

天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金
(原天弘沪深300指数型发起式证券投资基金转型)

2019年第4季度报告

2019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:招商证券股份有限公司

报告送出日期:2020年01月20日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2020年01月16日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

2019年12月09日天弘沪深300指数型发起式证券投资基金正式更名为“天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金”。原天弘沪深300指数型发起式证券投资基金本报告期自2019年10月01日起至2019年12月08日止，天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金本报告期自2019年12月09日起至2019年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

2.1 基金基本情况(转型后)

基金简称	天弘沪深300ETF联接
基金主代码	000961
基金运作方式	契约型开放式
基金转型日	2019年12月09日
报告期末基金份额总额	4,177,124,312.31份
投资目标	通过投资于目标ETF，紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为目标ETF的联接基金，目标ETF是采用完全复制法实现对标的指数紧密跟踪的全被动指数基金。 本基金通过把全部或接近全部的基金资产投资于目标ETF、标的指数成份股和备选成份股进行被动式指数化投资，实现对业绩比较基准的紧密跟踪。正常情况下，本基金投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%，日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%。如因指数编制规则调整

	或其他因素导致跟踪偏离度和跟踪误差超过上述范围，基金管理人将采取合理措施避免跟踪偏离度、跟踪误差进一步扩大。	
业绩比较基准	沪深300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。	
基金管理人	天弘基金管理有限公司	
基金托管人	招商证券股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	天弘沪深300ETF联接A	天弘沪深300ETF联接C
下属分级基金的交易代码	000961	005918
报告期末下属分级基金的份额总额	1,863,723,542.20份	2,313,400,770.11份

2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	515330
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019-12-05
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2019-12-26
基金管理人名称	天弘基金管理有限公司
基金托管人名称	招商证券股份有限公司

2.1.2 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金力争将日均跟踪偏离度控制在0.2%以内，年化跟踪误差控制在2%以内。
投资策略	本基金主要采取完全复制策略，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况（如流动性不足、成份股长期停牌、法律法规限制等）导致

	流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。
业绩比较基准	沪深300指数收益率
风险收益特征	本基金属股票型基金，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。

2.1 基金基本情况(转型前)

基金简称	天弘沪深300	
基金主代码	000961	
基金运作方式	契约型开放式、发起式	
基金合同生效日	2015年01月20日	
报告期末基金份额总额	4,672,612,236.44份	
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	本基金采用完全复制标的指数的方法，进行被动指数化投资。股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合复制标的指数，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，以复制和跟踪标的指数。本基金在严格控制基金的日均跟踪偏离度和年跟踪误差的前提下，力争获取与标的指数相似的投资收益。	
业绩比较基准	沪深300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。	
基金管理人	天弘基金管理有限公司	
基金托管人	招商证券股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	天弘沪深300A	天弘沪深300C
下属分级基金的交易代码	000961	005918
报告期末下属分级基金的份额总	2,080,174,792.39份	2,592,437,444.05份

额		
---	--	--

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标(转型后)

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2019年12月09日 - 2019年12月31日)	
	天弘沪深300ETF联接A	天弘沪深300ETF联接C
1. 本期已实现收益	188,974,055.09	207,075,072.30
2. 本期利润	105,189,530.26	115,614,202.85
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0534	0.0476
4. 期末基金资产净值	2,327,310,353.76	2,560,105,901.60
5. 期末基金份额净值	1.2487	1.1066

注：1、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。

2、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。

3、天弘沪深300指数型发起式证券投资基金自2019年12月09日转型为天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金。

3.1 主要财务指标(转型前)

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2019年10月01日 - 2019年12月08日)	
	天弘沪深300A	天弘沪深300C
1. 本期已实现收益	4,499,391.94	3,413,832.22
2. 本期利润	49,614,774.03	44,426,583.78
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0257	0.0213
4. 期末基金资产净值	2,487,455,968.06	2,747,595,513.63
5. 期末基金份额净值	1.1958	1.0599

注：1、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。

2、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。

3、天弘沪深300指数型发起式证券投资基金基金合同于2015年01月20日生效。

3.2 基金净值表现(转型后)

3.2.1 本报告期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

天弘沪深300ETF联接A净值表现

阶段	净值增长率①	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
自基金转型日起至今(2019年12月09日-2019年12月31日)	4.42%	0.74%	4.73%	0.75%	-0.31%	-0.01%

天弘沪深300ETF联接C净值表现

阶段	净值增长率①	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
自基金转型日起至今(2019年12月09日-2019年12月31日)	4.41%	0.74%	4.73%	0.75%	-0.32%	-0.01%

3.2.2 自基金转型以来基金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

天弘沪深300ETF联接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



天弘沪深300ETF联接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



注：天弘沪深 300 指数型发起式证券投资基金自 2019 年 12 月 09 日转型为天弘沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金。

3.2 基金净值表现(转型前)

3.2.1 本报告期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

天弘沪深300A净值表现

阶段	净值增长率①	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(2019年10月01日-2019年12月08日)	2.11%	0.67%	2.20%	0.67%	-0.09%	0.00

天弘沪深300C净值表现

阶段	净值增长率①	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(2019年10月01日-2019年12月08日)	2.07%	0.67%	2.20%	0.67%	-0.13%	0.00

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

天弘沪深300A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2015年01月20日-2019年12月08日)



天弘沪深300C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



注：1、天弘沪深 300 指数型发起式证券投资基金合同于 2015 年 01 月 20 日生效。
2、本报告期内，本基金的各项投资比例达到基金合同约定的各项比例要求。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张子法	本基金基金经理。	2019年12月	-	17年	男，软件工程硕士。历任华夏基金管理有限公司金融工程师量化研究员。2014年3月加盟本公司，历任股票研究员、基金经理助理。
陈瑶	本基金基金经理。	2019年12月	-	8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。
杨超	本基金基金经理；指数与数量投资部副总经理。	2019年12月	-	9年	男，金融数学与计算硕士学位。历任建信基金管理有限责任公司基金经理助理，泰达宏利基金管理有限责任公司基金经理。2019年1月加盟本公司。

注：1、上述任职日期根据本基金管理人对外披露的任职日期填写。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

4.3 公平交易专项说明

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

为规范投资行为，公平对待投资组合，制定《异常交易监控和报告办法》对可能显著影响市场价格、可能导致不公平交易、可能涉嫌利益输送等交易行为异常和交易价格异常的情形进行界定，拟定相应的监控、分析和防控措施。

本报告期内，严格控制同一基金或不同基金组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易；针对非公开发行股票申购、以公司名义

进行的债券一级市场申购的申购方案和分配过程进行审核和监控，保证分配结果符合公平交易原则。未发现本基金存在异常交易行为。

本基金本报告期内未发生同一基金或不同基金组合之间在同一交易日内进行反向交易及其他可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

本报告期，本基金由原天弘沪深300指数型发起式证券投资基金正式转型成为天弘沪深300ETF联接基金。截至本报告期末，本基金主要持有天弘沪深300ETF及指数成分股，仍采用被动复制策略，其跟踪效果与直接持有指数成分股的效果一致。

报告期内本基金秉承合规第一、风控第一的原则，在运作过程中严格遵守基金合同，对指数基金采取被动复制的方式跟踪指数，保证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。出于基金充分投资、减少交易成本、降低跟踪误差的需要，基于谨慎原则报告期内本基金运用股指期货工具对基金投资组合进行管理，以应对大额申购时巨额资金在途不可用等特殊情形。根据风险管理的原则，本基金在报告期内运用股指期货工具旨在提高投资效率，控制基金投资组合风险水平，力求更好地实现本基金的投资目标。

报告期内，本基金跟踪误差的来源主要是申购赎回、成分股调整以及成分股停牌因素。当由于申赎变动、成分股调整、成分股停牌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。报告期内，本基金整体运行平稳。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2019年12月08日（2019年10月01日至2019年12月08日），天弘沪深300A基金份额净值为1.1958元，天弘沪深300C基金份额净值为1.0599元。报告期内份额净值增长率天弘沪深300A为2.11%，天弘沪深300C为2.07%，同期业绩比较基准增长率均为2.20%。

截至2019年12月31日（2019年12月09日至2019年12月31日），天弘沪深300ETF联接A基金份额净值为1.2487元，天弘沪深300ETF联接C基金份额净值为1.1066元。报告期内份额净值增长率天弘沪深300ETF联接A为4.42%，天弘沪深300ETF联接C为4.41%，同期业绩比较基准增长率均为4.73%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内本基金管理人无应说明预警信息。

§ 5 投资组合报告(转型后)

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
----	----	-------	------------------

1	权益投资	221,364,350.80	4.31
	其中：股票	221,364,350.80	4.31
2	基金投资	4,307,193,686.66	83.93
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	499,259,462.89	9.73
8	其他资产	103,772,017.11	2.02
9	合计	5,131,589,517.46	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	3,634,903.36	0.07
B	采矿业	6,107,461.63	0.12
C	制造业	98,139,213.48	2.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,802,547.16	0.10
E	建筑业	5,203,133.74	0.11
F	批发和零售业	2,430,162.78	0.05
G	交通运输、仓储和邮政业	6,056,511.93	0.12
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	7,592,873.17	0.16
J	金融业	69,189,190.78	1.42
K	房地产业	10,386,738.62	0.21
L	租赁和商务服务业	2,809,439.40	0.06
M	科学研究和技术服务业	1,056,532.00	0.02
N	水利、环境和公共设施管	259,403.20	0.01

	理业		
0	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	219,924.00	0.00
Q	卫生和社会工作	2,222,322.47	0.05
R	文化、体育和娱乐业	1,253,993.08	0.03
S	综合	-	-
	合计	221,364,350.80	4.53

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	601318	中国平安	158,909	13,580,363.14	0.28
2	600519	贵州茅台	7,503	8,876,049.00	0.18
3	000651	格力电器	86,676	5,684,212.08	0.12
4	600036	招商银行	151,244	5,683,749.52	0.12
5	000333	美的集团	87,503	5,097,049.75	0.10
6	000858	五粮液	35,031	4,659,473.31	0.10
7	601166	兴业银行	212,163	4,200,827.40	0.09
8	600276	恒瑞医药	45,201	3,955,991.52	0.08
9	000002	万科A	104,838	3,373,686.84	0.07
10	600030	中信证券	114,655	2,900,771.50	0.06

5.4 报告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。

5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

序号	基金名称	类型	运作方式	管理人	公允价值 (元)	占基金资产 净值比例 (%)
1	天弘沪深300交易型 开放式指数证券投 资基金	股 票 型	交易型 开放式	天弘基金 管理有限 公司	4,307,19 3,686.66	88.13

5.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值(元)	公允价值变动（元）	风险说明
IF200 1	IF200 1	140	172,410,000.0 0	2,999,820.00	-
公允价值变动总额合计（元）					2,999,820. 00
股指期货投资本期收益（元）					430,601.94
股指期货投资本期公允价值变动（元）					2,852,760. 00

5.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本指数基金的股指期货买入套保主要为应对基金组合申购的资金未到位造成基金组合的股票仓位过低的风险，股指期货在买入时总持仓量采用双限制策略，一是限制基金组合中总的股指期货持仓量不能超过向中金所申请并获批的套保总量；二是限制基金组合持有的股指期货合约价值加上基金组合中其他有价证券市值占基金净资产的比例不能超过法规规定的上限，并在股指期货的交易过程中严格遵守基金合同的约束和中金所的规定。根据本基金的基金合同、投资范围、投资目标、投资策略以及对市场走势研判的基础上，结合基金日常的申购赎回情况，制定套期保值交易的合理期限。套期保值的期限一般不超过股指期货当前的最远到期日合约，即次季合约。按照交易月份相近的原则，综合考虑并动态跟踪不同到期日的期货合约的流动性、价差状况和展期风险等因素，选择合适月份的期货合约进行开仓和展期交易来实现远期套保的目的。另外对于交割月的股指期货，通常情况下，最晚在合约交割日进行平仓，尽量避免进行交割。在未来的股指期货交易过程中，本基金将严格遵守《证券投资基金参与股指期货交易指引》，以及中国金融期货交易所颁布的《中国金融期货交易所交易规则》、《中国金融期货交

易所套期保值与套利交易管理办法》等相关规定，以套期保值为主要目的参与股指期货，严格控制交易中的各种风险。

5.11 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。

5.12 投资组合报告附注

5.12.1 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。

5.12.2 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。

5.12.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	20,642,821.11
2	应收证券清算款	33,381,993.98
3	应收股利	-
4	应收利息	151,161.95
5	应收申购款	49,596,040.07
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	103,772,017.11

5.12.4 报告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。

5.12.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.12.6 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。

§ 5 投资组合报告（转型前）

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
----	----	-------	------------------

1	权益投资	4,884,841,914.13	91.85
	其中：股票	4,884,841,914.13	91.85
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	383,334,756.64	7.21
8	其他资产	49,887,430.88	0.94
9	合计	5,318,064,101.65	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	79,140,126.60	1.51
B	采矿业	143,222,649.97	2.74
C	制造业	2,062,307,566.75	39.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	105,717,635.06	2.02
E	建筑业	127,616,806.03	2.44
F	批发和零售业	56,133,594.77	1.07
G	交通运输、仓储和邮政业	134,489,302.24	2.57
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	153,109,604.02	2.92
J	金融业	1,656,830,447.09	31.65
K	房地产业	207,832,762.79	3.97
L	租赁和商务服务业	66,571,769.90	1.27
M	科学研究和技术服务业	10,635,615.00	0.20

N	水利、环境和公共设施管理业	5,314,484.56	0.10
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	32,271,469.68	0.62
R	文化、体育和娱乐业	25,167,932.82	0.48
S	综合	-	-
	合计	4,866,361,767.28	92.96

5.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的股票投资组合

序号	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值的比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	978,690.00	0.02
C	制造业	8,560,957.03	0.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	17,221.60	0.00
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	983,025.00	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	1,908,266.02	0.04
J	金融业	2,949,654.00	0.06
K	房地产业	981,720.00	0.02
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	102,523.20	0.00
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	999,222.00	0.02
Q	卫生和社会工作	998,868.00	0.02

R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	18,480,146.85	0.35

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

5.3.1 报告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前十名股票投资明细

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	601318	中国平安	4,153,138	351,936,914.12	6.72
2	600519	贵州茅台	192,762	225,531,540.00	4.31
3	600036	招商银行	3,953,796	143,957,712.36	2.75
4	000651	格力电器	1,804,476	112,581,257.64	2.15
5	601166	兴业银行	5,574,663	105,528,370.59	2.02
6	000333	美的集团	1,861,114	104,594,606.80	2.00
7	600276	恒瑞医药	1,187,301	103,413,917.10	1.98
8	000858	五粮液	744,019	97,451,608.62	1.86
9	600887	伊利股份	2,337,429	70,707,227.25	1.35
10	600030	中信证券	3,018,055	67,544,070.90	1.29

5.3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	期末公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	603501	韦尔股份	7,100	1,028,790.00	0.02
2	002916	深南电路	6,900	1,000,155.00	0.02
3	002607	中公教育	51,800	999,222.00	0.02
4	300347	泰格医药	15,600	998,868.00	0.02

5	601236	红塔证券	62,800	997,892.00	0.02
---	--------	------	--------	------------	------

5.4 报告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。

5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值(元)	公允价值变动（元）	风险说明
IF1912	IF1912	55	64,353,300.00	147,060.00	-
公允价值变动总额合计（元）					147,060.00
股指期货投资本期收益（元）					4,451,204.25
股指期货投资本期公允价值变动（元）					1,676,439.62

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本指数基金的股指期货买入套保主要为应对基金组合申购的资金未到位造成基金组合的股票仓位过低的风险，股指期货在买入时总持仓量采用双限制策略，一是限制基金组合中总的股指期货持仓量不能超过向中金所申请并获批的套保总量；二是限制基金组合持有的股指期货合约价值加上基金组合中其他有价证券市值占基金净资产的比例不能超过法规规定的上限，并在股指期货的交易过程中严格遵守基金合同的约束和中金所的规定。根据本基金的基金合同、投资范围、投资目标、投资策略以及对市场走势研判的基础上，结合基金日常的申购赎回情况，制定套期保值交易的合理期限。套期保值

的期限一般不超过股指期货当前的最远到期日合约，即次季合约。按照交易月份相近的原则，综合考虑并动态跟踪不同到期日的期货合约的流动性、价差状况和展期风险等因素，选择合适月份的期货合约进行开仓和展期交易来实现远期套保的目的。另外对于交割月的股指期货，通常情况下，最晚在合约交割日进行平仓，尽量避免进行交割。在未来的股指期货交易过程中，本基金将严格遵守《证券投资基金参与股指期货交易指引》，以及中国金融期货交易所颁布的《中国金融期货交易所交易规则》、《中国金融期货交易所套期保值与套利交易管理办法》等相关规定，以套期保值为主要目的参与股指期货，严格控制交易中的各种风险。

5.10 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	8,756,584.11
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,055,625.85
5	应收申购款	40,075,220.92
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	49,887,430.88

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 报告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。

5.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票不存在流通受限情况。

5.11.6 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。

§ 6 开放式基金份额变动(转型后)

单位：份

	天弘沪深300ETF联接A	天弘沪深300ETF联接C
基金转型日(2019年12月09日)基金份额总额	2,080,174,792.39	2,592,437,444.05
基金转型日起至报告期期末基金总申购份额	148,424,398.48	490,182,461.26
减：基金转型日起至报告期期末基金总赎回份额	364,875,648.67	769,219,135.20
基金转型日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	1,863,723,542.20	2,313,400,770.11

注：1、本报告期内，基金管理人根据法律法规及《基金合同》相关规定，已于2019年12月09日起，将天弘沪深300指数型发起式证券投资基金正式转型为天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金。

2、总申购份额含转换转入份额；总赎回份额含转换转出份额。

§ 6 开放式基金份额变动(转型前)

单位：份

	天弘沪深300A	天弘沪深300C
报告期期初基金份额总额	1,872,179,759.27	1,758,757,572.00
报告期期间基金总申购份额	779,860,670.59	1,673,206,542.62
减：报告期期间基金总赎回份额	571,865,637.47	839,526,670.57
报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	2,080,174,792.39	2,592,437,444.05

注：总申购份额含转换转入份额；总赎回份额含转换转出份额。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况(转型后)

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况（转型前）

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

	天弘沪深300A	天弘沪深300C
报告期期初管理人持有的本基金份额	9,190,331.77	11,369,391.79
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	9,190,331.77	11,369,391.79
报告期期末管理人持有的本基金份额	-	-
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	-	-

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额（份）	交易金额（元）	适用费率
1	赎回	2019-10-30	9,190,331.77	-11,010,023.89	-
2	赎回	2019-10-30	11,369,391.79	-12,081,115.72	-
合计			20,559,723.56	-23,091,139.61	

§ 8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况（转型后）

本报告期内，基金管理人根据法律法规及《基金合同》相关规定，已于2019年12月09日起，将天弘沪深300指数型发起式证券投资基金正式转型为天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金。转型后的天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金为非发起式基金。

§ 8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况（转型前）

本基金成立后有10,000,000.00份为发起份额，发起份额承诺的持有期限为2015年01月20日至2018年01月20日。截至本报告期末，发起资金持有份额为0份。

§ 9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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。

9.2 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》相关规定，与基金托管人协商一致，决定自2019年12月09日起，将天弘沪深300指数型发起式证券投资基金变更为天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金。具体信息请参见基金管理人在指定媒介披露的《关于天弘沪深300指数型发起式证券投资基金变更为天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金并相应修订基金合同的公告》。

§ 10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准天弘沪深300指数型发起式证券投资基金募集的文件
- 2、天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同
- 3、天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议
- 4、天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书
- 5、报告期内在指定报刊上披露的各项公告
- 6、中国证监会规定的其他文件

10.2 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

10.3 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
二〇二〇年一月二十日