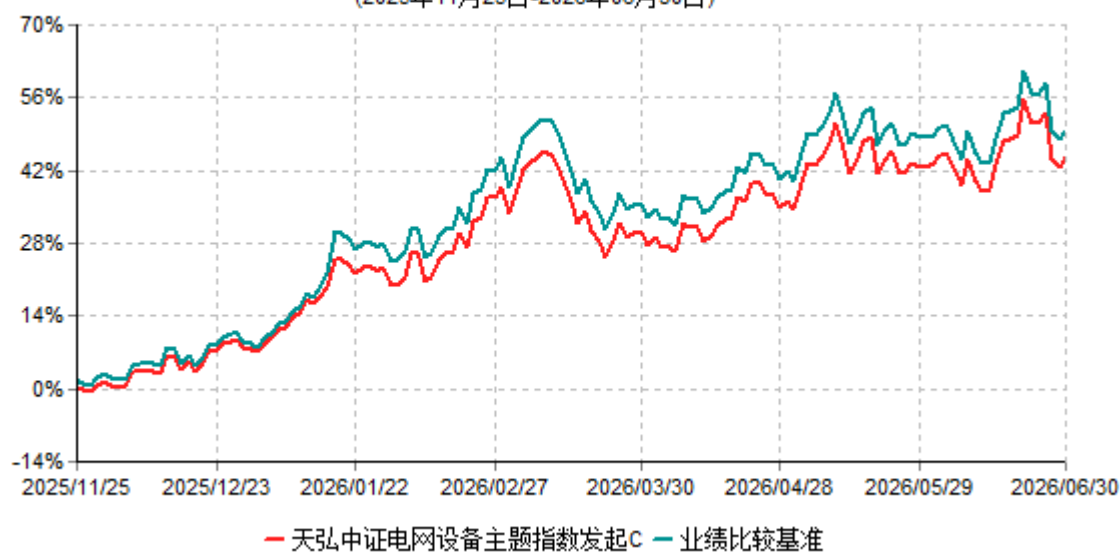
阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去三个月	13.19%	2.15%	12.45%	2.13%	0.74%	0.02%
过去六个月	35.09%	2.10%	38.40%	2.15%	-3.31%	-0.05%
自基金合同 生效日起至 今	44.56%	1.96%	49.64%	2.02%	-5.08%	-0.06%

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

天弘中证电网设备主题指数发起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11月25日-2026年06月30日)



天弘中证电网设备主题指数发起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11月25日-2026年06月30日)



注：1、本基金合同于2025年11月25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11月25日至2026年05月24日，建仓期结束时及至报告期末，各项资产配置比例均符合基金合同的约定。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张戈	本基金基金经理	2025年12月12日	-	13年	男，管理科学与工程专业博士。历任建信基金管理有限责任公司研究员、投资经理，大家保险资产管理公司投资经理。2022年9月加盟本公司。
刘笑明	本基金基金经理	2025年11月25日	-	12年	男，运筹学硕士。历任建信基金管理有限责任公司量化研究员、北京极至投资管

		日			理有限公司投资经理、中国人保资产管理有限公司基金经理，2020年4月加盟本公司。
--	--	---	--	--	--

注：1、上述任职日期/离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

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

本报告期内，本基金运作合法合规，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2026年一季度A股冲高回落、结构分化。1月"春季躁动"沪指突破4100点创10年新高，3月受美伊冲突、通胀与加息预期扰动快速回调。中观层面盈利筑底修复构成支撑，但内需偏弱、居民缩表、社融不及预期仍制约上行空间，两会"十五五"定调积极财政+宽松货币托底；外部扰动较大，市场先定价美联储降息，随后沃什获提名偏鹰、美伊冲突推高油价，全球流动性预期从"降息"反转至"加息担忧"，风险偏好与无风险利率双杀，成长承压、防御占优。

二季度市场逐步进入地缘冲突与产业机遇交织的关键窗口。尽管面临美伊局势等外部变量带来的短期扰动，但随着美伊和平谅解备忘录签署、霍尔木兹海峡通航预期恢复，全球通胀和加息担忧明显降温，叠加海外市场率先反弹，A股市场风险偏好正在迎来修复，因此短期波动不掩盖结构性机会。

报告期内，基金管理人坚持以被动指数化投资为原则进行基金的投资运作，将基金的跟踪误差及跟踪偏离度控制在合理水平。日度偏离主要源于申赎资金及打新收益等。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2026年06月30日，天弘中证电网设备主题指数发起A基金份额净值为1.4472元，天弘中证电网设备主题指数发起C基金份额净值为1.4456元。报告期内份额净值增长率天弘中证电网设备主题指数发起A为35.21%，同期业绩比较基准增长率为38.40%；天弘中证电网设备主题指数发起C为35.09%，同期业绩比较基准增长率为38.40%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

从中长期来看，旺盛的产业发展趋势才是决定板块定价的核心锚点，短期地缘消息、市场情绪和大盘整体波动终究只是次要变量，难以扭转高景气赛道的上行大方向。AI产业革命仍处于早期而非末期，具备通用技术变革属性，绝不能简单套用传统周期股的产能扩张、需求饱和、估值见顶框架来定价，而应将其视为跨越数年的成长赛道。

在具体的产业线索上，海外AI数据中心建设极具韧性，北美四大云厂2026年资本开支预期达7000亿美元以上量级，算力集群正从万卡向十万甚至百万卡规模演进，电力、算力、光互联、大模型与应用正形成持续商业闭环。“算电协同”正成为新的重要方向，AI数据中心扩张带动了电网设备资本开支预期上修。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内本基金管理人无应说明预警信息。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，中国建设银行股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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基金托管人应尽的义务。

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，本基金托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

报告期内，本基金利润分配情况符合法律法规和基金合同的相关约定。

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

本托管人复核审查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。

§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：天弘中证电网设备主题指数型发起式证券投资基金

报告截止日：2026年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
资 产：			
货币资金	6.4.7.1	461,902,042.89	48,836,981.83
结算备付金		7,154,126.01	521,612.81
存出保证金		2,443,237.24	10,025.76
交易性金融资产	6.4.7.2	6,176,707,179.49	375,860,125.17
其中：股票投资		6,174,884,453.63	374,049,270.92
基金投资		-	-
债券投资		1,822,725.86	1,810,854.25
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		-	7,133,173.52
应收股利		-	-
应收申购款		128,485,802.08	25,212,179.91
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	-
资产总计		6,776,692,387.71	457,574,099.00
负债和净资产	附注号	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
负 债：			

短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		13,133,428.21	-
应付赎回款		264,281,680.69	63,235,152.31
应付管理人报酬		899,647.73	26,150.08
应付托管费		299,882.55	8,716.70
应付销售服务费		934,247.77	29,387.52
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	1,251,597.12	82,988.25
负债合计		280,800,484.07	63,382,394.86
净资产：			
实收基金	6.4.7.7	4,492,410,107.09	368,370,845.22
未分配利润	6.4.7.8	2,003,481,796.55	25,820,858.92
净资产合计		6,495,891,903.64	394,191,704.14
负债和净资产总计		6,776,692,387.71	457,574,099.00

注：1.报告截止日2026年06月30日，天弘中证电网设备主题指数型发起式证券投资基金A类基金份额净值1.4472元，天弘中证电网设备主题指数型发起式证券投资基金C类基金份额净值1.4456元；基金份额总额4,492,410,107.09份，其中天弘中证电网设备主题指数型发起式证券投资基金A类基金份额1,039,612,201.83份，天弘中证电网设备主题指数型发起式证券投资基金C类基金份额3,452,797,905.26份。

2.本基金的合同生效日为2025年11月25日，无上一年度可比期间(下同)。

6.2 利润表

会计主体：天弘中证电网设备主题指数型发起式证券投资基金

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
-----	-----	----

		2026年01月01日至2026年06月30日
一、营业总收入		843,536,914.69
1.利息收入		806,010.66
其中：存款利息收入	6.4.7.9	806,010.66
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）		291,503,208.01
其中：股票投资收益	6.4.7.10	259,728,001.32
基金投资收益		-
债券投资收益	6.4.7.11	11,871.61
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	31,763,335.08
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	537,073,037.50
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	14,154,658.52
减：二、营业总支出		10,388,837.11
1.管理人报酬		4,211,716.25
2.托管费		1,403,905.38
3.销售服务费		4,683,588.04
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		-

8.其他费用	6.4.7.19	89,627.44
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		833,148,077.58
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		833,148,077.58
五、其他综合收益的税后净额		-
六、综合收益总额		833,148,077.58

6.3 净资产变动表

会计主体：天弘中证电网设备主题指数型发起式证券投资基金

本报告期：2026年01月01日至2026年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	368,370,845.22	25,820,858.92	394,191,704.14
二、本期期初净资产	368,370,845.22	25,820,858.92	394,191,704.14
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	4,124,039,261.87	1,977,660,937.63	6,101,700,199.50
（一）、综合收益总额	-	833,148,077.58	833,148,077.58
（二）、本期基金份额交易产生的净资产变动数（净资产减少以“-”号填列）	4,124,039,261.87	1,144,512,860.05	5,268,552,121.92
其中：1.基金申购款	17,528,562,906.15	5,978,266,002.62	23,506,828,908.77
2.基金赎回款	-13,404,523,644.28	-4,833,753,142.57	-18,238,276,786.85

（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	4,492,410,107.09	2,003,481,796.55	6,495,891,903.64

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

天弘中证电网设备主题指数型发起式证券投资基金（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]2231号《关于准予天弘中证电网设备主题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自2025年11月10日至2025年11月21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_B32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11月25日正式生效。本基金的运作方式为契约型开放式、发起式，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76,022,596.58元，募集资金在募集期间产生的利息为人民币12,361.93元，以上实收基金（本息）合计为人民币76,034,958.51元，折合76,034,958.51份基金份额，其中A类基金份额24,368,060.50份，C类基金份额51,666,898.01份。本基金的基金管理人为天弘基金管理有限公司，基金托管人为中国建设银行股份有限公司。

本基金主要投资于标的指数的成份股和备选成份股（含存托凭证）。为更好地实现投资目标，本基金可能会少量投资于依法发行上市的非成份股（包括主板、科创板、创业板及其他经中国证监会核准或注册上市的股票、存托凭证）、债券（包括国债、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含分离交易可转债的纯债部分）、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、资产支持证券、债券回购、金融衍生工具（包括国债期货、股指期货、股票期权等）、银行存款（包括协议存款、定期存款及其他银行存款）、同业存单、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）。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90%，投资于标的指数成份股、备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的80%，因法律法规的规定而受限制的情形除外；本基金每个交易日日终在扣除股指期货、国债期货、股票期权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。股指期货、国债期货、股票期权及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。如法律法规或中国证监会变更投资品种的投资比例限制，基金管理人在履行适当程序后，可以调整上述投资品种的投资比例。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

6.4.4 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。

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根据基金合同约定的费率和计算方法核算。

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

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；

本基金各基金份额类别在费用收取上不同，其对应的可供分配利润可能有所不同。同一类别的每一基金份额享有同等分配权；

在符合以下有关基金分红条件的情形下，基金管理人可以根据实际情况进行收益分配，具体分配方案以届时的公告为准：（1）本基金可每月对基金相对业绩比较基准的超额收益率以及基金的可供分配利润进行评价，收益评价日核定的基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率或者基金可供分配利润金额大于0元时,基金管理人可进行收益分配;若《基金合同》生效不满3个月可不进行收益分配；（2）当基金收益分配根据基金相对业绩比较基准的超额收益率决定时，基于本基金的特点，本基金收益分配无需以弥补亏损为前提，收益分配后基金份额净值有可能低于面值；当基金收益分配根据基金可供分配利润金额决定时，本基金收益分配后基金份额净值不能低于面值，即基金收益分配基准日的基金份额净值减去每单位基金份额收益分配金额后不能低于面值；

在对基金份额持有人利益无实质不利影响的前提下，基金管理人可在和基金托管人协商一致后调整基金收益的分配原则；

法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。证券交易所或基金登记结算机构对收益分配另有规定的，从其规定。

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

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》、深圳证券交易所于2008年9月18日发布的《深圳证券交易所关于做好证券交易印花税征收方式调整工作的通知》、财税[2008]1号文《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号文《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号文《关于明确金融、房地产开发、教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号文《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》、财税[2023]39号《关于减半征收证券交易印花税的公告》、财政部 税务总局公告2024年第8号《关于延续实施全国中小

企业股份转让系统挂牌公司股息红利差别化个人所得税政策的公告》、财税[2025] 4号《关于国债等债券利息收入增值税政策的公告》、《中华人民共和国增值税法实施条例》、财税[2026]10号《关于增值税法施行后增值税优惠政策衔接事项的公告》及其他相关税务法规和实务操作，本基金适用的主要税项列示如下：

- a) 本基金管理人运营本基金过程中发生的增值税应税行为，可以选择适用简易计税方法，按照3%的规定征收率计算缴纳增值税。
- 本基金管理人运用基金买卖股票、债券取得的收入, 自2026年1月1日至2027年12月31日，免征增值税；对金融同业往来取得的利息收入免征增值税；同业存款利息收入免征增值税以及一般存款利息收入不征收增值税。自2025年8月8日起, 对在该日期之后（含当日）新发行的国债、地方政府债券、金融债券的利息收入，恢复征收增值税，对该日期之前已发行的国债、地方政府债券、金融债券（含在2025年8月8日之后续发行的部分）的利息收入，继续免征增值税直至债券到期。本基金管理人运营本基金提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。
- b) 对本基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。
- 对投资者从本基金分配中取得的收入，暂不征收企业所得税。
- c) 对本基金从上市公司、全国中小企业股份转让系统公开转让股票的非上市公众公司（“挂牌公司”）取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对本基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。
- 对本基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向本基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。
- d) 本基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。自2023年8月28日起，证券交易印花税实施减半征收。
- e) 对本基金运营过程中缴纳的增值税，分别按照本基金管理人所在地适用的税率，计算缴纳城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2026年06月30日
活期存款	461,902,042.89
等于：本金	461,850,490.20
加：应计利息	51,552.69
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	461,902,042.89

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2026年06月30日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		5,631,357,787.53	-	6,174,884,453.63	543,526,666.10
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	1,800,481.00	22,365.86	1,822,725.86	-121.00
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	1,800,481.00	22,365.86	1,822,725.86	-121.00
资产支持证券		-	-	-	-

基金	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	5,633,158,268.53	22,365.86	6,176,707,179.49	543,526,545.10

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 2026年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	1,505.62
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	1,170,748.34
其中：交易所市场	1,170,748.34
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	79,343.16
合计	1,251,597.12

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 天弘中证电网设备主题指数发起A

金额单位：人民币元

项目 (天弘中证电网设备主题指数发起A)	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	45,411,925.23	45,411,925.23
本期申购	2,224,003,415.01	2,224,003,415.01
本期赎回（以“-”号填列）	-1,229,803,138.41	-1,229,803,138.41
本期末	1,039,612,201.83	1,039,612,201.83

6.4.7.7.2 天弘中证电网设备主题指数发起C

金额单位：人民币元

项目 (天弘中证电网设备主题指数发起C)	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	322,958,919.99	322,958,919.99
本期申购	15,304,559,491.14	15,304,559,491.14
本期赎回（以“-”号填列）	-12,174,720,505.87	-12,174,720,505.87
本期末	3,452,797,905.26	3,452,797,905.26

注：申购含转换转入份额；赎回含转换转出份额。

6.4.7.8 未分配利润

6.4.7.8.1 天弘中证电网设备主题指数发起A

单位：人民币元

项目 (天弘中证电网设备主题指数发起A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	157,178.88	3,033,341.21	3,190,520.09
本期期初	157,178.88	3,033,341.21	3,190,520.09
本期利润	59,985,171.58	73,255,950.53	133,241,122.11
本期基金份额交易产生的变动数	12,073,096.10	316,454,304.64	328,527,400.74
其中：基金申购款	46,081,360.24	772,047,936.99	818,129,297.23

基金赎回款	-34,008,264.14	-455,593,632.35	-489,601,896.49
本期已分配利润	-	-	-
本期末	72,215,446.56	392,743,596.38	464,959,042.94

6.4.7.8.2 天弘中证电网设备主题指数发起C

单位：人民币元

项目 (天弘中证电网设备主题指数发起C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	1,059,145.29	21,571,193.54	22,630,338.83
本期期初	1,059,145.29	21,571,193.54	22,630,338.83
本期利润	236,089,868.50	463,817,086.97	699,906,955.47
本期基金份额交易产生的变动数	-2,612,859.55	818,598,318.86	815,985,459.31
其中：基金申购款	252,069,298.42	4,908,067,406.97	5,160,136,705.39
基金赎回款	-254,682,157.97	-4,089,469,088.11	-4,344,151,246.08
本期已分配利润	-	-	-
本期末	234,536,154.24	1,303,986,599.37	1,538,522,753.61

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
活期存款利息收入	783,070.53
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	20,490.98
其他	2,449.15
合计	806,010.66

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2026年01月01日至2026年06月30日
卖出股票成交总额	4,821,953,228.99
减：卖出股票成本总额	4,555,832,492.77
减：交易费用	6,392,734.90
买卖股票差价收入	259,728,001.32

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2026年01月01日至2026年06月30日
债券投资收益——利息收入	11,871.61
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	11,871.61

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 2026年01月01日至2026年06月30日
股票投资产生的股利收益	31,763,335.08
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	31,763,335.08

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
1.交易性金融资产	537,073,037.50
——股票投资	537,073,037.50
——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	537,073,037.50

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
基金赎回费收入	13,995,745.73
基金转换费收入	158,912.79

合计	14,154,658.52
----	---------------

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内未发生信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
审计费用	19,835.79
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
汇划手续费	10,284.28
合计	89,627.44

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方、关联关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
天弘基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
中国建设银行股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
天弘创新资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司

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

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 债券交易

本基金本报告期末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

本基金本报告期末通过关联方交易单元进行债券回购交易。

6.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

本基金本报告期无应支付关联方的佣金。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	4,211,716.25
其中：应支付销售机构的客户维护费	2,073,733.92
应支付基金管理人的净管理费	2,137,982.33

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0.15%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：日管理人报酬＝前一日基金资产净值×该日适用费率/当年天数。

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2026年01月01日至2026年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,403,905.38

注:支付基金托管人中国建设银行股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值0.05%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费＝前一日基金资产净值×该日适用费率/当年天数。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售 服务费的 各关联方 名称	本期		
	2026年01月01日至2026年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	天弘中证电网设备主题指数 发起A	天弘中证电网设备主题指数 发起C	合计
天弘基金 管理有限 公司	-	12,080.62	12,080.62
中国建设 银行股份 有限公司	-	109,809.55	109,809.55
合计	-	121,890.17	121,890.17

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。天弘中证电网设备主题指数发起C的销售服务费率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、天弘中证电网设备主题指数发起A不收取销售服务费。

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

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行过银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期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

份额单位：份

项目	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	
	天弘中证电网设备主题 指数发起A	天弘中证电网设备主题 指数发起C
报告期初持有的基金份额	5,000,777.93	5,000,777.78
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	5,000,777.93	5,000,777.78
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	0.48%	0.14%

注：1、基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

2、报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例，比例的分母分别采用各自级别的份额总额计算。

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

天弘中证电网设备主题指数发起A

份额单位：份

关联方名称	本期末 2026年06月30日		上年度末 2025年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
天弘创新资产管理有限公司	14,999,583.33	1.44%	14,999,583.33	33.03%

注：1、除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

2、报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例，比例的分母分别采用各自级别的份额总额计算。

天弘中证电网设备主题指数发起C

本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2026年01月01日至2026年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
中国建设银行股份有限公司	461,902,042.89	783,070.53

注：本基金由基金托管人中国建设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

本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销证券交易。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型货币市场基金之外的基金

本基金本报告期无利润分配事项。

6.4.12 期末（2026年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
001248	华润新能源	2026-06-24	6个月	新股流通受限	10.11	10.11	58,873	595,206.03	595,206.03	-
301666	大普微	2026-04-08	6个月	新股流通受限	46.08	463.33	1,220	56,217.60	565,262.60	-
688820	盛合晶微	2026-04-13	6个月	新股流通受限	19.68	141.49	2,391	47,054.88	338,302.59	-
688781	视涯科技	2026-03-18	9个月	新股流通受限	22.68	42.16	6,335	143,677.80	267,083.60	-
688808	联讯仪器	2026-04-16	6个月	新股流通受限	81.88	1,584.33	163	13,346.44	258,245.79	-
001248	华润新能源	2026-06-24	1个月内（含）	新股未上市	10.11	10.11	25,231	255,085.41	255,085.41	-
001399	C惠科	2026-06-16	6个月	新股流通受限	10.12	27.73	6,488	65,658.56	179,912.24	-
301682	宏明电子	2026-03-18	6个月	新股流通受限	69.66	160.06	714	49,737.24	114,282.84	-

688797	C臻宝	2026-06-16	6个月	新股流通受限	44.56	468.67	207	9,223.92	97,014.69	-
688818	电科蓝天	2026-02-03	6个月	新股流通受限	9.47	70.14	1,319	12,490.93	92,514.66	-
688712	北芯生命	2026-01-28	6个月	新股流通受限	17.52	35.92	1,500	26,280.00	53,880.00	-
688785	恒运昌	2026-01-20	6个月	新股流通受限	92.18	463.15	116	10,692.88	53,725.40	-
688813	泰金新能	2026-03-24	6个月	新股流通受限	26.28	172.09	234	6,149.52	40,269.06	-
688635	长进光子	2026-05-20	6个月	新股流通受限	40.98	308.19	128	5,245.44	39,448.32	-
001257	盛龙股份	2026-03-24	6个月	新股流通受限	7.82	20.74	1,743	13,630.26	36,149.82	-
603459	红板科技	2026-03-31	6个月	新股流通受限	17.70	84.32	330	5,841.00	27,825.60	-
001365	天海电子	2026-05-11	6个月	新股流通受限	27.19	31.31	719	19,549.61	22,511.89	-
688811	有研复材	2026-04-01	6个月	新股流通受限	6.41	24.13	834	5,345.94	20,124.42	-
301696	三瑞智能	2026-03-31	6个月	新股流通受限	24.68	86.80	216	5,330.88	18,748.80	-

001237	惠康科技	2026-05-15	6个月	新股流通受限	53.26	58.74	285	15,179.10	16,740.90	-
301669	高特电子	2026-06-02	6个月	新股流通受限	7.08	28.40	546	3,865.68	15,506.40	-
001393	维通利	2026-05-08	6个月	新股流通受限	30.38	38.99	387	11,757.06	15,089.13	-
301531	春光集团	2026-04-28	6个月	新股流通受限	13.30	51.56	290	3,857.00	14,952.40	-
301599	理奇智能	2026-04-22	6个月	新股流通受限	13.91	32.47	433	6,023.03	14,059.51	-
301680	固德电材	2026-02-27	6个月	新股流通受限	58.00	112.16	117	6,786.00	13,122.72	-
301683	慧谷新材	2026-03-24	6个月	新股流通受限	78.38	121.77	96	7,524.48	11,689.92	-
688816	易思维	2026-02-04	6个月	新股流通受限	55.95	57.10	177	9,903.15	10,106.70	-
603407	长裕集团	2026-04-29	6个月	新股流通受限	13.86	73.46	137	1,898.82	10,064.02	-
601112	振石股份	2026-01-21	6个月	新股流通受限	11.18	17.59	423	4,729.14	7,440.57	-
301513	尚水智能	2026-04-10	6个月	新股流通受限	26.66	50.96	138	3,679.08	7,032.48	-

603435	嘉德利	2026-05-15	6个月	新股流通受限	15.76	46.71	104	1,639.04	4,857.84	-
603293	埃泰克	2026-04-09	6个月	新股流通受限	33.49	33.93	72	2,411.28	2,442.96	-
001312	福恩股份	2026-04-14	6个月	新股流通受限	18.38	16.78	134	2,462.92	2,248.52	-
603284	林平发展	2026-02-03	6个月	新股流通受限	37.88	34.87	46	1,742.48	1,604.02	-
001220	世盟股份	2026-01-27	6个月	新股流通受限	28.00	27.78	57	1,596.00	1,583.46	-
603352	至信股份	2026-01-08	6个月	新股流通受限	21.88	25.52	33	722.04	842.16	-

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型指数基金，采用指数复制投资策略，按照个股在标的指数中的基准权重构建股票组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应地调整，以复制和跟踪标的指数。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。

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中国建设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

单位：人民币元

短期信用评级	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
A-1	-	-
A-1以下	-	-
未评级	1,822,725.86	1,810,854.25
合计	1,822,725.86	1,810,854.25

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

本基金本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级的债券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级的同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

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

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

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

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

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

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

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变

现价值。本期末，本基金组合资产中7个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

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

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2026年06月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	461,902,042.89	-	-	-	461,902,042.89
结算备付金	7,154,126.01	-	-	-	7,154,126.01
存出保证金	2,443,237.24	-	-	-	2,443,237.24
交易性金融资产	1,822,725.86	-	-	6,174,884,453.63	6,176,707,179.49
应收申购款	-	-	-	128,485,802.08	128,485,802.08

资产总计	473,322,132.00	-	-	6,303,370,255.71	6,776,692,387.71
负债					
应付清算款	-	-	-	13,133,428.21	13,133,428.21
应付赎回款	-	-	-	264,281,680.69	264,281,680.69
应付管理人报酬	-	-	-	899,647.73	899,647.73
应付托管费	-	-	-	299,882.55	299,882.55
应付销售服务费	-	-	-	934,247.77	934,247.77
其他负债	-	-	-	1,251,597.12	1,251,597.12
负债总计	-	-	-	280,800,484.07	280,800,484.07
利率敏感度缺口	473,322,132.00	-	-	6,022,569,771.64	6,495,891,903.64
上年度末 2025年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	48,836,981.83	-	-	-	48,836,981.83
结算备付金	521,612.81	-	-	-	521,612.81
存出保证金	10,025.76	-	-	-	10,025.76
交易性金融资产	1,810,854.25	-	-	374,049,270.92	375,860,125.17
应收清算款	-	-	-	7,133,173.52	7,133,173.52
应收申购款	-	-	-	25,212,179.91	25,212,179.91
资产总计	51,179,474.65	-	-	406,394,624.35	457,574,099.00
负债					
应付赎回款	-	-	-	63,235,152.31	63,235,152.31
应付管理人报酬	-	-	-	26,150.08	26,150.08
应付托管费	-	-	-	8,716.70	8,716.70
应付销售服务费	-	-	-	29,387.52	29,387.52
其他负债	-	-	-	82,988.25	82,988.25
负债总计	-	-	-	63,382,394.86	63,382,394.86
利率敏感度缺口	51,179,474.65	-	-	343,012,229.49	394,191,704.14

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2026年06月30日，本基金持有的交易性债券投资占基金净资产的比例为0.03%(2025年12月31日：0.46%)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响(2025年12月31日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金原则上采用完全复制法，跟踪中证电网设备主题指数，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金投资组合，并根据标的指数组成及其权重的变动而进行相应调整。但因特殊情况（如流动性不足等）导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2026年06月30日		上年度末 2025年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	6,174,884,453.63	95.06	374,049,270.92	94.89
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	6,174,884,453.63	95.06	374,049,270.92	94.89

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 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
	业绩比较基准上升5%	331,405,645.19	19,911,762.54
	业绩比较基准下降5%	-331,405,645.19	-19,911,762.54

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 金融工具公允价值计量的方法

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

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

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2026年06月30日	上年度末 2025年12月31日
第一层次	6,171,659,476.16	374,049,270.92
第二层次	2,673,017.30	1,810,854.25
第三层次	2,374,686.03	-
合计	6,176,707,179.49	375,860,125.17

6.4.14.2.2 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

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

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	6,174,884,453.63	91.12
	其中：股票	6,174,884,453.63	91.12
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,822,725.86	0.03
	其中：债券	1,822,725.86	0.03
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-

6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	469,056,168.90	6.92
8	其他各项资产	130,929,039.32	1.93
9	合计	6,776,692,387.71	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	5,531,367,415.90	85.15
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	10,169,750.00	0.16
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	536,260,392.50	8.26
J	金融业	33,907,536.00	0.52
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	59,954,381.76	0.92
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-

R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	6,171,659,476.16	95.01

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	36,149.82	0.00
C	制造业	2,336,952.75	0.04
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	850,291.44	0.01
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	1,583.46	0.00
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	3,224,977.47	0.05

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	600487	亨通光电	8,638,618	944,546,492.12	14.54
2	600522	中天科技	12,005,016	728,464,370.88	11.21
3	600089	特变电工	21,966,200	494,239,500.00	7.61
4	002028	思源电气	2,725,818	471,566,514.00	7.26
5	600406	XD国电南	16,619,156	379,747,714.60	5.85
6	601208	东材科技	3,413,298	241,627,365.42	3.72
7	600869	远东股份	5,937,200	198,718,084.00	3.06
8	600885	宏发股份	5,229,546	180,367,041.54	2.78
9	601179	中国西电	10,823,244	161,482,800.48	2.49
10	601126	四方股份	2,451,980	154,965,136.00	2.39
11	300001	特锐德	3,120,900	118,063,647.00	1.82
12	601877	正泰电器	4,538,600	113,782,702.00	1.75
13	688676	金盘科技	1,164,865	98,594,173.60	1.52
14	600577	精达股份	9,085,500	88,856,190.00	1.37
15	603606	东方电缆	2,090,680	86,784,126.80	1.34
16	002617	露笑科技	8,062,400	82,962,096.00	1.28
17	603618	杭电股份	1,459,443	72,797,016.84	1.12
18	000400	许继电气	3,011,700	65,353,890.00	1.01
19	600312	平高电气	3,438,200	60,718,612.00	0.93
20	301031	中熔电气	432,392	51,649,224.40	0.80
21	002270	华明装备	2,647,200	49,899,720.00	0.77
22	688248	南网科技	715,782	49,517,798.76	0.76
23	002706	良信股份	4,470,200	48,769,882.00	0.75
24	600550	保变电气	3,886,622	45,590,076.06	0.70
25	601567	三星电气	2,967,900	44,340,426.00	0.68

26	000682	东方电子	3,397,600	42,911,688.00	0.66
27	002922	伊戈尔	1,249,236	40,974,940.80	0.63
28	605196	华通线缆	1,511,473	39,449,445.30	0.61
29	002169	智光电气	2,643,800	38,705,232.00	0.60
30	002498	汉缆股份	5,617,600	38,312,032.00	0.59
31	001359	平安电工	305,319	38,241,204.75	0.59
32	600131	国网信通	2,531,300	36,956,980.00	0.57
33	300222	科大智能	2,628,527	36,405,098.95	0.56
34	002276	万马股份	3,418,405	34,560,074.55	0.53
35	600517	国网英大	7,245,200	33,907,536.00	0.52
36	002063	远光软件	6,473,476	33,014,727.60	0.51
37	601222	林洋能源	6,037,100	32,117,372.00	0.49
38	688191	智洋创新	831,019	29,667,378.30	0.46
39	300444	双杰电气	2,377,100	29,024,391.00	0.45
40	300265	通光线缆	1,381,324	28,565,780.32	0.44
41	301291	明阳电气	791,128	28,472,696.72	0.44
42	603530	神马电力	547,000	27,842,300.00	0.43
43	002452	长高电气	2,094,700	26,749,319.00	0.41
44	002121	科陆电子	4,906,900	26,742,605.00	0.41
45	600268	XD国电南	2,109,500	24,512,390.00	0.38
46	002298	中电鑫龙	3,128,400	23,838,408.00	0.37
47	688611	杭州柯林	324,281	23,169,877.45	0.36
48	002533	金杯电工	2,168,800	23,141,096.00	0.36
49	300617	安靠智电	419,600	22,234,604.00	0.34
50	300018	中元股份	1,648,900	20,363,915.00	0.31
51	001208	华菱线缆	1,347,300	19,118,187.00	0.29
52	002560	通达股份	2,481,260	18,460,574.40	0.28
53	603556	海兴电力	822,400	18,092,800.00	0.28
54	300360	炬华科技	1,519,400	17,852,950.00	0.27
55	002606	大连电瓷	1,296,200	17,382,042.00	0.27
56	603666	亿嘉和	608,272	16,800,472.64	0.26

57	603050	科林电气	852,300	16,670,988.00	0.26
58	603861	白云电器	1,140,200	14,719,982.00	0.23
59	601096	宏盛华源	3,386,000	14,695,240.00	0.23
60	300341	麦克奥迪	1,092,300	14,472,975.00	0.22
61	300427	红相股份	2,148,100	14,413,751.00	0.22
62	301179	泽宇智能	682,400	13,961,904.00	0.21
63	002090	金智科技	1,355,500	11,982,620.00	0.18
64	002339	积成电子	1,701,595	11,792,053.35	0.18
65	300853	申昊科技	372,500	11,506,525.00	0.18
66	300215	电科院	1,583,700	10,436,583.00	0.16
67	300062	中能电气	1,858,426	10,425,769.86	0.16
68	002882	金龙羽	548,244	10,356,329.16	0.16
69	300712	永福股份	475,000	10,169,750.00	0.16
70	688330	宏力达	295,797	10,006,812.51	0.15
71	300069	金利华电	297,300	9,463,059.00	0.15
72	300880	迦南智能	410,700	8,727,375.00	0.13
73	300510	金冠股份	2,787,700	8,697,624.00	0.13
74	605066	天正电气	1,273,300	8,645,707.00	0.13
75	300882	万胜智能	484,400	8,031,352.00	0.12
76	002879	长缆科技	568,900	7,469,657.00	0.11
77	002857	三晖电气	385,200	6,767,964.00	0.10
78	603829	洛凯股份	393,400	6,439,958.00	0.10
79	001382	新亚电缆	347,500	5,434,900.00	0.08
80	603577	汇金通	570,900	5,377,878.00	0.08

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	001248	华润新能源	84,104	850,291.44	0.01

2	301666	大普微	1,220	565,262.60	0.01
3	688820	盛合晶微	2,391	338,302.59	0.01
4	688781	视涯科技	6,335	267,083.60	0.00
5	688808	联讯仪器	163	258,245.79	0.00
6	001399	C惠科	6,488	179,912.24	0.00
7	301682	宏明电子	714	114,282.84	0.00
8	688797	C臻宝	207	97,014.69	0.00
9	688818	电科蓝天	1,319	92,514.66	0.00
10	688712	北芯生命	1,500	53,880.00	0.00
11	688785	恒运昌	116	53,725.40	0.00
12	688813	泰金新能	234	40,269.06	0.00
13	688635	长进光子	128	39,448.32	0.00
14	001257	盛龙股份	1,743	36,149.82	0.00
15	603459	红板科技	330	27,825.60	0.00
16	001365	天海电子	719	22,511.89	0.00
17	688811	有研复材	834	20,124.42	0.00
18	301696	三瑞智能	216	18,748.80	0.00
19	001237	惠康科技	285	16,740.90	0.00
20	301669	高特电子	546	15,506.40	0.00
21	001393	维通利	387	15,089.13	0.00
22	301531	春光集团	290	14,952.40	0.00
23	301599	理奇智能	433	14,059.51	0.00
24	301680	固德电材	117	13,122.72	0.00
25	301683	慧谷新材	96	11,689.92	0.00
26	688816	易思维	177	10,106.70	0.00
27	603407	长裕集团	137	10,064.02	0.00
28	601112	振石股份	423	7,440.57	0.00
29	301513	尚水智能	138	7,032.48	0.00
30	603435	嘉德利	104	4,857.84	0.00
31	603293	埃泰克	72	2,442.96	0.00
32	001312	福恩股份	134	2,248.52	0.00

33	603284	林平发展	46	1,604.02	0.00
34	001220	世盟股份	57	1,583.46	0.00
35	603352	至信股份	33	842.16	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	600089	特变电工	1,092,759,067.42	277.22
2	002028	思源电气	952,019,588.83	241.51
3	600406	XD国电南	787,313,778.33	199.73
4	600487	亨通光电	653,693,595.96	165.83
5	600522	中天科技	570,511,549.77	144.73
6	601179	中国西电	300,005,913.16	76.11
7	601877	正泰电器	286,521,623.41	72.69
8	600885	宏发股份	262,215,605.02	66.52
9	601126	四方股份	226,184,056.94	57.38
10	600577	精达股份	201,999,227.32	51.24
11	688676	金盘科技	196,506,051.91	49.85
12	601208	东材科技	192,701,168.75	48.89
13	603606	东方电缆	180,926,552.25	45.90
14	300001	特锐德	163,131,837.76	41.38
15	000400	许继电气	158,584,634.09	40.23
16	002270	华明装备	147,211,032.38	37.35
17	600869	远东股份	143,857,039.21	36.49
18	600312	平高电气	132,640,324.25	33.65
19	601567	三星电气	132,474,805.83	33.61
20	605196	华通线缆	115,391,766.65	29.27
21	600550	保变电气	107,100,214.47	27.17

22	002617	露笑科技	100,387,919.00	25.47
23	002276	万马股份	96,910,540.69	24.58
24	002922	伊戈尔	91,054,639.82	23.10
25	002706	良信股份	90,013,590.52	22.83
26	600517	国网英大	85,137,941.99	21.60
27	600131	国网信通	83,488,542.89	21.18
28	000682	东方电子	80,929,832.97	20.53
29	002121	科陆电子	76,966,130.55	19.53
30	002063	远光软件	73,887,153.75	18.74
31	301291	明阳电气	73,445,349.91	18.63
32	688248	南网科技	71,035,134.02	18.02
33	002498	汉缆股份	70,441,846.36	17.87
34	688226	威腾电气	67,879,584.97	17.22
35	301031	中熔电气	67,302,834.19	17.07
36	300444	双杰电气	62,304,927.75	15.81
37	002169	智光电气	61,716,433.57	15.66
38	002298	中电鑫龙	60,272,324.91	15.29
39	300222	科大智能	56,039,250.56	14.22
40	002533	金杯电工	53,829,097.69	13.66
41	601222	林洋能源	53,807,855.63	13.65
42	300427	红相股份	53,587,178.30	13.59
43	603556	海兴电力	53,479,859.88	13.57
44	600268	XD国电南	51,724,616.12	13.12
45	300360	炬华科技	46,096,065.24	11.69
46	603530	神马电力	45,794,487.00	11.62
47	600973	宝胜股份	44,540,893.00	11.30
48	601096	宏盛华源	44,288,965.16	11.24
49	603618	杭电股份	43,102,449.38	10.93
50	300265	通光线缆	40,861,193.56	10.37
51	688191	智洋创新	40,078,438.67	10.17
52	300617	安靠智电	39,280,767.25	9.96

53	002452	长高电气	38,868,246.00	9.86
54	300018	中元股份	37,285,521.68	9.46
55	688611	杭州柯林	35,938,669.82	9.12
56	002560	通达股份	35,304,990.48	8.96
57	603861	白云电器	33,586,705.00	8.52
58	002339	积成电子	32,759,410.55	8.31
59	001359	平安电工	32,409,187.01	8.22
60	300341	麦克奥迪	31,959,861.00	8.11
61	001208	华菱线缆	31,409,319.00	7.97
62	600468	百利电气	30,874,799.00	7.83
63	002882	金龙羽	29,549,714.24	7.50
64	603666	亿嘉和	29,469,503.19	7.48
65	300062	中能电气	28,830,550.18	7.31
66	002090	金智科技	28,663,266.00	7.27
67	002606	大连电瓷	27,607,606.36	7.00
68	300215	电科院	25,107,549.00	6.37
69	603050	科林电气	24,926,469.24	6.32
70	300712	永福股份	23,974,025.00	6.08
71	301179	泽宇智能	23,877,842.26	6.06
72	300831	ST派瑞	22,149,723.00	5.62
73	002879	长缆科技	21,191,717.00	5.38
74	300510	金冠股份	20,180,912.00	5.12
75	300882	万胜智能	19,227,969.80	4.88
76	605066	天正电气	18,449,265.00	4.68
77	300853	申昊科技	17,643,980.00	4.48
78	301609	山大电力	17,407,119.97	4.42
79	688330	宏力达	16,214,913.63	4.11
80	300880	迦南智能	15,415,481.80	3.91
81	002857	三晖电气	15,178,728.00	3.85
82	001382	新亚电缆	12,901,129.07	3.27
83	301590	优优绿能	11,893,380.18	3.02

84	603577	汇金通	11,115,221.00	2.82
85	603829	洛凯股份	11,097,395.00	2.82
86	300069	金利华电	10,453,016.04	2.65
87	001388	信通电子	9,615,040.28	2.44

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600487	亨通光电	507,456,326.01	128.73
2	600089	特变电工	447,039,915.69	113.41
3	002028	思源电气	418,037,349.44	106.05
4	600522	中天科技	384,698,269.77	97.59
5	600406	XD国电南	353,101,890.14	89.58
6	601126	四方股份	148,069,290.05	37.56
7	601877	正泰电器	138,671,356.74	35.18
8	601179	中国西电	138,242,871.74	35.07
9	601208	东材科技	133,301,372.66	33.82
10	600885	宏发股份	107,319,173.46	27.23
11	688676	金盘科技	85,084,207.88	21.58
12	300001	特锐德	82,478,835.40	20.92
13	603606	东方电缆	78,686,461.60	19.96
14	600869	远东股份	77,445,224.26	19.65
15	600577	精达股份	73,106,761.40	18.55
16	688226	威腾电气	67,619,345.61	17.15
17	000400	许继电气	65,117,645.61	16.52
18	002270	华明装备	59,431,055.50	15.08
19	600312	平高电气	57,036,236.00	14.47

20	605196	华通线缆	49,302,894.00	12.51
21	601567	三星电气	48,306,434.75	12.25
22	600550	保变电气	45,009,977.78	11.42
23	600973	宝胜股份	40,840,274.78	10.36
24	002922	伊戈尔	39,309,754.40	9.97
25	002706	良信股份	38,771,394.00	9.84
26	002276	万马股份	37,180,184.54	9.43
27	603618	杭电股份	36,425,078.10	9.24
28	600131	国网信通	36,228,274.00	9.19
29	000682	东方电子	35,766,928.79	9.07
30	600517	国网英大	34,577,037.65	8.77
31	002498	汉缆股份	33,906,910.28	8.60
32	688248	南网科技	32,597,401.91	8.27
33	002063	远光软件	31,915,743.70	8.10
34	301291	明阳电气	31,865,100.00	8.08
35	301031	中熔电气	31,364,251.36	7.96
36	002617	露笑科技	30,749,807.87	7.80
37	002169	智光电气	30,196,351.73	7.66
38	002121	科陆电子	29,709,758.36	7.54
39	300222	科大智能	27,007,974.24	6.85
40	300444	双杰电气	26,797,642.10	6.80
41	600468	百利电气	25,986,103.53	6.59
42	002298	中电鑫龙	24,934,752.00	6.33
43	300831	ST派瑞	24,907,480.95	6.32
44	601096	宏盛华源	24,543,536.00	6.23
45	600268	XD国电南	23,432,093.22	5.94
46	002533	金杯电工	22,730,694.87	5.77
47	300265	通光线缆	22,017,708.00	5.59
48	603556	海兴电力	20,287,135.00	5.15
49	300617	安靠智电	20,001,569.00	5.07
50	002452	长高电气	18,789,690.00	4.77

51	300360	炬华科技	18,332,224.71	4.65
52	300427	红相股份	18,202,592.84	4.62
53	001359	平安电工	18,162,500.50	4.61
54	603530	神马电力	17,163,307.00	4.35
55	002560	通达股份	16,907,971.80	4.29
56	300018	中元股份	16,736,271.19	4.25
57	688191	智洋创新	16,536,712.65	4.20
58	601222	林洋能源	15,681,137.00	3.98
59	301609	山大电力	15,080,837.73	3.83
60	603861	白云电器	15,009,519.40	3.81
61	002606	大连电瓷	13,715,983.05	3.48
62	300341	麦克奥迪	13,714,097.00	3.48
63	002339	积成电子	13,518,997.52	3.43
64	300853	申昊科技	12,004,223.00	3.05
65	301179	泽宇智能	11,912,976.42	3.02
66	002090	金智科技	11,684,199.80	2.96
67	603666	亿嘉和	11,653,572.00	2.96
68	002882	金龙羽	11,369,510.00	2.88
69	300062	中能电气	10,923,988.81	2.77
70	301590	优优绿能	10,655,211.00	2.70
71	688611	杭州柯林	10,565,708.64	2.68
72	300215	电科院	10,288,169.00	2.61
73	300712	永福股份	10,104,992.50	2.56
74	001208	华菱线缆	9,108,125.00	2.31
75	002879	长缆科技	8,301,856.00	2.11
76	605066	天正电气	8,097,037.75	2.05

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	9,819,594,637.98
卖出股票收入（成交）总额	4,821,953,228.99

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	1,822,725.86	0.03
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	1,822,725.86	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	019785	25国债13	18,000	1,822,725.86	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，均为基金合同约定备选股票库之内的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,443,237.24
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	128,485,802.08
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	130,929,039.32

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值	占基金资产 净值比例(%)	流通受限情况说 明
1	001248	华润新能源	850,291.44	0.01	新股未上市
2	301666	大普微	565,262.60	0.01	新股流通受限
3	688820	盛合晶微	338,302.59	0.01	新股流通受限
4	688781	视涯科技	267,083.60	0.00	新股流通受限
5	688808	联讯仪器	258,245.79	0.00	新股流通受限

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持 有 人 户 数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总 份额 比例	持有份额	占总份 额比例
天弘 中证 电网 设备 主题 指数 发起A	12 1,7 22	8,540.87	23,413,656.98	2.25%	1,016,198,544.85	97.75%
天弘 中证 电网 设备	69 6,3 24	4,958.61	19,201,211.75	0.56%	3,433,596,693.51	99.44%

主题 指数 发起C						
合计	80 7,0 61	5,566.38	42,614,868.73	0.95%	4,449,795,238.36	99.05%

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	天弘中证电网设备主题指数发起A	216,381.17	0.02%
	天弘中证电网设备主题指数发起C	1,060,733.84	0.03%
	合计	1,277,115.01	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	天弘中证电网设备主题指数发起A	0
	天弘中证电网设备主题指数发起C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	天弘中证电网设备主题指数发起A	0
	天弘中证电网设备主题指数发起C	0
	合计	0

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,001,555.71	0.22%	10,001,555.71	0.22%	三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,001,555.71	0.22%	10,001,555.71	0.22%	-

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	天弘中证电网设备主题指数发起A	天弘中证电网设备主题指数发起C
基金合同生效日(2025年11月25日)基金份额总额	24,368,060.50	51,666,898.01
本报告期期初基金份额总额	45,411,925.23	322,958,919.99
本报告期基金总申购份额	2,224,003,415.01	15,304,559,491.14
减：本报告期基金总赎回份额	1,229,803,138.41	12,174,720,505.87
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,039,612,201.83	3,452,797,905.26

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期无涉及基金财产、基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内，本基金投资策略没有改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内，本基金所聘用的会计师事务所未发生变化。

10.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

10.6.1 管理人受调查或处罚等情况

管理人受调查或处罚等情况	内容
受到调查或处罚等措施的主体	天弘基金管理有限公司
受到调查或处罚等措施的时间	2026年06月26日
采取调查或处罚等措施的机构	国家外汇管理局天津市分局
受到调查或处罚等措施类型	行政处罚
受到的具体措施类型	警告、罚款
受到调查或处罚等措施的原因	其他问题（报告报送的部分内容缺失）
受到处罚的依据	《中华人民共和国外汇管理条例》
管理人采取整改措施的情况（如提出整改意见）	基金管理人已通过补充报送、优化流程等方式完成整改，整改成果已经国家外汇管理局天津市分局验收通过。
其他	-

10.6.2 管理人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.6.3 托管人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人无受调查或处罚等情况。

10.6.4 托管人相关从业人员受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金托管人相关从业人员无受调查或处罚等情况。

10.7 基金租用或者通过证券公司交易单元进行证券投资的相关情况

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	
华泰证券	2	6,139,255,110.64	41.94%	1,276,356.01	41.94%	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	3	8,498,671,624.14	58.06%	1,766,867.68	58.06%	-
浙商证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-

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：华泰证券上海交易单元1个，华泰证券深圳交易单元1个，西部证券深圳交易单元1个，兴业证券北交所交易单元1个，浙商证券上海交易单元1个，中泰证券深圳交易单元1个。

4、本基金报告期内停止租用交易单元：无。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	天弘基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2025年度）	中国证监会规定媒介	2026-03-31
2	天弘中证电网设备主题指数型发起式证券投资基金2026年第1季度报告	中国证监会规定媒介	2026-04-22
3	天弘基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会规定媒介	2026-04-27
4	2025年度天弘基金管理有限公司以股东身份（通过公募基金持股）参与股东大会投票信息披露	中国证监会规定媒介	2026-04-30
5	天弘中证电网设备主题指数型发起式证券投资基金基金合同	中国证监会规定媒介	2026-05-16
6	天弘中证电网设备主题指数型发起式证券投资基金托管协议	中国证监会规定媒介	2026-05-16
7	天弘中证电网设备主题指数型发起式证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会规定媒介	2026-05-16
8	天弘基金管理有限公司关于天弘中证电网设备主题指数型发起式证券投资基金调整收益分配原则并相应修改相关法律文件的公告	中国证监会规定媒介	2026-05-16
9	天弘基金管理有限公司关于终止中证金牛（北京）基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会规定媒介	2026-05-29
10	天弘基金管理有限公司关于	中国证监会规定媒介	2026-06-13

	防范不法分子冒用公司名义进行诈骗活动的风险提示		
11	天弘中证电网设备主题指数型发起式证券投资基金（A类份额）基金产品资料概要（更新）	中国证监会规定媒介	2026-06-26
12	天弘中证电网设备主题指数型发起式证券投资基金（C类份额）基金产品资料概要（更新）	中国证监会规定媒介	2026-06-26

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

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

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，基金管理人根据法律法规及《基金合同》等相关规定，经与基金托管人协商一致，决定调整收益分配原则，并相应修订相关法律文件，修订后的《基金合同》、《托管协议》等法律文件自2026年5月16日正式生效。具体信息请参见基金管理人在规定媒介披露的《天弘基金管理有限公司关于天弘中证电网设备主题指数型发起式证券投资基金调整收益分配原则并相应修改相关法律文件的公告》。

§12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会准予基金注册的文件
- 2、基金合同
- 3、托管协议
- 4、招募说明书
- 5、报告期内在指定报刊上披露的各项公告
- 6、基金管理人业务资格批件、营业执照
- 7、中国证监会规定的其他文件

12.2 存放地点

天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层

12.3 查阅方式

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

公司网站：www.thfund.com.cn

天弘基金管理有限公司
二〇二六年八月三十一日