天弘创业板 300 交易型开放式指数证券投资基金

2025 年年度报告

2025 年 12 月 31 日

基金管理人:天弘基金管理有限公司

基金托管人:国泰海通证券股份有限公司

送出日期:2026 年 03 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人国泰海通证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2026年03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。

本报告期自2025年01月01日起至2025年12月31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、基金净值表现及利润分配情况 7
3.1 主要会计数据和财务指标 7
3.2 基金净值表现 8
3.3 过去三年基金的利润分配情况 9
§4 管理人报告 10
4.1 基金管理人及基金经理情况 10
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 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 13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 14
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 15
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明 15
§5 托管人报告 15
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 15
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 15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 15
§6 审计报告 16
6.1 审计报告基本信息 16
6.2 审计报告的基本内容 16
§7 年度财务报表 19
7.1 资产负债表 19
7.2 利润表 21
7.3 净资产变动表 22
7.4 报表附注 24
§8 投资组合报告 57
8.1 期末基金资产组合情况 57
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 58
8.3 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 60
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 70
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 72
8.6 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 72
8.7 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 72
8.8 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 73
8.9 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 73
8.10 本基金投资股指期货的投资政策 73

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 73
8.12 投资组合报告附注 73
§9 基金份额持有人信息 74
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 74
9.2 期末上市基金前十名持有人 75
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 75
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 75
§10 开放式基金份额变动 75
§11 重大事件揭示 76
11.1 基金份额持有人大会决议 76
11.2 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 76
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 76
11.4 基金投资策略的改变 76
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 76
11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况 76
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 77
11.8 其他重大事件 80
§12 影响投资者决策的其他重要信息 83
12.1 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 83
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 84
§13 备查文件目录 84
13.1 备查文件目录 84
13.2 存放地点 84
13.3 查阅方式 84

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	天弘创业板300交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	天弘创业板300ETF
场内简称	创业板300ETF天弘
基金主代码	159836
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021年05月11日
基金管理人	天弘基金管理有限公司
基金托管人	国泰海通证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	121,747,113.00份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2021年05月25日

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

	股相关的衍生工具。主要产品投资策略包括：债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、参与融资及转融通证券出借业务策略、存托凭证投资策略等。
业绩比较基准	创业板300指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		天弘基金管理有限公司	国泰海通证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	童建林	帅芳
	联系电话	022-83310208	021-38677947
	电子邮箱	service@thfund.com.cn	tgrxp@tg.gtht.com
客户服务电话		400-986-8888	021-38917599-5
传真		022-83865564	021-50872603
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	中国（上海）自由贸易试验区商城路618号
办公地址		天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层	上海市静安区新闸路669号博华广场19楼
邮政编码		300203	200041
法定代表人		黄辰立	朱健

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金年度报告正	www.thfund.com.cn

文的管理人互联网网址	
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	毕马威华振会计师事务所 (特殊普通合伙)	北京市东长安街1号东方广场毕马威大楼8层
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2025年	2024年	2023年
本期已实现收益	27,818,486.87	-964,122.54	-5,159,357.41
本期利润	68,634,281.34	11,987,432.41	-9,510,438.15
加权平均基金份额本期利润	0.3661	0.0755	-0.1095
本期加权平均净值利润率	39.88%	10.40%	-13.78%
本期基金份额净值增长率	46.03%	14.28%	-12.43%
3.1.2 期末数据和指标	2025年末	2024年末	2023年末
期末可供分配利润	23,665,483.42	-44,024,131.25	-32,340,797.22
期末可供分配基金份额利润	0.1944	-0.1821	-0.2843
期末基金资产净值	145,412,596.42	197,722,981.75	81,406,315.78
期末基金份额净值	1.1944	0.8179	0.7157

3.1.3 累计期末指标	2025年末	2024年末	2023年末
基金份额累计净值增长率	19.44%	-18.21%	-28.43%

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

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

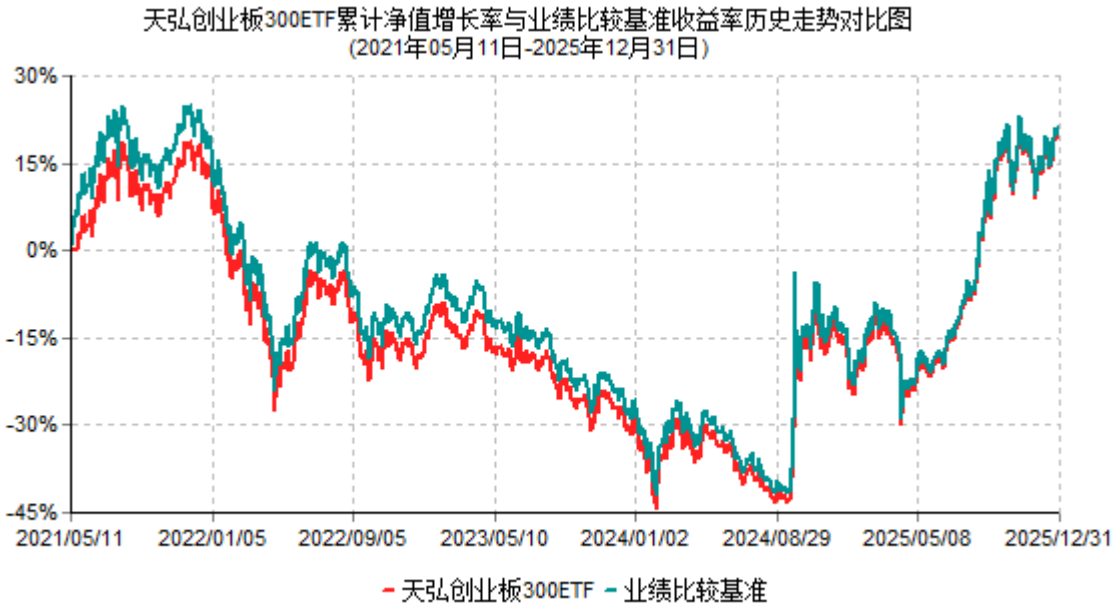
3、期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.65%	1.70%	-0.72%	1.70%	0.07%	0.00%
过去六个月	39.29%	1.70%	38.86%	1.70%	0.43%	0.00%
过去一年	46.03%	1.82%	43.56%	1.82%	2.47%	0.00%
过去三年	46.14%	1.90%	39.62%	1.90%	6.52%	0.00%
自基金合同生效日起至今	19.44%	1.79%	20.04%	1.80%	-0.60%	-0.01%

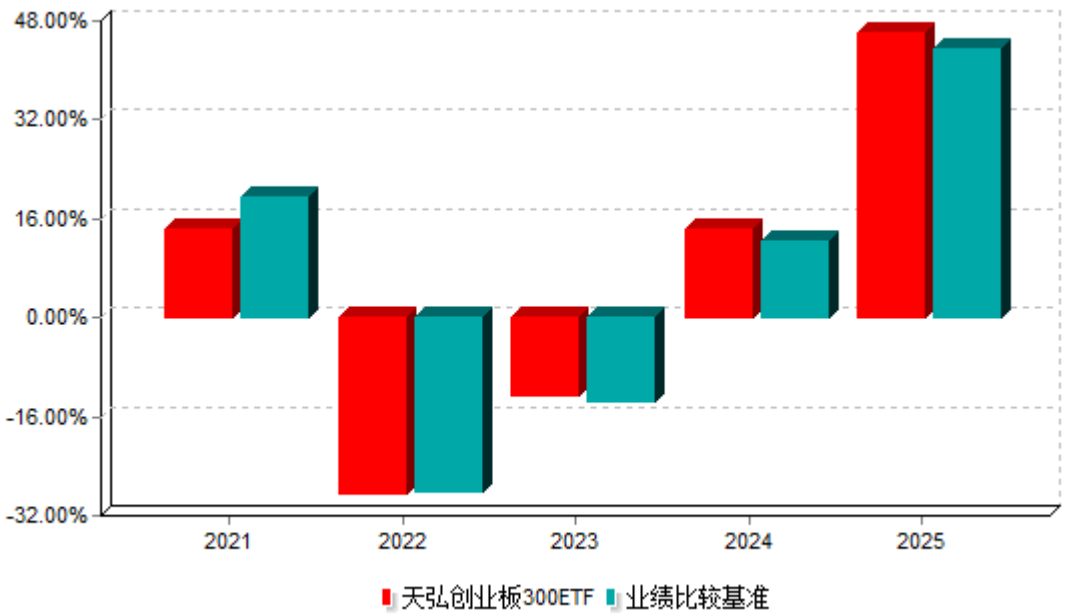
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、本基金合同于2021年05月11日生效。

2、本报告期内，本基金的各项投资比例达到基金合同约定的各项比例要求。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金合同于2021年05月11日生效。基金合同生效当年2021年的净值增长率按照基金合同生效后当年的实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

§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2025年12月31日，公司共管理运作242只公募基金，公司业务范围涵盖二级市场股票投资、债券投资、现金管理、衍生品投资等。公司始终秉承“稳健理财，值得信赖”的理念，坚持为投资者带来优质的基金产品和理财服务。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈瑶	本基金基金经理	2021年05月11日	-	14年	女，金融学硕士。2011年7月加盟本公司，历任交易员、交易主管，从事交易管理、程序化交易策略、基差

					交易策略、融资融券交易策略等研究工作。
尤聪	本基金基金经理助理	2024年08月02日	-	12年	女，计算金融与风险管理专业硕士。历任华盛顿大学资产管理公司量化研究员、北美信托银行信用风险管理顾问、北美信托资产管理公司股票量化投资经理。2021年10月加盟本公司 。

注：1、上述任职日期/离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2、本基金经理助理协助基金经理进行投资、研究、头寸管理等日常工作。

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

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

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

本报告期内，本基金运作合法合规，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

基金管理人一直坚持公平对待旗下所有基金的原则，严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，在研究分析、投资决策和交易执行等各个环节落实公平交易原则。公平交易范围包括各类投资组合、所有投资交易品种、以及一级市场申购、二级市场交易等所有投资交易管理活动及授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

针对公司旗下所有投资组合的交易所公开竞价交易，通过交易系统中的公平交易程序，对于不同投资组合同日同向买卖同一证券的指令自动进行比例分配。针对场外网下交易业务，依照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部场外、网下交易业务的相关规定，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。对于以公司名义进行的交易严格按照发行分配的原则或价格优先、比例分配的原则在各投资组合间进行分配。

4.3.2 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。

4.3.3 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

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

报告期内，本基金跟踪误差的来源主要是申购赎回、打新、成分股调整导致的权重偏离因素。当由于申赎等情况可能对指数跟踪效果带来影响时，本基金坚持既定的指数化投资策略，对指数基金采取被动复制与组合优化相结合的方式跟踪指数，同时紧密跟踪成分股的权息事件，及时有效处理，避免权重偏离造成跟踪误差的扩大。

报告期内，本基金整体运行平稳。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2025年12月31日，本基金份额净值为1.1944元，本报告期份额净值增长率46.03%，同期业绩比较基准增长率43.56%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望 2026 年宏观经济，出口仍将是核心增长引擎与关键宏观变量。尽管地缘政治冲突、关税壁垒等外部压力犹存，但依托中国制造业的结构性竞争优势，出口有望保持正增长态势。投资端，财政政策持续发力对冲房地产行业下行影响，地产板块对经济的拖累效应逐步减弱；叠加制造业投资的结构性回暖，在稳增长政策的托底护航下，整体投资有望逐步止跌回稳。消费领域，消费品以旧换新政策预计将延续实施，消费结构亦将进一步向服务型消费倾斜，推动消费市场实现平缓修复。价格维度，受益于低基数效应及“反内卷”相关政策落地，PPI 降幅有望收窄甚至转正；CPI 则预计维持低位温和增长格局。

展望 2026 年股票市场，我们依然看好2026年股票市场整体表现。本轮自 2024 年 9 月开启的行情已步入第三个年头，市场关注点将逐步向企业盈利基本面的兑现与支撑聚焦。从 2025 年三季报来看，A 股盈利正处于筑底阶段，营收端已企稳回升，利润端修复因价格因素有所制约。2026 年企业盈利修复进程虽有曲折，但整体向好趋势明确，ROE 有望在低位企稳，利润率边际改善的信号或更为清晰，需警惕上游成本快速上行带来的扰动。

资金面来看，居民存量存款到期后的再配置需求叠加市场风险偏好抬升，预计将持续为股票市场注入增量资金；但同时也需关注资金面波动对股市的扰动，以及市场波动率快速上行背后的交易风险。当前市场对基本面共振的诉求显著提升，投资布局仍需关注基本面逻辑的板块。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，基金管理人的监察稽核工作从保障基金份额持有人利益、合规运作、防范和控制风险出发，由独立的内控合规部门按照规定的权限和程序，认真履行职责，对公司、基金运作及员工行为的合法性、合规性进行监督和检查。发现问题及时提出建议并督促相关部门改进完善，及时与有关人员沟通，并定期制作监察稽核报告报公司董事会。公司经理层成立了风险管理委员会，指导、协调和监督各业务或职能部门开展风险管理工作；决定公司风险控制政策和程序，审批公司风险管理标准和重要业务风险管理口径；听取风险汇报，并就报告的重大风险管理事项进行决策；听取创新业务或产品风险评估报告；组织和协调重大风险事件的应对，直至风险得到妥善处理；审议公司重要的风险管理制度和流程。

同时，本基金管理人根据全面性原则、独立性原则、相互制约原则、定性和定量相结合原则、重要性原则建立了一套比较完整的内部控制体系，该内部控制体系由一系列业务管理制度及相应的业务处理、控制程序组成，具体包括控制环境、风险评估、控制活动、信息和沟通、监控等要素。

本报告期，本基金管理人全面开展基金运作监察稽核工作，确保基金投资、营销及后台运作等各环节的合法合规。通过定期检查、不定期抽查等工作方法，完善内部控制，基金运作没有出现违规行为。本报告期内，本基金管理人有关本基金的监察稽核主要工作如下：

1、投研交环节，加强研究业务独立性，注重程序合规和质量控制。在关注研究报告形式与内容的合法性基础上，做好投资备选库的入选、维护管理。持续规范新股/新债询价、申购流程，做好关联交易的识别与管控。对投资运作过程中的风险点进行识别和监控，预防和控制由内部或外部流程、人员和系统失控而造成的损失。根据法律法规要求、基金合同约定、投资决策委员会决定，适时提出增加或优化交易系统风控指标的建议，通过投资交易系统控制投资风险。跟踪每日的交易行为和交易结果，发现预警信息通过电话、邮件及时提醒，保障投资环节的合规性。监督检查各投资组合新股/新债申购、银行间交易等场外交易的合规执行情况，保证投资组合合规开展各项场内、场外交易；

2、投资管理人员管理环节，加强对投资管理人员即时聊天工具、办公电话、移动电话、终端设备网上交易的合规监控，监督投资管理人员及其配偶、利害关系人证券投资申报制度、交易时间移动电话集中保管制度的有效执行，采取各种有效方式杜绝利用未公开信息交易、非公平交易及各种形式的利益输送行为；

3、基金募集与营销环节，严格落实基金销售相关法规政策要求，提升对基金宣传推介材料的合规审核质效，确保基金营销活动合法合规。坚守投资者利益优先原则，深化投资者适当性管理，致力于提升产品风险评级的合理性和科学性，切实保障投资者合法权益；

4、基金运营环节，加强对注册登记、会计核算、基金清算、估值业务的稽核力度，保证基金运营安全、准确；

5、信息披露环节，严格按照信息披露管理办法的规定，认真做好本基金的信息披露工作，保证信息披露的真实、准确、完整、及时。

报告期内，本基金整体运作合法合规，内部控制和风险防范措施逐步完善，保障了基金份额持有人的利益。本基金管理人将继续从保障基金份额持有人利益、合规运作、防范和控制风险出发，提高内部控制和风险管理的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

4.7 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。

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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内本基金管理人无应说明预警信息。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，国泰海通证券股份有限公司（以下称"本托管人"）在天弘创业板300交易型开放式指数证券投资基金（以下称"本基金"）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	毕马威华振审字第2604409号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	天弘创业板300交易型开放式指数证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	我们审计了后附的天弘创业板300交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“该基金”）财务报表，包括2025年12月31日的资产负债表，2025年度的利润表、净资产变动表以及相关财务报表附注。 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照中华人民共和国财政部颁布的企业会计准则、《资产管理产品相关会计处理规定》（以下合称“企业会计准则”）及财务报表附注7.4.2中所列示的中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制，公允反映了该基金2025年12月31日的财务状况以及2025年度的经营成果和净资产变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则 (以下简称“审计准则”) 的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。按照中国注册会计师职业道德守则和《中国注册会计师独立性准则第1号——财务报表审计和审阅业务

	对独立性的要求》中适用于公众利益实体财务报表审计业务的独立性要求，我们独立于该基金，并履行了职业道德方面的其他责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	该基金管理人天弘基金管理有限公司 (以下简称“该基金管理人”) 管理层对其他信息负责。其他信息包括该基金2025年年度报告中涵盖的信息，但不包括财务报表和我们的审计报告。 我们对财务报表发表的审计意见不涵盖其他信息，我们也不对其他信息发表任何形式的鉴证结论。 结合我们对财务报表的审计，我们的责任是阅读其他信息，在此过程中，考虑其他信息是否与财务报表或我们在审计过程中了解到的情况存在重大不一致或者似乎存在重大错报。 基于我们已执行的工作，如果我们确定其他信息存在重大错报，我们应当报告该事实。在这方面，我们无任何事项需要报告。
管理层和治理层对财务报表的责任	该基金管理人管理层负责按照企业会计准则及财务报表附注7.4.2中所列示的中国证监会和中国证券投资基金业协会发布的有关基金行业实务操作的规定编制财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。 在编制财务报表时，该基金管理人管理层负责评估该基金的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项 (如适用)，并运用持续经营假设，除非该基金预计在清算时资产无法按照公允价值处置。 该基金管理人治理层负责监督该基金的财务报告过程。

注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。 在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： (1)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险，设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 (2)了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 (3)评价该基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 (4)对该基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对该基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致该基金不能持续经营。 (5)评价财务报表的总体列报 (包括披露) 、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和

	事项。 我们与该基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。	
会计师事务所的名称	毕马威华振会计师事务所 (特殊普通合伙)	
注册会计师的姓名	管祎铭	贾君宇
会计师事务所的地址	北京市东长安街1号东方广场毕马威大楼8层	
审计报告日期	2026-03-27	

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：天弘创业板300交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2025年12月31日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
资 产：			
货币资金	7.4.7.1	316,100.12	388,942.48
结算备付金		9,571.42	20,269.93
存出保证金		45,580.65	122,017.43
交易性金融资产	7.4.7.2	145,209,432.05	197,431,616.18
其中：股票投资		145,209,432.05	197,431,616.18
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-

应收清算款		-	-
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.5	-	-
资产总计		145,580,684.24	197,962,846.02
负债和净资产	**附注号**	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		49,386.63	1.42
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		62,855.03	88,392.98
应付托管费		12,571.02	17,678.60
应付销售服务费		-	-
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.6	43,275.14	133,791.27
负债合计		168,087.82	239,864.27
净资产：			
实收基金	7.4.7.7	121,747,113.00	241,747,113.00
未分配利润	7.4.7.8	23,665,483.42	-44,024,131.25
净资产合计		145,412,596.42	197,722,981.75
负债和净资产总计		145,580,684.24	197,962,846.02

注：报告截止日2025年12月31日，基金份额净值1.1944元，基金份额总额121,747,113.00份。

7.2 利润表

会计主体：天弘创业板300交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025年01月01日至2025年12月31日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2025年01月01日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日
一、营业总收入		69,980,217.75	12,941,754.42
1.利息收入		4,974.94	7,066.67
其中：存款利息收入	7.4.7.9	4,974.94	7,066.67
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）		29,136,716.29	491,576.38
其中：股票投资收益	7.4.7.10	27,164,256.88	-600,251.09
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.11	35,699.92	-20.27
资产支持证券投资收益	7.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.13	-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	1,936,759.49	1,091,847.74
其他投资收益		-	-
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	40,815,794.47	12,951,554.95
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	22,732.05	-508,443.58
减：二、营业总支出		1,345,936.41	954,322.01
1.管理人报酬		862,947.00	570,268.36
2.托管费		172,589.39	114,053.64
3.销售服务费		-	-
4.投资顾问费		-	-
5.利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6.信用减值损失	7.4.7.18	-	-
7.税金及附加		0.02	0.01
8.其他费用	7.4.7.19	310,400.00	270,000.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		68,634,281.34	11,987,432.41
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		68,634,281.34	11,987,432.41
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		68,634,281.34	11,987,432.41

7.3 净资产变动表

会计主体：天弘创业板300交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2025年01月01日至2025年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2025年01月01日至2025年12月31日		
	实收基金	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产	241,747,113.00	-44,024,131.25	197,722,981.75
二、本期期初净资	241,747,113.00	-44,024,131.25	197,722,981.75

产			
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	-120,000,000.00	67,689,614.67	-52,310,385.33
（一）、综合收益总额	-	68,634,281.34	68,634,281.34
（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）	-120,000,000.00	-944,666.67	-120,944,666.67
其中：1.基金申购款	70,000,000.00	-9,275,084.23	60,724,915.77
2.基金赎回款	-190,000,000.00	8,330,417.56	-181,669,582.44
（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	121,747,113.00	23,665,483.42	145,412,596.42
项 目	**上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日**		
	实收基金	**未分配利润**	**净资产合计**
一、上期期末净资产	113,747,113.00	-32,340,797.22	81,406,315.78
二、本期期初净资产	113,747,113.00	-32,340,797.22	81,406,315.78
三、本期增减变动额（减少以“-”号填列）	128,000,000.00	-11,683,334.03	116,316,665.97
（一）、综合收益总额	-	11,987,432.41	11,987,432.41

（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）	128,000,000.00	-23,670,766.44	104,329,233.56
其中：1.基金申购款	314,000,000.00	-57,429,750.03	256,570,249.97
2.基金赎回款	-186,000,000.00	33,758,983.59	-152,241,016.41
（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	241,747,113.00	-44,024,131.25	197,722,981.75

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

天弘创业板300交易型开放式指数证券投资基金（以下简称“本基金”）系经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2020]3163号《关于准予天弘创业板300交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》的准许，由基金管理人天弘基金管理有限公司向社会公开发行募集，基金合同于2021年05月11日生效，首次设立募集规模为321,747,113.00份基金份额。本基金的运作方式为交易型开放式，存续期限不定。本基金的基金管理人为天弘基金管理有限公司，基金托管人为国泰海通证券股份有限公司。

国泰海通证券股份有限公司是由原国泰君安证券股份有限公司更名而来，根据国泰海通证券股份有限公司发布的《国泰海通证券股份有限公司关于完成公司名称变更、注册资本变更、公司章程修订及相应市场主体变更登记的公告》，自2025年04月03日起，本基金基金托管人中文名称变更为“国泰海通证券股份有限公司”。根据上述变更，基

金管理人及基金托管人对《基金合同》《托管协议》等法律文件进行了相应修订，修订后的法律文件自2025年04月03日起生效。具体信息请参见基金管理人在规定媒介披露的《天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金更新基金托管人信息并修改基金合同等法律文件的公告》。

本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。此外，为更好地实现基金的投资目标，本基金还可以投资于国内依法发行上市的非成份股（包括中小板、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、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、货币市场工具、同业存单、债券回购、资产支持证券、银行存款、股指期货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。基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数的成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%，且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，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。股指期货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。如法律法规或监管机构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。

本财务报表由本基金的基金管理人天弘基金管理有限公司于2026年03月27日批准报出。

7.4.2 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2号《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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2025年度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12月31日的财务状况以及2025年度的经营成果和净资产变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 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。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 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。

7.4.4.4 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。

7.4.4.5 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。

7.4.4.6 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。

7.4.4.7 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。

7.4.4.8 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)。

7.4.4.9 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。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬和托管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。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金的每份基金份额享有同等分配权；

本基金收益分配方式为现金分红；

基金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达到1%以上时，基金管理人可以进行收益分配；在收益评价日，基金管理人对基金份额净值增长率和标的指数同期增长率的计算方法如下：基金份额净值增长率为收益评价日基金份额净值与基金上市前一日基金份额净值之比减去1乘以100%（期间如发生基金份额折算、拆分或合并，则以基金份额折算日、经拆分或合并调整后的基金份额折算日为初始日重新计算）；标的指数同期增长率为收益评价日标的指数收盘值与基金上市前一日标的指数收盘值之比减去1乘以100%（期间如发生基金份额折算、拆分或合并，则以基金份额折算日、经拆分或合并调整后的基金份额折算日为初始日重新计算）；

本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。基于本基金的性质和特点，本基金收益分配不须以弥补浮动亏损为前提，收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值；

若基金合同生效不满3个月则可不进行收益分配；

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，基金管理人可对基金收益分配原则进行调整，无需召开基金份额持有人大会。

7.4.4.12 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。

7.4.4.13 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。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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》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。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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 货币资金

单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
活期存款	316,100.12	388,942.48
等于：本金	315,974.10	388,774.28
加：应计利息	126.02	168.20
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	316,100.12	388,942.48

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	107,131,891.16	-	145,209,432.05	38,077,540.89
贵金属投资-金交	-	-	-	-

所黄金合约					
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		107,131,891.16	-	145,209,432.05	38,077,540.89
项目		上年度末 2024年12月31日			
		成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票		200,169,869.76	-	197,431,616.18	-2,738,253.58
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	-	-	-	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		200,169,869.76	-	197,431,616.18	-2,738,253.58

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款估值增值。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日	上年度末 2024年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	-	-
应付证券出借违约金	-	-
应付交易费用	3,275.14	13,791.27
其中：交易所市场	3,275.14	13,791.27
银行间市场	-	-
应付利息	-	-
预提费用	40,000.00	120,000.00
合计	43,275.14	133,791.27

7.4.7.7 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	241,747,113.00	241,747,113.00
本期申购	70,000,000.00	70,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-190,000,000.00	-190,000,000.00
本期末	121,747,113.00	121,747,113.00

7.4.7.8 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	17,754,750.63	-61,778,881.88	-44,024,131.25
本期期初	17,754,750.63	-61,778,881.88	-44,024,131.25

本期利润	27,818,486.87	40,815,794.47	68,634,281.34
本期基金份额交易产生的变动数	-14,018,738.42	13,074,071.75	-944,666.67
其中：基金申购款	7,403,176.46	-16,678,260.69	-9,275,084.23
基金赎回款	-21,421,914.88	29,752,332.44	8,330,417.56
本期已分配利润	-	-	-
本期末	31,554,499.08	-7,889,015.66	23,665,483.42

7.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日
活期存款利息收入	4,633.45	6,135.60
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	78.49	445.45
其他	263.00	485.62
合计	4,974.94	7,066.67

7.4.7.10 股票投资收益

7.4.7.10.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	4,995,514.90	-138,526.39
股票投资收益——赎回差价收入	22,168,741.98	-461,724.70
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	27,164,256.88	-600,251.09

7.4.7.10.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日
卖出股票成交总额	33,315,470.91	33,236,967.73
减：卖出股票成本总额	28,285,105.72	33,337,528.64
减：交易费用	34,850.29	37,965.48
买卖股票差价收入	4,995,514.90	-138,526.39

7.4.7.10.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日
赎回基金份额对价总额	181,669,582.44	152,241,016.41
减：现金支付赎回款总额	2,564,617.44	814,845.41
减：赎回股票成本总额	156,936,223.02	151,887,895.70
减：交易费用	-	-
赎回差价收入	22,168,741.98	-461,724.70

7.4.7.11 债券投资收益

7.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日
债券投资收益——利息收入	16.35	6.88
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	35,683.57	-27.15
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	35,699.92	-20.27

7.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	193,007.87	45,681.77
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	157,300.00	45,700.00
减：应计利息总额	16.57	7.09
减：交易费用	7.73	1.83
买卖债券差价收入	35,683.57	-27.15

7.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间未取得资产支持证券投资收益。

7.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间未取得贵金属投资收益。

7.4.7.14 衍生工具收益

7.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间未取得买卖权证差价收入。

7.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间未取得其他衍生工具投资收益。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日
股票投资产生的股利收益	1,936,759.49	1,091,847.74
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	1,936,759.49	1,091,847.74

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2025年01月01日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日
1.交易性金融资产	40,815,794.47	12,951,554.95
——股票投资	40,815,794.47	12,951,554.95
——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	40,815,794.47	12,951,554.95

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年

	12月31日	12月31日
基金赎回费收入	-	-
基金转换费收入	-	-
ETF基金替代损益	22,732.05	-508,443.58
合计	22,732.05	-508,443.58

7.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生信用减值损失。

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日
审计费用	40,000.00	40,000.00
信息披露费	120,000.00	80,000.00
证券出借违约金	-	-
ETF登记结算费	150,000.00	150,000.00
开户费	400.00	-
合计	310,400.00	270,000.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

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
国泰海通证券股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

蚂蚁科技集团股份有限公司	基金管理人的控股股东
内蒙古君正能源化工集团股份有限公司	基金管理人的股东
天津信托有限责任公司	基金管理人的股东
芜湖高新投资有限公司	基金管理人的股东
新疆天阜恒基股权投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
新疆天惠新盟股权投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
新疆天聚宸兴股权投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
新疆天瑞博丰股权投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
天弘创新资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司
天弘创业板300交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	本基金的联接基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年01月01日至2025年12月31日		上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国泰海通证券股份有限公司	39,202,025.65	58.63%	77,050,143.78	99.78%

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名	本期	上年度可比期间

称	2025年01月01日至2025年12月31日		2024年01月01日至2024年12月31日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券成交总额的比例
国泰海通证券股份有限公司	158,609.87	82.18%	45,681.77	100.00%

7.4.10.1.4 债券回购交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行债券回购交易。

7.4.10.1.5 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年01月01日至2025年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国泰海通证券股份有限公司	8,150.85	58.63%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国泰海通证券股份有限公司	16,319.57	99.54%	13,791.27	100.00%

注: 1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定。

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

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	862,947.00	570,268.36
其中：应支付销售机构的客户维护费	74,402.77	31,407.76
应支付基金管理人的净管理费	788,544.23	538,860.60

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

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

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年12月31日	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	172,589.39	114,053.64

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

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.10.4 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

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

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

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

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

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.4.10.5.2 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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2025年12月31日		上年度末 2024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
天弘创业板300交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	93,516,404.00	76.81%	162,378,200.00	67.17%

注：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。

7.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2025年01月01日至2025年12月31日		上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
国泰海通证券股份有限公司	316,100.12	4,633.45	388,942.48	6,135.60

注：本基金由基金托管人国泰海通证券股份有限公司保管的银行存款，存放在具有基金托管资格的银行，按银行同业利率或约定利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2025年01月01日至2025年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张/股）	总金额
国泰海通证券股份有限公司	301173	毓恬冠佳	网下申购	1,465	41,503.45
国泰海通证券股份有限公司	301658	首航新能	网下申购	3,640	42,952.00
国泰海通证券股份有限公司	001221	悍高集团	网下申购	1,076	16,602.68
国泰海通证券股份有限公司	301656	联合动力	网下申购	3,142	39,212.16
国泰海通证券股份	123259	锦浪转02	配债发行	234	23,400.00

有限公司					
国泰海通证券股份有限公司	001233	海安集团	网下申购	302	14,496.00
上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张/股）	总金额
国泰海通证券股份有限公司	301591	肯特股份	网下申购	811	15,757.73
国泰海通证券股份有限公司	301571	国科天成	网下申购	1,540	17,155.60
国泰海通证券股份有限公司	301607	富特科技	网下申购	1,433	20,062.00
国泰海通证券股份有限公司	301556	托普云农	网下申购	2,113	30,638.50

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 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。

7.4.12 期末（2025年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券	证券	成功	受限	流通	认购	期末	数量	期末	期末	备注

代码	名称	认购日	期	受限类型	价格	估值单价	（单位：股）	成本总额	估值总额	
301656	联合动力	2025-09-17	6个月	新股流通受限	12.48	25.46	943	11,768.64	24,008.78	-
001280	中国铀业	2025-11-25	6个月	新股流通受限	17.89	45.36	524	9,374.36	23,768.64	-
301563	云汉芯城	2025-09-23	6个月	新股流通受限	27.00	133.69	110	2,970.00	14,705.90	-
301584	建发致新	2025-09-18	6个月	新股流通受限	7.05	26.82	418	2,946.90	11,210.76	-
301609	山大电力	2025-07-16	6个月	新股流通受限	14.66	40.99	222	3,254.52	9,099.78	-
001386	马可波罗	2025-10-15	6个月	新股流通受限	13.75	18.53	435	5,981.25	8,060.55	-
301668	昊创瑞通	2025-09-15	6个月	新股流通受限	21.00	44.80	144	3,024.00	6,451.20	-
301667	纳百川	2025-12-10	6个月	新股流通受限	22.63	57.07	108	2,444.04	6,163.56	-
001221	悍高集团	2025-07-23	6个月	新股流通受限	15.43	56.94	108	1,666.44	6,149.52	-
301687	N新广益	2025-12-24	6个月	新股流通受限	21.93	54.39	103	2,258.79	5,602.17	-
3015	艾芬	2025-	6个	新股	27.69	49.55	111	3,07	5,50	-

75	达	09-03	月	流通受限				3.59	0.05	
301449	天溯计量	2025-12-16	6个月	新股流通受限	36.80	65.23	80	2,944.00	5,218.40	-
001233	海安集团	2025-11-18	6个月	新股流通受限	48.00	51.88	91	4,368.00	4,721.08	-
001388	信通电子	2025-06-24	6个月	新股流通受限	16.42	42.94	91	1,494.22	3,907.54	-
001369	C双欣	2025-12-23	6个月	新股流通受限	6.85	12.89	212	1,452.20	2,732.68	-
001285	瑞立科密	2025-09-23	6个月	新股流通受限	42.28	56.08	38	1,606.64	2,131.04	-
001396	C誉帆	2025-12-23	6个月	新股流通受限	22.29	35.39	60	1,337.40	2,123.40	-

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。

7.4.12.2 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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2025年12月31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。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2025年12月31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。

7.4.12.4 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是被动式投资的股票型指数基金，紧密跟踪标的指数，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似，本基金预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。本基金采用完全复制法，跟踪标的指数，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但因特殊情况（比如流动性不足等）导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可使用其他合理方法进行适当的替代，力求与标的指数的跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。

本基金管理人按照“全面管理、专业分工、各司其职”的思路，明确风险管理职责并将其融入组织架构、写入制度、嵌入系统，实施多层次、多角度、全方位的风险管理。一是投资决策实施分层授权管理，投资决策委员会、投资总监、投资部门负责人和基金经理对投资行为及相关风险进行管理、监控，根据不同权限实施风险控制；二是按照部门职能执行分工管理，基金经理、中央交易室、研究相关部门、风险管理部、内控合规部、基金运营部等从不同角度、不同环节对投资全过程实行风险监控和管理；三是投资到结算的全流程，已经形成了一套贯穿“事前风险定位、事中风险管理和事后风险评估”的健全风险监控体系。

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

7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款和定期存款存放在本基金的托管人国泰海通证券股份有限公司开立于具有基金托管资格的银行的托管账户及其他具有基金托管资格的国有银行和大型股份制银行，并实施不同区间的额度管理，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，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。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级的债券。

7.4.13.2.2 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。

7.4.13.2.3 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。

7.4.13.2.4 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。

7.4.13.2.5 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。

7.4.13.2.6 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。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险来自调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

本基金于报告期末的卖出回购金融资产款（若有）计息且利息金额不重大；本基金所承担的其他金融负债的合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。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注7.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。本期末，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合法律法规的相关要求。

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

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 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	316,100.12	-	-	-	316,100.12
结算备付金	9,571.42	-	-	-	9,571.42
存出保证金	45,580.65	-	-	-	45,580.65
交易性金融资产	-	-	-	145,209,432.05	145,209,432.05
资产总计	371,252.19	-	-	145,209,432.05	145,580,684.24
负债					
应付清算款	-	-	-	49,386.63	49,386.63
应付管理人报酬	-	-	-	62,855.03	62,855.03
应付托管费	-	-	-	12,571.02	12,571.02
其他负债	-	-	-	43,275.14	43,275.14
负债总计	-	-	-	168,087.82	168,087.82
利率敏感度缺口	371,252.19	-	-	145,041,344.23	145,412,596.42
上年度末 2024年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
货币资金	388,942.48	-	-	-	388,942.48
结算备付金	20,269.93	-	-	-	20,269.93
存出保证金	122,017.43	-	-	-	122,017.43
交易性金融资产	-	-	-	197,431,616.18	197,431,616.18
资产总计	531,229.84	-	-	197,431,616.18	197,962,846.02
负债					

应付清算款	-	-	-	1.42	1.42
应付管理人报酬	-	-	-	88,392.98	88,392.98
应付托管费	-	-	-	17,678.60	17,678.60
其他负债	-	-	-	133,791.27	133,791.27
负债总计	-	-	-	239,864.27	239,864.27
利率敏感度缺口	531,229.84	-	-	197,191,751.91	197,722,981.75

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2025年12月31日，本基金未持有交易性债券投资 (2024年12月31日：同)，因此市场利率的变动对于本基金净资产无重大影响(2024年12月31日：同)。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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，跟踪创业板300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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2025年12月31日		上年度末 2024年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例	公允价值	占基金资产净值比例

		(%)		(%)
交易性金融资产－股票投资	145,209,432.05	99.86	197,431,616.18	99.85
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	145,209,432.05	99.86	197,431,616.18	99.85

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。

7.4.13.4.3.2 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12月31日	上年度末 2024年12月31日
	业绩比较基准上升5%	7,699,019.10	9,935,184.39
	业绩比较基准下降5%	-7,699,019.10	-9,935,184.39

7.4.14 公允价值

7.4.14.1 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。

7.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

7.4.14.2.1 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12月31日	上年度末 2024年12月31日
第一层次	145,067,877.00	197,280,516.55
第二层次	-	-
第三层次	141,555.05	151,099.63
合计	145,209,432.05	197,431,616.18

7.4.14.2.2 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。

7.4.14.2.3 第三层次公允价值余额及变动情况

7.4.14.2.3.1 第三层次公允价值余额及变动情况

单位：人民币元

项目	本期 2025年01月01日至2025年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	151,099.63	151,099.63
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	133,464.78	133,464.78
转出第三层次	-	381,648.09	381,648.09
当期利得或损失总额	-	238,638.73	238,638.73
其中：计入损益的利得或损失	-	238,638.73	238,638.73
计入其他综合	-	-	-

收益的利得或损失			
期末余额	-	141,555.05	141,555.05
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	79,590.06	79,590.06
项目	上年度可比期间 2024年01月01日至2024年12月31日		
	交易性金融资产		合计
	债券投资	股票投资	
期初余额	-	134,571.11	134,571.11
当期购买	-	-	-
当期出售/结算	-	-	-
转入第三层次	-	80,248.41	80,248.41
转出第三层次	-	159,558.46	159,558.46
当期利得或损失总额	-	95,838.57	95,838.57
其中：计入损益的利得或损失	-	95,838.57	95,838.57
计入其他综合收益的利得或损失	-	-	-
期末余额	-	151,099.63	151,099.63
期末仍持有的第三层次金融资产计入本期损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-	92,983.25	92,983.25

注：于2025年12月31日，本基金持有的第三层次的交易性金融资产均为证券交易所上市交易但尚在限售期内的股票投资。于2025年度，本基金从第三层次转出的交易性金融资产均为限售期结束可正常交易的股票投资。计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

7.4.14.2.3.2 使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的情况

单位：人民币元

项目	本期末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股票投资	141,555.05	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	0.1920~2.4267	负相关
项目	上年度末公允价值	采用的估值技术	不可观察输入值		
			名称	范围/加权平均值	与公允价值之间的关系
股票投资	151,099.63	平均价格亚式期权模型	预期年化波动率	0.4607~5.7444	负相关

7.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2025年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2024年12月31日：同)。

7.4.14.4 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。

7.4.15 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。

§8 投资组合报告

8.1 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	145,209,432.05	99.74
	其中：股票	145,209,432.05	99.74
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-

	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	325,671.54	0.22
8	其他各项资产	45,580.65	0.03
9	合计	145,580,684.24	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	2,216,224.20	1.52
B	采矿业	-	-
C	制造业	111,500,763.46	76.68
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	2,279,935.00	1.57
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	14,287,232.59	9.83
J	金融业	8,437,836.65	5.80
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	846,028.80	0.58
M	科学研究和技术服务业	2,343,574.48	1.61
N	水利、环境和公共设施管理业	174,048.00	0.12

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	108,478.00	0.07
Q	卫生和社会工作	1,351,761.26	0.93
R	文化、体育和娱乐业	1,521,994.56	1.05
S	综合	-	-
	合计	145,067,877.00	99.76

8.2.2 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	23,768.64	0.02
C	制造业	84,527.95	0.06
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	25,916.66	0.02
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	-	-
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	7,341.80	0.01
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	141,555.05	0.10

8.3 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

8.3.1 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	300750	宁德时代	52,470	19,270,132.20	13.25
2	300308	中际旭创	17,440	10,638,400.00	7.32
3	300502	新易盛	18,159	7,824,349.92	5.38
4	300059	东方财富	263,007	6,096,502.26	4.19
5	300274	阳光电源	30,220	5,168,828.80	3.55
6	300476	胜宏科技	12,400	3,565,992.00	2.45
7	300124	汇川技术	40,250	3,032,032.50	2.09
8	300760	迈瑞医疗	12,441	2,369,388.45	1.63
9	300498	温氏股份	113,300	1,912,504.00	1.32
10	300394	天孚通信	8,976	1,822,397.28	1.25
11	300014	亿纬锂能	27,080	1,780,780.80	1.22
12	300033	同花顺	4,178	1,346,068.04	0.93
13	300433	蓝思科技	39,700	1,201,719.00	0.83
14	300408	三环集团	25,600	1,171,200.00	0.81
15	300450	先导智能	22,400	1,119,552.00	0.77
16	300136	信维通信	16,400	1,016,800.00	0.70
17	300803	指南针	7,605	995,266.35	0.68
18	300475	香农芯创	6,800	981,512.00	0.67
19	300015	爱尔眼科	88,677	973,673.46	0.67
20	300604	长川科技	8,860	897,606.60	0.62
21	300115	长盈精密	19,280	896,520.00	0.62

22	300395	菲利华	8,650	867,595.00	0.60
23	300058	蓝色光标	73,440	846,028.80	0.58
24	300255	常山药业	13,500	838,350.00	0.58
25	301308	江波龙	3,300	807,972.00	0.56
26	300857	协创数据	4,580	772,554.40	0.53
27	300339	润和软件	15,600	772,200.00	0.53
28	300223	北京君正	7,000	742,280.00	0.51
29	300442	润泽科技	14,000	739,200.00	0.51
30	300418	昆仑万维	17,400	725,580.00	0.50
31	300207	欣旺达	27,700	724,355.00	0.50
32	300390	天华新能	11,740	641,121.40	0.44
33	300548	长芯博创	4,500	639,000.00	0.44
34	300751	迈为股份	3,100	638,569.00	0.44
35	300347	泰格医药	10,773	610,829.10	0.42
36	301236	软通动力	12,550	595,246.50	0.41
37	300456	赛微电子	10,600	593,176.00	0.41
38	300782	卓胜微	7,060	575,248.80	0.40
39	300454	深信服	4,886	562,671.76	0.39
40	300661	圣邦股份	8,193	562,367.52	0.39
41	300759	康龙化成	19,250	547,277.50	0.38
42	301358	湖南裕能	8,200	530,212.00	0.36
43	300054	鼎龙股份	14,100	530,160.00	0.36
44	300724	捷佳伟创	5,500	525,800.00	0.36
45	300346	南大光电	12,084	518,403.60	0.36
46	300458	全志科技	12,135	510,034.05	0.35
47	300037	新宙邦	9,720	509,328.00	0.35
48	300474	景嘉微	7,050	506,683.50	0.35
49	300866	安克创新	4,360	498,740.40	0.34
50	300757	罗博特科	2,100	489,930.00	0.34
51	300496	中科创达	7,100	479,250.00	0.33
52	300251	光线传媒	28,962	474,397.56	0.33

53	300073	当升科技	8,200	473,960.00	0.33
54	300748	金力永磁	13,876	473,310.36	0.33
55	300285	国瓷材料	17,000	465,970.00	0.32
56	300316	晶盛机电	12,500	459,375.00	0.32
57	300762	上海瀚讯	10,900	454,312.00	0.31
58	302132	中航成飞	5,700	450,300.00	0.31
59	301269	华大九天	4,200	446,586.00	0.31
60	300002	神州泰岳	38,300	441,216.00	0.30
61	300024	机器人	24,198	440,161.62	0.30
62	300017	网宿科技	42,900	439,725.00	0.30
63	300122	智飞生物	23,001	434,028.87	0.30
64	300699	光威复材	10,840	427,746.40	0.29
65	300896	爱美客	2,840	402,484.80	0.28
66	300373	扬杰科技	5,900	401,200.00	0.28
67	300919	中伟股份	8,620	399,364.60	0.27
68	300620	光库科技	2,700	397,035.00	0.27
69	300832	新产业	7,000	393,750.00	0.27
70	300012	华测检测	28,600	387,530.00	0.27
71	300666	江丰电子	4,200	386,400.00	0.27
72	300438	鹏辉能源	7,200	383,184.00	0.26
73	300003	乐普医疗	24,200	382,602.00	0.26
74	300170	汉得信息	20,200	382,184.00	0.26
75	300570	太辰光	3,300	381,315.00	0.26
76	300568	星源材质	24,838	378,779.50	0.26
77	300001	特锐德	14,700	377,496.00	0.26
78	300085	银之杰	9,300	372,837.00	0.26
79	300383	光环新网	29,000	362,790.00	0.25
80	300972	万辰集团	1,800	361,926.00	0.25
81	300142	沃森生物	32,900	358,939.00	0.25
82	300567	精测电子	3,900	355,680.00	0.24
83	300627	华测导航	10,180	355,383.80	0.24

84	300432	富临精工	21,080	352,036.00	0.24
85	300779	惠城环保	2,700	351,297.00	0.24
86	300468	四方精创	8,900	345,587.00	0.24
87	300628	亿联网络	9,680	345,092.00	0.24
88	300677	英科医疗	8,655	336,679.50	0.23
89	300953	震裕科技	2,000	336,040.00	0.23
90	300999	金龙鱼	11,500	330,510.00	0.23
91	300763	锦浪科技	4,550	324,915.50	0.22
92	300049	福瑞医科	4,600	323,886.00	0.22
93	300773	拉卡拉	11,300	321,824.00	0.22
94	300253	卫宁健康	36,300	320,166.00	0.22
95	300409	道氏技术	14,100	317,109.00	0.22
96	300672	国科微	2,900	312,098.00	0.21
97	300487	蓝晓科技	5,050	311,837.50	0.21
98	300459	汤姆猫	67,800	311,202.00	0.21
99	300413	芒果超媒	12,600	307,692.00	0.21
100	300655	晶瑞电材	19,062	307,470.06	0.21
101	300364	中文在线	12,200	306,464.00	0.21
102	300290	荣科科技	10,800	297,324.00	0.20
103	301550	斯菱智驱	2,100	291,270.00	0.20
104	300777	中简科技	7,100	289,680.00	0.20
105	300007	汉威科技	5,400	289,440.00	0.20
106	300045	华力创通	9,900	286,209.00	0.20
107	300296	利亚德	45,000	284,400.00	0.20
108	300229	拓尔思	14,100	280,590.00	0.19
109	300236	上海新阳	4,400	280,544.00	0.19
110	300738	奥飞数据	15,032	277,941.68	0.19
111	300679	电连技术	5,650	275,042.00	0.19
112	300638	广和通	9,262	274,525.68	0.19
113	300083	创世纪	29,800	274,458.00	0.19
114	300623	捷捷微电	10,100	274,417.00	0.19

115	300674	宇信科技	11,240	272,682.40	0.19
116	300765	新诺威	7,520	271,246.40	0.19
117	300144	宋城演艺	32,700	267,813.00	0.18
118	300118	东方日升	18,100	265,346.00	0.18
119	300315	掌趣科技	53,700	265,278.00	0.18
120	300199	翰宇药业	14,800	264,920.00	0.18
121	300088	长信科技	43,100	261,186.00	0.18
122	301171	易点天下	6,400	259,200.00	0.18
123	300573	兴齐眼药	3,645	256,207.05	0.18
124	300035	中科电气	11,700	249,093.00	0.17
125	301611	珂玛科技	2,900	248,617.00	0.17
126	300182	捷成股份	44,900	247,848.00	0.17
127	300100	双林股份	6,200	245,644.00	0.17
128	300676	华大基因	5,400	244,944.00	0.17
129	300065	海兰信	13,400	243,478.00	0.17
130	300558	贝达药业	5,200	242,788.00	0.17
131	300077	国民技术	12,000	242,640.00	0.17
132	300068	南都电源	15,600	242,424.00	0.17
133	300101	振芯科技	8,500	241,655.00	0.17
134	300850	新强联	5,840	241,600.80	0.17
135	300775	三角防务	7,900	240,160.00	0.17
136	300146	汤臣倍健	19,900	238,999.00	0.16
137	300811	铂科新材	3,300	235,323.00	0.16
138	300657	弘信电子	8,200	226,812.00	0.16
139	300766	每日互动	6,900	226,113.00	0.16
140	300348	长亮科技	14,600	226,008.00	0.16
141	300133	华策影视	27,100	225,472.00	0.16
142	300008	天海防务	28,400	224,076.00	0.15
143	300827	上能电气	6,503	222,532.66	0.15
144	300718	长盛轴承	2,600	221,936.00	0.15
145	300353	东土科技	10,900	221,924.00	0.15

146	300870	欧陆通	1,000	221,000.00	0.15
147	300130	新国都	7,900	219,067.00	0.15
148	300009	安科生物	22,860	218,770.20	0.15
149	300053	航宇微	11,500	218,730.00	0.15
150	301511	德福科技	6,100	218,319.00	0.15
151	300260	新莱应材	3,800	216,182.00	0.15
152	300184	力源信息	21,600	215,784.00	0.15
153	301536	星宸科技	3,600	215,676.00	0.15
154	300398	飞凯材料	9,407	210,810.87	0.14
155	301316	慧博云通	4,700	209,996.00	0.14
156	300457	赢合科技	7,500	208,875.00	0.14
157	300618	寒锐钴业	4,600	207,966.00	0.14
158	300607	拓斯达	6,300	207,522.00	0.14
159	300624	万兴科技	2,937	207,499.05	0.14
160	300693	盛弘股份	5,400	206,712.00	0.14
161	300769	德方纳米	4,672	205,614.72	0.14
162	301626	苏州天脉	1,100	204,930.00	0.14
163	301205	联特科技	1,200	202,212.00	0.14
164	300735	光弘科技	8,100	201,366.00	0.14
165	300455	航天智装	6,700	201,268.00	0.14
166	300602	飞荣达	6,014	199,424.24	0.14
167	300682	朗新集团	13,100	199,251.00	0.14
168	300113	顺网科技	9,800	198,352.00	0.14
169	300181	佐力药业	12,000	193,920.00	0.13
170	300601	康泰生物	13,120	193,782.40	0.13
171	300660	江苏雷利	3,500	191,870.00	0.13
172	300979	华利集团	3,800	190,798.00	0.13
173	300034	钢研高纳	9,620	188,359.60	0.13
174	301029	怡合达	7,020	186,170.40	0.13
175	301078	孩子王	17,900	185,623.00	0.13
176	301050	雷电微力	3,540	184,788.00	0.13

177	300166	东方国信	17,900	182,938.00	0.13
178	300224	正海磁材	11,700	180,882.00	0.12
179	301377	鼎泰高科	1,300	180,830.00	0.12
180	300180	华峰超纤	25,900	179,487.00	0.12
181	301165	锐捷网络	2,020	179,376.00	0.12
182	300747	锐科激光	6,575	177,722.25	0.12
183	301510	固高科技	4,700	176,015.00	0.12
184	300910	瑞丰新材	3,100	175,305.00	0.12
185	300776	帝尔激光	2,812	174,737.68	0.12
186	300276	三丰智能	18,000	174,600.00	0.12
187	300070	碧水源	44,400	174,048.00	0.12
188	300185	通裕重工	60,300	171,252.00	0.12
189	300529	健帆生物	8,650	170,145.50	0.12
190	300415	伊之密	6,500	169,390.00	0.12
191	300772	运达股份	8,842	168,528.52	0.12
192	300303	聚飞光电	24,500	167,580.00	0.12
193	300212	易华录	9,600	167,520.00	0.12
194	300446	航天智造	6,600	167,244.00	0.12
195	301217	铜冠铜箔	4,800	164,544.00	0.11
196	300031	宝通科技	7,200	163,656.00	0.11
197	301293	三博脑科	2,760	162,784.80	0.11
198	300493	润欣科技	8,100	162,729.00	0.11
199	300357	我武生物	5,700	161,595.00	0.11
200	300436	广生堂	1,800	160,470.00	0.11
201	300075	数字政通	10,440	160,149.60	0.11
202	301219	腾远钴业	2,340	159,775.20	0.11
203	300576	容大感光	4,140	159,597.00	0.11
204	300663	科蓝软件	9,030	159,289.20	0.11
205	300352	北信源	25,800	158,154.00	0.11
206	300525	博思软件	11,216	158,145.60	0.11
207	300598	诚迈科技	3,410	156,757.70	0.11

208	300087	荃银高科	13,390	156,395.20	0.11
209	300168	万达信息	24,200	156,332.00	0.11
210	300363	博腾股份	6,700	155,708.00	0.11
211	300327	中颖电子	5,550	155,566.50	0.11
212	300319	麦捷科技	13,275	155,184.75	0.11
213	300725	药石科技	4,023	155,126.88	0.11
214	300957	贝泰妮	3,900	154,479.00	0.11
215	301200	大族数控	1,300	154,401.00	0.11
216	300188	国投智能	10,500	153,405.00	0.11
217	300595	欧普康视	10,380	152,482.20	0.10
218	301526	国际复材	21,700	151,900.00	0.10
219	301345	涛涛车业	600	150,792.00	0.10
220	300026	红日药业	42,800	150,656.00	0.10
221	300244	迪安诊断	9,500	150,575.00	0.10
222	300204	舒泰神	5,500	150,260.00	0.10
223	301263	泰恩康	5,100	147,849.00	0.10
224	300761	立华股份	7,100	147,325.00	0.10
225	301155	海力风电	1,800	145,674.00	0.10
226	301095	广立微	2,000	143,420.00	0.10
227	300079	数码视讯	26,400	142,296.00	0.10
228	300855	图南股份	4,390	141,797.00	0.10
229	300072	海新能科	30,800	141,680.00	0.10
230	301291	明阳电气	3,400	141,474.00	0.10
231	300294	博雅生物	6,200	140,120.00	0.10
232	301039	中集车辆	15,300	139,995.00	0.10
233	300888	稳健医疗	3,660	138,494.40	0.10
234	300687	赛意信息	6,000	137,820.00	0.09
235	300726	宏达电子	2,700	137,457.00	0.09
236	301522	上大股份	3,500	137,095.00	0.09
237	300634	彩讯股份	5,400	136,242.00	0.09
238	301018	申菱环境	2,100	133,392.00	0.09

239	301301	川宁生物	13,100	132,834.00	0.09
240	300685	艾德生物	6,380	130,534.80	0.09
241	301035	润丰股份	1,900	129,219.00	0.09
242	300451	创业慧康	26,505	128,284.20	0.09
243	300841	康华生物	1,750	126,455.00	0.09
244	300678	中科信息	4,100	126,116.00	0.09
245	301031	中熔电气	1,120	125,652.80	0.09
246	300428	立中集团	5,367	125,319.45	0.09
247	300633	开立医疗	4,700	124,174.00	0.09
248	301498	乖宝宠物	1,900	123,785.00	0.09
249	300171	东富龙	7,800	122,460.00	0.08
250	300821	东岳硅材	10,500	122,430.00	0.08
251	300323	华灿光电	15,200	121,296.00	0.08
252	300613	富瀚微	2,620	120,677.20	0.08
253	301392	汇成真空	900	116,136.00	0.08
254	301589	诺瓦星云	700	115,185.00	0.08
255	300203	聚光科技	7,200	114,192.00	0.08
256	300482	万孚生物	5,770	113,957.50	0.08
257	300783	三只松鼠	4,900	113,435.00	0.08
258	300284	苏交科	14,200	111,896.00	0.08
259	300257	开山股份	7,900	110,995.00	0.08
260	301091	深城交	4,150	110,971.00	0.08
261	300580	贝斯特	4,200	110,418.00	0.08
262	300770	新媒股份	2,600	110,266.00	0.08
263	301487	盟固利	5,000	109,650.00	0.08
264	300492	华图山鼎	1,460	108,478.00	0.07
265	301061	匠心家居	1,140	108,072.00	0.07
266	301297	富乐德	3,000	107,400.00	0.07
267	300723	一品红	3,200	107,360.00	0.07
268	300298	三诺生物	6,200	106,082.00	0.07
269	300119	瑞普生物	5,600	105,112.00	0.07

270	301071	力量钻石	2,860	102,502.40	0.07
271	300990	同飞股份	1,100	99,165.00	0.07
272	300913	兆龙互连	1,820	95,786.60	0.07
273	301238	瑞泰新材	4,500	91,800.00	0.06
274	300134	大富科技	7,300	91,250.00	0.06
275	300641	正丹股份	5,000	88,250.00	0.06
276	300705	九典制药	5,720	85,685.60	0.06
277	300579	数字认证	2,500	84,025.00	0.06
278	300861	美畅股份	5,492	81,995.56	0.06
279	300926	博俊科技	2,500	81,950.00	0.06
280	300080	易成新能	16,800	81,648.00	0.06
281	300768	迪普科技	4,350	80,605.50	0.06
282	301363	美好医疗	3,340	80,327.00	0.06
283	300820	英杰电气	1,600	76,720.00	0.05
284	301551	无线传媒	2,400	75,720.00	0.05
285	301153	中科江南	2,860	70,699.20	0.05
286	301606	绿联科技	1,200	70,488.00	0.05
287	301047	义翘神州	1,000	67,600.00	0.05
288	301267	华厦眼科	3,600	64,728.00	0.04
289	300406	九强生物	4,900	64,043.00	0.04
290	301015	百洋医药	2,700	63,720.00	0.04
291	301327	华宝新能	1,060	61,130.20	0.04
292	301207	华兰疫苗	3,000	55,890.00	0.04
293	301339	通行宝	3,600	52,344.00	0.04
294	301381	赛维时代	2,300	47,357.00	0.03
295	301004	嘉益股份	880	45,804.00	0.03
296	301371	敷尔佳	1,620	38,377.80	0.03
297	301275	汉朔科技	700	37,394.00	0.03
298	301262	海看股份	1,100	27,379.00	0.02
299	301658	首航新能	900	25,704.00	0.02
300	301665	泰禾股份	800	22,592.00	0.02

8.3.2 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	301656	联合动力	943	24,008.78	0.02
2	001280	中国铀业	524	23,768.64	0.02
3	301563	云汉芯城	110	14,705.90	0.01
4	301584	建发致新	418	11,210.76	0.01
5	301609	山大电力	222	9,099.78	0.01
6	001386	马可波罗	435	8,060.55	0.01
7	301668	昊创瑞通	144	6,451.20	0.00
8	301667	纳百川	108	6,163.56	0.00
9	001221	悍高集团	108	6,149.52	0.00
10	301687	N新广益	103	5,602.17	0.00
11	301575	艾芬达	111	5,500.05	0.00
12	301449	天溯计量	80	5,218.40	0.00
13	001233	海安集团	91	4,721.08	0.00
14	001388	信通电子	91	3,907.54	0.00
15	001369	C双欣	212	2,732.68	0.00
16	001285	瑞立科密	38	2,131.04	0.00
17	001396	C誉帆	60	2,123.40	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	300750	宁德时代	1,291,652.80	0.65
2	300570	太辰光	788,761.00	0.40

3	300033	同花顺	763,893.00	0.39
4	300548	长芯博创	695,923.00	0.35
5	300972	万辰集团	617,454.00	0.31
6	300760	迈瑞医疗	502,161.00	0.25
7	300100	双林股份	493,585.00	0.25
8	300059	东方财富	475,579.00	0.24
9	300766	每日互动	458,176.00	0.23
10	301269	华大九天	443,616.99	0.22
11	301536	星宸科技	439,895.00	0.22
12	300124	汇川技术	428,834.00	0.22
13	300607	拓斯达	425,038.00	0.21
14	301308	江波龙	421,538.00	0.21
15	300184	力源信息	401,378.00	0.20
16	300394	天孚通信	400,820.00	0.20
17	300953	震裕科技	356,530.00	0.18
18	300751	迈为股份	339,924.00	0.17
19	300718	长盛轴承	336,835.00	0.17
20	300290	荣科科技	331,168.00	0.17

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。

8.4.2 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	300750	宁德时代	2,120,197.00	1.07
2	300308	中际旭创	771,838.00	0.39
3	300896	爱美客	765,487.00	0.39
4	300779	惠城环保	677,191.00	0.34
5	300757	罗博特科	616,311.00	0.31

6	300059	东方财富	603,736.00	0.31
7	300502	新易盛	511,437.04	0.26
8	300476	胜宏科技	366,612.00	0.19
9	301308	江波龙	329,898.00	0.17
10	300274	阳光电源	299,872.00	0.15
11	300395	菲利华	276,560.00	0.14
12	300527	ST应急	268,042.17	0.14
13	300620	光库科技	267,858.00	0.14
14	300776	帝尔激光	258,510.00	0.13
15	300014	亿纬锂能	249,053.44	0.13
16	300498	温氏股份	244,267.00	0.12
17	300972	万辰集团	237,146.00	0.12
18	300408	三环集团	228,932.00	0.12
19	300593	新雷能	225,239.10	0.11
20	301602	超研股份	223,496.80	0.11

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。

8.4.3 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	34,673,334.14
卖出股票收入（成交）总额	33,315,470.91

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 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。

8.11 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	45,580.65
2	应收清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	45,580.65

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 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。

8.12.5.2 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	301656	联合动力	24,008.78	0.02	新股流通受限
2	001280	中国铀业	23,768.64	0.02	新股流通受限
3	301563	云汉芯城	14,705.90	0.01	新股流通受限
4	301584	建发致新	11,210.76	0.01	新股流通受限
5	301609	山大电力	9,099.78	0.01	新股流通受限

8.12.6 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		联接基金	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
1,271	95,788.44	5,077,978.00	4.17%	23,152,731.00	19.02%	93,516,404.00	76.81%

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	中信建投证券股份有限公司	2,418,614.00	1.99%
2	余河	2,030,400.00	1.67%
3	中信证券股份有限公司	1,576,148.00	1.29%
4	广发证券股份有限公司	1,080,616.00	0.89%
5	杨晓兰	1,000,097.00	0.82%
6	潘奔奔	690,200.00	0.57%
7	江泓	550,000.00	0.45%
8	胡国锋	496,125.00	0.41%
9	史纪放	381,100.00	0.31%
10	赵银笑	329,900.00	0.27%
-	国泰海通证券股份有限公司—天弘创业板300交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金	93,516,404.00	76.81%

注：持有人为场内持有人。前十名持有人为除天弘创业板300交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金之外的前十名持有人。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2021年05月11日)基金份额总额	321,747,113.00
本报告期期初基金份额总额	241,747,113.00
本报告期基金总申购份额	70,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	190,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	121,747,113.00

§11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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，迟哲先生担任公司副总经理、首席信息官，刘荣逵先生不再担任公司首席信息官，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，本基金的基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期内，未发生涉及基金托管业务的诉讼。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金应向毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）支付服务费40,000.00元。截至本报告期末，毕马威华振会计师事务所（特殊普通合伙）已为本基金提供审计服务1年4个月。

11.6 管理人、托管人及相关从业人员受调查或处罚等情况

11.6.1 管理人受调查或处罚等情况

本报告期内，本基金管理人无受调查或处罚等情况。

11.6.2 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。

11.6.3 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。

11.6.4 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
东方财富证券	2	-	-	-	-	-
东方证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	5	9,607,528.72	14.37%	1,997.21	14.37%	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	3	-	-	-	-	-
国盛证券	2	-	-	-	-	-
国泰海通证券	10	39,202,025.65	58.63%	8,150.85	58.63%	-

国投证券	3	16,836,738.56	25.18%	3,500.48	25.18%	-
华鑫证券	1	-	-	-	-	-
江海证券	2	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
平安证券	2	-	-	-	-	-
首创证券	2	-	-	-	-	-
西部证券	1	-	-	-	-	-
信达证券	1	-	-	-	-	-
中国银河证券	2	-	-	-	-	-
中国中金财富证券	1	-	-	-	-	-
中金公司	2	-	-	-	-	-
中信建投证券	2	-	-	-	-	-
中信证券	2	1,220,908.45	1.83%	253.89	1.83%	-

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：国投证券上海交易单元1个，国投证券深圳交易单元1个，中金公司上海交易单元1个，中信证券上海交易单元1个，中信证券深圳交易单元1个。

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

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
东方财富证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	34,398.00	17.82%	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰海通证券	158,609.87	82.18%	-	-	-	-	-	-
国投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华鑫证券	-	-	-	-	-	-	-	-
江海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中国银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中国中金财富证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信证券	-	-	-	-	-	-	-	-

11.8 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	天弘创业板300交易型开放式指数证券投资基金2024年第4季度报告	中国证监会规定媒介	2025-01-22
2	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金新增申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会规定媒介	2025-01-24
3	天弘基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告	中国证监会规定媒介	2025-02-26
4	天弘创业板300交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会规定媒介	2025-03-08
5	天弘基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告	中国证监会规定媒介	2025-03-28
6	天弘创业板300交易型开放式指数证券投资基金2024年年度报告	中国证监会规定媒介	2025-03-31
7	天弘基金管理有限公司旗下公募基金通过证券公司证券交易及佣金支付情况（2024年下半年度）	中国证监会规定媒介	2025-03-31
8	天弘创业板300交易型开放式指数证券投资基金基金合同	中国证监会规定媒介	2025-04-04
9	天弘创业板300交易型开放式指数证券投资基金托管协议	中国证监会规定媒介	2025-04-04
10	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金更新基金托管	中国证监会规定媒介	2025-04-04

	人信息并修改基金合同等法律文件的公告		
11	天弘创业板300交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要（更新）	中国证监会规定媒介	2025-04-09
12	天弘创业板300交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会规定媒介	2025-04-09
13	天弘创业板300交易型开放式指数证券投资基金2025年第1季度报告	中国证监会规定媒介	2025-04-22
14	天弘创业板300交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要（更新）	中国证监会规定媒介	2025-05-12
15	天弘基金管理有限公司关于旗下部分ETF变更场内简称的公告	中国证监会规定媒介	2025-05-12
16	天弘创业板300交易型开放式指数证券投资基金基金产品资料概要（更新）	中国证监会规定媒介	2025-06-27
17	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金新增申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会规定媒介	2025-07-09
18	天弘创业板300交易型开放式指数证券投资基金2025年第2季度报告	中国证监会规定媒介	2025-07-21
19	天弘基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告	中国证监会规定媒介	2025-07-25
20	天弘基金管理有限公司关于天弘创业板300交易型开放式指数证券投资基金新增申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会规定媒介	2025-08-26

21	天弘创业板300交易型开放式指数证券投资基金2025年中期报告	中国证监会规定媒介	2025-08-29
22	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金新增申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会规定媒介	2025-09-01
23	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金新增申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会规定媒介	2025-09-10
24	天弘基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告	中国证监会规定媒介	2025-09-19
25	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	2025-09-20
26	天弘基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告	中国证监会规定媒介	2025-10-18
27	天弘创业板300交易型开放式指数证券投资基金2025年第3季度报告	中国证监会规定媒介	2025-10-28
28	天弘基金管理有限公司关于终止方正中期期货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	2025-11-18
29	天弘基金管理有限公司关于旗下基金关联交易事项的公告	中国证监会规定媒介	2025-11-20
30	天弘基金管理有限公司关于变更客户服务电话号码的公告	中国证监会规定媒介	2025-11-28
31	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金新增申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会规定媒介	2025-12-25

32	天弘基金管理有限公司关于住所变更的公告	中国证监会规定媒介	2025-12-30

§12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
联接基金	1	20250101-20251231	162,378,200.00	67,302,804.00	136,164,600.00	93,516,404.00	76.81%

产品特有风险

基金管理人秉承谨慎勤勉、独立决策、规范运作、充分披露原则，公平对待投资者，保障投资者合法权益。当单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%时，由此可能导致的特有风险主要包括：

（1）超出基金管理人允许的单一投资者持有基金份额比例的申购申请不被确认的风险；

（2）极端市场环境下投资者集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对赎回申请的风险；

（3）持有基金份额占比较高的投资者大额赎回可能引发基金净值大幅波动的风险；

（4）持有基金份额占比较高的投资者在召开基金份额持有人大会并对重大事项进行投票表决时，可能拥有较大话语权；

（5）极端情况下，持有基金份额占比较高的投资者大量赎回后，可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平，面临转换基金运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等风险。

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

2、份额占比精度处理方式为四舍五入。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，基金管理人决定自2025年12月1日起启用新客户服务电话号码400-986-8888。原客户服务电话号码95046自2026年1月1日起正式停用。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变更客户服务电话号码的公告》。

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

§13 备查文件目录

13.1 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

13.2 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

13.3 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

二〇二六年三月三十一日