

# 天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金

## 2020 年年度报告

2020 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:国泰君安证券股份有限公司

送出日期:2021 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。

基金托管人国泰君安证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年03月29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2020年01月01日起至2020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	7
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	9
3.3 过去三年基金的利润分配情况	12
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	15
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	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	17
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	17
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	19
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	19
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	19
§5 托管人报告	19
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	19
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	20
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	20
§6 审计报告	20
6.1 审计报告基本信息	20
6.2 审计报告的基本内容	20
§7 年度财务报表	23
7.1 资产负债表	23
7.2 利润表	25
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	26
7.4 报表附注	28
§8 投资组合报告	63
8.1 期末基金资产组合情况	63
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	64
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	65
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	69
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	73
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 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	73

8.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	73
8.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	73
8.13 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 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	75
9.3 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.....	75
§10 开放式基金份额变动.....	76
§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.....	77
11.4 基金投资策略的改变.....	77
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	77
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	77
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.....	79
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	86
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.....	86
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	86
§13 备查文件目录.....	86
13.1 备查文件目录.....	86
13.2 存放地点.....	86
13.3 查阅方式.....	86

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金	
基金简称	天弘创业板ETF联接基金	
基金主代码	001592	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2015年07月08日	
基金管理人	天弘基金管理有限公司	
基金托管人	国泰君安证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	3,268,916,465.13份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	天弘创业板ETF联接基金A	天弘创业板ETF联接基金C
下属分级基金的交易代码	001592	001593
报告期末下属分级基金的份额总额	920,341,890.08份	2,348,574,575.05份

#### 2.1.1 目标基金基本情况

基金名称	天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金
基金主代码	159977
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019-09-12
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2019-09-27
基金管理人名称	天弘基金管理有限公司
基金托管人名称	国泰君安证券股份有限公司

### 2.2 基金产品说明

投资目标	通过投资于目标ETF,紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差最小化。
投资策略	本基金为目标ETF的联接基金,目标ETF是采用完全复

	制法实现对标的指数紧密跟踪的全被动指数基金。
业绩比较基准	创业板指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为ETF联接基金，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。本基金主要通过投资于目标ETF实现对标的指数的紧密跟踪，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。

### 2.2.1 目标基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金力争将日均跟踪偏离度控制在0.2%以内，年化跟踪误差控制在2%以内。
投资策略	本基金主要采取完全复制策略，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况（如流动性不足、成份股长期停牌、法律法规限制等）导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。
业绩比较基准	创业板指数收益率
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。

### 2.3 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	国泰君安证券股份有限公司
信息披露 姓名	童建林	胡凯

露负责人	联系电话	022-83310208	021-38037354
	电子邮箱	service@thfund.com.cn	hukai@gtjas.com
客户服务电话		95046	021-38917599-5
传真		022-83865569	021-38677819
注册地址		天津自贸区（中心商务区）响螺湾旷世国际大厦A座1704-241号	中国（上海）自由贸易试验区商城路618号
办公地址		天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层	上海市静安区新闻路669号博华广场19楼
邮政编码		300203	200041
法定代表人		胡晓明	贺青

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.thfund.com.cn
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	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	中国上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
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、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	2020年	2019年	2018年
---------	-------	-------	-------

间数据和指标	天弘创业板ETF联接基金A	天弘创业板ETF联接基金C	天弘创业板ETF联接基金A	天弘创业板ETF联接基金C	天弘创业板ETF联接基金A	天弘创业板ETF联接基金C
本期已实现收益	299,626,574.65	626,272,381.96	90,004,929.34	172,107,072.38	-51,684,050.43	-93,100,121.24
本期利润	636,708,985.61	992,244,708.47	281,532,962.34	491,372,449.28	-151,554,893.76	-260,914,801.43
加权平均基金份额本期利润	0.4954	0.3782	0.1938	0.1622	-0.1801	-0.1955
本期加权平均净值利润率	53.54%	40.26%	30.44%	25.87%	-29.70%	-33.52%
本期基金份额净值增长率	62.26%	61.94%	41.17%	40.88%	-25.48%	-25.64%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	2020年末		2019年末		2018年末	
期末可供分配利润	152,529,238.63	348,722,347.20	-392,372,030.08	-622,294,594.59	-613,869,690.00	-1,447,231,523.06
期末可供分配基金份额利润	0.1657	0.1485	-0.2816	-0.2908	-0.4911	-0.4966
期末基金资产净值	1,072,871,128.71	2,697,296,922.25	1,001,086,952.09	1,517,637,216.15	636,226,513.77	1,467,302,656.37
期末基金份额净值	1.1657	1.1485	0.7184	0.7092	0.5089	0.5034
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	2020年末		2019年末		2018年末	
基金份额	16.57%	14.85%	-28.16%	-29.08%	-49.11%	-49.66%



累计净值 增长率						
-------------	--	--	--	--	--	--

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

天弘创业板ETF联接基金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	14.78%	1.53%	14.44%	1.53%	0.34%	0.00%
过去六个月	21.17%	1.78%	20.61%	1.78%	0.56%	0.00%
过去一年	62.26%	1.85%	61.28%	1.86%	0.98%	-0.01%
过去三年	70.70%	1.68%	65.87%	1.70%	4.83%	-0.02%
过去五年	10.26%	1.67%	9.89%	1.66%	0.37%	0.01%
自基金合同 生效日起至 今	16.57%	1.88%	26.34%	1.86%	-9.77%	0.02%

天弘创业板ETF联接基金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	14.72%	1.53%	14.44%	1.53%	0.28%	0.00%
过去六个月	21.06%	1.78%	20.61%	1.78%	0.45%	0.00%
过去一年	61.94%	1.85%	61.28%	1.86%	0.66%	-0.01%

过去三年	69.65%	1.68%	65.87%	1.70%	3.78%	-0.02%
过去五年	8.96%	1.67%	9.89%	1.66%	-0.93%	0.01%
自基金合同生效日起至 今	14.85%	1.88%	26.34%	1.86%	-11.49%	0.02%

### 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

天弘创业板ETF联接基金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



天弘创业板ETF联接基金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  
(2015年07月08日-2020年12月31日)



注：1、本基金合同于2015年07月08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 过去五年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2015年07月08日生效。

### 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、天津、深圳、四川设有分公司。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%

注：2020年7月22日，公司披露了《天弘基金管理有限公司关于股东名称变更的公告》。

截至2020年12月31日，本基金管理人共管理93只基金：天弘精选混合型证券投资基金、天弘永利债券型证券投资基金、天弘永定价值成长混合型证券投资基金、天弘周期策略混合型证券投资基金、天弘文化新兴产业股票型证券投资基金、天弘添利债券型证券投资基金（LOF）、天弘丰利债券型证券投资基金（LOF）、天弘现金管家货币市场基金、天弘债券型发起式证券投资基金、天弘安康颐养混合型证券投资基金、天弘余额宝货币市场基金、天弘稳利定期开放债券型证券投资基金、天弘弘利债券型证券投资基金、天弘通利混合型证券投资基金、天弘同利债券型证券投资基金（LOF）、天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金、天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金（原天弘中证500指数型发起式证券投资基金）、天弘云端生活优选灵活配置混合型证券投资基金、天弘新活力灵活配置混合型发起式证券投资基金、天弘互联网灵活配置混合型证券投资基金、天弘惠利灵活配置混合型证券投资基金、天弘新价值灵活配置混合型证券投资基金、天弘云商宝货币市场基金、天弘医疗健康混合型证券投资基金、天弘中证医药100指数型发起式证券投资基金、天弘中证500指数增强型证券投资基金、天弘中证证券保险指数型发起式证券投资基金、天弘中证银行交易型开放式指数证券投资基金联接基金（原天弘中证银行指数型发起式证券投资基金）、天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金、天弘上证50指数型发起式证券投资基金、天弘中证800指数型发起式证券投资基金、天弘中证电子交易型开放式指数证券投资基金联接基金（原天弘中证电子指数型发起式证券投资基金）、天弘中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金（原天弘中证计算机主题指数型发起式证券投资基金）、天弘中证食品饮料指数型发起式证券投资基金、天弘弘运宝货币市场基金、天弘裕利灵活配置混合型证券投资基金、天弘价值精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、天弘信利债券型证券投资基金、天弘策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、天弘优

选债券型证券投资基金、天弘尊享定期开放债券型发起式证券投资基金、天弘悦享定期开放债券型发起式证券投资基金、天弘荣享定期开放债券型发起式证券投资基金、天弘穗利一年定期开放债券型证券投资基金、天弘弘丰增强回报债券型证券投资基金、天弘港股通精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、天弘增强回报债券型证券投资基金、天弘安益债券型证券投资基金、天弘华享三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、天弘弘择短债债券型证券投资基金、天弘信益债券型证券投资基金、天弘养老目标日期2035三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、天弘弘新混合型发起式证券投资基金、天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金、天弘标普500发起式证券投资基金（QDII-FOF）、天弘优质成长企业精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、天弘鑫利三年定期开放债券型证券投资基金、天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金、天弘中证红利低波动100指数型发起式证券投资基金、天弘季季兴三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、天弘中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金、天弘沪深300指数增强型发起式证券投资基金、天弘越南市场股票型发起式证券投资基金（QDII）、天弘中证电子交易型开放式指数证券投资基金、天弘中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金、天弘增利短债债券型发起式证券投资基金、天弘恒享一年定期开放债券型发起式证券投资基金、天弘纯享一年定期开放债券型发起式证券投资基金、天弘中债1-3年国开行债券指数发起式证券投资基金、天弘永裕稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、天弘鑫意39个月定期开放债券型证券投资基金、天弘兴享一年定期开放债券型发起式证券投资基金、天弘中证中美互联网指数型发起式证券投资基金（QDII）、天弘中债3-5年政策性金融债指数发起式证券投资基金、天弘成享一年定期开放债券型证券投资基金、天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金、天弘永裕平衡养老目标三年持有期混合型基金中基金（FOF）、天弘甄选食品饮料股票型发起式证券投资基金、天弘创新领航混合型证券投资基金、天弘聚新三个月定期开放混合型证券投资基金、天弘荣创一年持有期混合型证券投资基金、天弘智荟6个月持有期债券型证券投资基金、天弘中证科技100指数增强型发起式证券投资基金、天弘多元收益债券型证券投资基金、天弘多利一年定期开放混合型证券投资基金、天弘安利短债债券型证券投资基金、天弘安康颐和混合型证券投资基金、天弘合益债券型发起式证券投资基金、天弘中证银行交易型开放式指数证券投资基金、天弘国证消费100指数增强型发起式证券投资基金、天弘医药创新混合型证券投资基金、天弘睿新三个月定期开放混合型证券投资基金、天弘庆享债券型发起式证券投资基金。

#### 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	说明

		任职日期	离任日期	业年限	
杨超	本基金基金经理；指数与数量投资部副总经理和智能投资部副总经理。	2019年09月	-	10年	男，金融数学与计算硕士。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公司基金经理。2019年1月加盟本公司。
张子法	本基金基金经理。	2019年09月	-	13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。

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。

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，通过交易系统内的公平交易程序，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

本基金本报告期内不存在异常交易行为。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44次，投资组合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易，未导致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

截至本报告期末，本基金主要持有天弘创业板ETF及少量创业板指数成分股，其中股票配置采用被动复制策略和基于风险控制的组合优化策略，本基金总体跟踪效果与直接持有指数成分股的效果保持一致。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2020年12月31日，天弘创业板ETF联接基金A基金份额净值为1.1657元，天弘创业板ETF联接基金C基金份额净值为1.1485元。报告期内份额净值增长率天弘创业板ETF



联接基金A为62.26%，同期业绩比较基准增长率为61.28%；天弘创业板ETF联接基金C为61.94%，同期业绩比较基准增长率为61.28%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2021年将是全球经济在遭遇新冠疫情严重破坏后的恢复之年，但经济恢复的速度和节奏与全球疫情防控的效果高度相关，并带有很大的不确定性，明年世界经济形势仍然复杂严峻，复苏不稳定也不平衡，疫情冲击导致的各类衍生风险不容忽视。但国内经济恢复向好趋势延续，PMI景气指标和集装箱运价、乘用车销量等高频数据都显示经济仍保持高景气，交通出行、场景消费可能还会受到影响，对经济恢复形成一定的阻力，局部疫情风险不容忽视，经济复苏的基础尚不稳固，预计2021年通胀总体较为温和，M2和社融增速与名义GDP增速基本匹配，宏观政策的态势或呈现“紧信用、松货币、宽财政”的组合，近期货币政策边际收紧也是在此前较为宽松基础上的适度中性回归，不会发生急转弯。同时，对标国际高水平 and 互利共赢的中欧投资协定谈判如期完成，其他双边和多边贸易协议也在积极推进之中，由于疫情控制的好中国经济明显先于全球其他主要经济体的复苏，机构普遍预计明年实际GDP增速或在8-9%之间，名义GDP增速或约为10%。

基于对2021年经济的良好预期以及未来经济高质量发展的时代需要，更大力度的改革和创新的措施会不断推出，相信从重大冲击中走出来的国内经济将更加稳健和高效，我们对明年的资本市场不悲观。在行业方面，中央经济工作会议将科技工作列为明年首要任务并强调要以推动高质量发展为主题，强化科技战略支撑，扩大高水平对外开放，预计在科技创新增强产业链供应链自主可控能力、调整优化能源结构方面可能出台相关的政策措施，我们认为科技和新能源仍或将是2021年景气度较高和持续性较强的行业，同时也需要继续关注可能全球疫情防控大大超期情况下的生物医药行业的投资机会。创业板最主要的三个组成部分科技、医药、新能源行业都具有很高的景气特征，尽管可能波动较大，但创业板未来的市场表现仍然值得期待。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人的监察稽核工作一切从合规运作、防范和控制风险、保障基金份额持有人利益出发，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、合规性进行定期和不定期监督和检查。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。公司经理层面成立了风险管理委员会，根据公司总体风险控制目标，分配各业务和各环节风险控制目标和要求；落实公司重大风险管理的决定或决议；听取并讨论会议成员的报告；对会议成员提出的或发现的已经存在的风险点，在充分讨论、协调基础上形成具体的风险控制措施；对潜在风险点分析讨论，拟定应对措施；

对发生的风险事件和重大差错，分析原因、总结经验教训、风险定级、划分责任，向总经理办公会报告。

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。本基金管理人已通过了 ISAE3402（《国际鉴证业务准则第3402号》）认证，获得无保留意见的控制设计适当性报告。

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、在研究环节，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，跟踪检查投资备选库的入选、维护依据；进一步规范新股、新债询价、申购流程；定期检查关联方关系以及关联交易的日常维护；定期评估研究对投资的支持程度，对投资业绩的贡献度；

2、在投资交易环节，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、投资决策委员会的决定，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、邮件及合规提示及时提醒，保障投资环节的合规运作；监督检查各投资组合新股申购、一级债申购、银行间交易等场外交易的合规执行情况，保证各投资组合场外交易的事中合规控制；

3、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，监督投资管理人员直系亲属账户及股票交易申报制度、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老鼠仓、非公平交易及各种形式的利益输送行为；

4、基金募集与营销环节，对基金宣传推介材料及定投、费率优惠等基金销售业务活动进行事前合规检查，做到事前防范风险，保障基金营销合法合规。在基金利用互联网平台营销方面，对各类新兴业务的活动方案进行事前合规评估，保证业务开展的同时注重事前风险防范；

5、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；

6、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以合规运作、防范和控制风险、保障基金份额持有人利益出发，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。估值委员会由公司分管固定收益投资的高级管理人员、督察长、分管估值业务的IT运维总监、投资研究部负责人组成。

公司基金估值委员会下设基金估值工作小组，由具备丰富专业知识、两年以上基金行业相关领域工作经历、熟悉基金投资品种定价及基金估值法律法规、具备较强专业胜任能力的基金经理、基金会计、风险管理人员及内控合规人员组成。

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

## 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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认真的复核，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	普华永道中天审字(2021)第23175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	天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金全体基金份额持有人
审计意见	（一）我们审计的内容 我们审计了天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金（以下简称“天弘创业板ETF联接基金”）的财务报表，包括2020年12月31日的资产负债表，2020年度的利润表和所有者权益（基金净值）变动表以及财务报表附注。（二）我们的意见 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注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”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了天弘创业板ETF联接基金2020年12月31日的财务状况以及2020年度的经营成果和基金净值变动情况。
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。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。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于天弘创业板ETF联接基金,并履行了职业道德方面的其他责任。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	无
管理层和治理层对财务报表的责任	天弘创业板ETF联接基金的基金管理人天弘基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,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,基金管理人管理层负责评估天弘创业板ETF联接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,除非基金管理人管理层计划清算天弘创业板ETF联接基金、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督天弘创业板ETF联接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：（一）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。（二）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。（三）评价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。（四）对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，就可能对天弘创业板ETF联接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天弘创业板ETF联接基金不能持续经营。（五）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	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	张振波、林佳璐
会计师事务所的地址	中国上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
审计报告日期	2021-03-26

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金

报告截止日：2020年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	207,903,316.36	139,473,194.97
结算备付金		7,899,874.45	3,203,747.14
存出保证金		6,261,623.47	2,484,723.89
交易性金融资产	7.4.7.2	3,581,740,606.12	2,391,141,557.32
其中：股票投资		43,639,680.47	8,884,455.81
基金投资		3,538,088,125.65	2,382,257,101.51
债券投资		12,800.00	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		129,282,666.03	21,752,254.91
应收利息	7.4.7.5	123,454.65	72,481.97
应收股利		-	-
应收申购款		14,633,941.88	11,612,279.16
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-

资产总计		3,947,845,482.96	2,569,740,239.36
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020年12月31日</b>	<b>上年度末 2019年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
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		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		175,259,918.26	49,855,697.45
应付管理人报酬		122,947.86	71,816.03
应付托管费		24,589.55	14,363.20
应付销售服务费		520,748.16	273,208.64
应付交易费用	7.4.7.7	1,509,810.00	439,010.33
应交税费		-	152,535.18
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	239,418.17	209,440.29
负债合计		177,677,432.00	51,016,071.12
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7.4.7.9	3,268,916,465.13	3,533,390,792.91
未分配利润	7.4.7.10	501,251,585.83	-1,014,666,624.67
所有者权益合计		3,770,168,050.96	2,518,724,168.24
负债和所有者权益总计		3,947,845,482.96	2,569,740,239.36

注：报告截止日2020年12月31日，天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金A类基金份额净值1.1657元，天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金C类基金份额净值1.1485元；基金份额总额3,268,916,465.13份，其中天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金A类基金份额920,341,890.08份，天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金C类基金份额2,348,574,575.05份。



## 7.2 利润表

会计主体：天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2020年01月01日至2020年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2020年01月01日至2020年12月31日	上年度可比期间2019年01月01日至2019年12月31日
一、收入		1,646,965,396.48	798,248,947.29
1. 利息收入		4,031,392.52	3,223,671.42
其中：存款利息收入	7.4.7.11	4,031,386.11	3,223,671.42
债券利息收入		6.41	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		932,715,836.57	280,270,065.76
其中：股票投资收益	7.4.7.12	45,119,035.22	229,542,947.54
基金投资收益	7.4.7.13	887,303,375.60	33,822,213.45
债券投资收益	7.4.7.14	2,477.26	-
资产支持证券投资	7.4.7.14.	-	-
收益	3	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-	-
股利收益	7.4.7.17	290,948.49	16,904,904.77
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	703,054,737.47	510,793,409.90
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”	7.4.7.19	7,163,429.92	3,961,800.21

号填列)			
<b>减：二、费用</b>		18,011,702.40	25,343,535.67
1. 管理人报酬		1,445,968.16	10,712,839.31
2. 托管费		289,193.67	2,142,567.79
3. 销售服务费		4,884,530.62	3,771,683.20
4. 交易费用	7.4.7.20	11,143,259.58	8,071,295.49
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		28,750.37	52,277.57
7. 其他费用	7.4.7.21	220,000.00	592,872.31
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		1,628,953,694.08	772,905,411.62
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		1,628,953,694.08	772,905,411.62

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金

本报告期：2020年01月01日至2020年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2020年01月01日至2020年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	3,533,390,792.91	-1,014,666,624.67	2,518,724,168.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,628,953,694.08	1,628,953,694.08
三、本期基金份额交易产生的基金	-264,474,327.78	-113,035,483.58	-377,509,811.36

净值变动数（净值减少以“-”号填列）			
其中：1. 基金申购款	15,835,144,221.94	-1,045,411,980.74	14,789,732,241.20
2. 基金赎回款	-16,099,618,549.72	932,376,497.16	-15,167,242,052.56
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	3,268,916,465.13	501,251,585.83	3,770,168,050.96
项 目	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	4,164,630,383.20	-2,061,101,213.06	2,103,529,170.14
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	772,905,411.62	772,905,411.62
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-631,239,590.29	273,529,176.77	-357,710,413.52
其中：1. 基金申购款	16,444,022,254.88	-6,024,602,955.97	10,419,419,298.91
2. 基金赎回款	-17,075,261,845.17	6,298,132,132.74	-10,777,129,712.43
四、本期向基金份额	-	-	-

额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）			
五、期末所有者权益（基金净值）	3,533,390,792.91	-1,014,666,624.67	2,518,724,168.24

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：

郭树强

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

天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金系由原天弘创业板指数型发起式证券投资基金(以下简称“原基金”)转型而来。本基金的基金管理人为天弘基金管理有限公司，基金托管人为国泰君安证券股份有限公司。

根据基金管理人天弘基金管理有限公司于2019年9月13日发布《关于天弘创业板指数型发起式证券投资基金变更为天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金并相应修订基金合同的公告》，原天弘创业板指数型发起式证券投资基金变更为天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金《天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》及其他法律文件自2019年9月13日起生效，原《天弘创业板指数型发起式证券投资基金基金合同》同日起失效。

根据《天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》和《天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书》的有关规定，本基金根据认购/申购费用、销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资人认购/申购时收取前端认购/申购费用，并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为A类基金份额；在投资人认购/申购时不收取认购/申购费用，而从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为C类基金份额。基金A类和C类基金份额分别设置代码两种收费模式并存，由于基金费用的不同，本基金A类基金份额及C类基金份额分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

本基金为天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“目标ETF”)的联接基金。目标ETF是采用完全复制法实现对创业板指数紧密跟踪的被动指数基金，本基金

主要通过投资于目标ETF实现对业绩比较基准的紧密跟踪，力争净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.35%，年跟踪误差不超过4%。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为以标的指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。为更好地实现投资目标，本基金还可以投资于其他股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包含国债、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）。本基金投资于标的指数的成份股及其备选成份股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%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于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。本基金的业绩比较基准：创业板指数收益率 $\times$ 95%+银行活期存款利率（税后） $\times$ 5%。

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2021年3月26日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《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〉》、中国证券投资基金业协会（以下简称“中国基金业协会”）颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2020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2020年12月31日的财务状况以及2020年度的经营成果和基金净值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

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券投资 and 衍生工具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。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

##### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债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。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

#### 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

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 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；或者(3) 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。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、基金投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应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，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，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金融工具价格的重大事件，应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基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。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认列。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基金净值比例计算的金额。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基金净值比例计算的金额。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

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。基金投资在持有期间应取得的红利于除权日确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

其他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

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。



经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 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

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，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《中国证监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。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[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》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和可交换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和可交换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

#### 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

根据财政部、国家税务总局财税[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[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《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《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《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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。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，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对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。

(3) 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。对基金从上市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。

(4) 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。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
活期存款	207,903,316.36	139,473,194.97
定期存款	-	-
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	-	-
合计	207,903,316.36	139,473,194.97

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末2020年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	41,849,871.39	43,639,680.47	1,789,809.08
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	12,800.00	12,800.00
	银行间市场	-	-
	合计	12,800.00	12,800.00
资产支持证券	-	-	-
基金	2,639,900,464.31	3,538,088,125.65	898,187,661.34

其他	-	-	-
合计	2,681,763,135.70	3,581,740,606.12	899,977,470.42
项目	上年度末2019年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	8,648,481.08	8,884,455.81	235,974.73
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	2,185,570,343.29	2,382,257,101.51	196,686,758.22
其他	-	-	-
合计	2,194,218,824.37	2,391,141,557.32	196,922,732.95

#### 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 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
应收活期存款利息	116,400.96	69,666.19
应收定期存款利息	-	-
应收其他存款利息	-	-

应收结算备付金利息	3,952.82	1,585.87
应收债券利息	1.40	-
应收资产支持证券利息	-	-
应收买入返售证券利息	-	-
应收申购款利息	-	-
应收黄金合约拆借孳息	-	-
应收出借证券利息	-	-
其他	3,099.47	1,229.91
合计	123,454.65	72,481.97

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
交易所市场应付交易费用	1,509,810.00	439,010.33
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	1,509,810.00	439,010.33

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	19,418.17	9,440.29
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	220,000.00	200,000.00
合计	239,418.17	209,440.29

#### 7.4.7.9 实收基金

## 7.4.7.9.1 天弘创业板ETF联接基金A

金额单位：人民币元

项目 (天弘创业板ETF联接基金A)	本期2020年01月01日至2020年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	1,393,458,982.17	1,393,458,982.17
本期申购	2,817,908,081.05	2,817,908,081.05
本期赎回(以“-”号填列)	-3,291,025,173.14	-3,291,025,173.14
本期末	920,341,890.08	920,341,890.08

## 7.4.7.9.2 天弘创业板ETF联接基金C

金额单位：人民币元

项目 (天弘创业板ETF联接基金C)	本期2020年01月01日至2020年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	2,139,931,810.74	2,139,931,810.74
本期申购	13,017,236,140.89	13,017,236,140.89
本期赎回(以“-”号填列)	-12,808,593,376.58	-12,808,593,376.58
本期末	2,348,574,575.05	2,348,574,575.05

注：申购含转换转入份额；赎回含转换转出份额。

## 7.4.7.10 未分配利润

## 7.4.7.10.1 天弘创业板ETF联接基金A

单位：人民币元

项目 (天弘创业板ETF联接基金A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-2,060,055.49	-390,311,974.59	-392,372,030.08
本期利润	299,626,574.65	337,082,410.96	636,708,985.61
本期基金份额交易产生的变动数	-69,826,558.53	-21,981,158.37	-91,807,716.90
其中：基金申购款	162,198,977.33	-445,533,685.39	-283,334,708.06
基金赎回款	-232,025,535.86	423,552,527.02	191,526,991.16
本期已分配利润	-	-	-

本期末	227,739,960.63	-75,210,722.00	152,529,238.63
-----	----------------	----------------	----------------

## 7.4.7.10.2 天弘创业板ETF联接基金C

单位：人民币元

项目 (天弘创业板ETF联接基金C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-24,962,756.46	-597,331,838.13	-622,294,594.59
本期利润	626,272,381.96	365,972,326.51	992,244,708.47
本期基金份额交易产生的变动数	-56,652,383.29	35,424,616.61	-21,227,766.68
其中：基金申购款	922,081,831.66	-1,684,159,104.34	-762,077,272.68
基金赎回款	-978,734,214.95	1,719,583,720.95	740,849,506.00
本期已分配利润	-	-	-
本期末	544,657,242.21	-195,934,895.01	348,722,347.20

## 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2020年01月01日至2020年12月31日	上年度可比期间2019年01月01日至2019年12月31日
活期存款利息收入	3,899,414.95	3,099,280.45
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	64,257.31	68,345.24
其他	67,713.85	56,045.73
合计	4,031,386.11	3,223,671.42

## 7.4.7.12 股票投资收益

## 7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期2020年01月01	上年度可比期间2019年0
----	--------------	---------------

	日至2020年12月31 日	1月01日至2019年12月31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	51,606,555.96	51,467,763.84
股票投资收益——赎回差价收入	-	-
股票投资收益——申购差价收入	-6,487,520.74	178,075,183.70
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	45,119,035.22	229,542,947.54

#### 7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年 12月31日
卖出股票成交总额	5,634,056,203.59	4,004,083,092.09
减：卖出股票成本总额	5,582,449,647.63	3,952,615,328.25
买卖股票差价收入	51,606,555.96	51,467,763.84

#### 7.4.7.12.3 股票投资收益——申购差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年 12月31日
申购基金份额总额	3,454,831,900.00	2,719,882,400.00
减：现金支付申购款总额	-12,268,829.62	18,027,784.94
减：申购股票成本总额	3,473,588,250.36	2,523,779,431.36
申购差价收入	-6,487,520.74	178,075,183.70

#### 7.4.7.13 基金投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年 12月31日
----	-----------------------------------	--



卖出/赎回基金成交总额	4,318,532,458.53	780,255,049.70
减：卖出/赎回基金成本总额	3,431,229,082.93	746,432,836.25
基金投资收益	887,303,375.60	33,822,213.45

#### 7.4.7.14 债券投资收益

##### 7.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年 12月31日
债券投资收益——买卖债券 (、债转股及债券到期兑付) 差价收入	2,477.26	-
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	2,477.26	-

##### 7.4.7.14.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年12月 31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年12月 31日
卖出债券(、债转 股及债券到期兑 付)成交总额	16,082.27	-
减：卖出债券(、 债转股及债券到 期兑付)成本总额	13,599.91	-
减：应收利息总额	5.10	-
买卖债券差价收入	2,477.26	-

**7.4.7.14.3 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。

**7.4.7.15 贵金属投资收益****7.4.7.15.1 贵金属投资收益项目构成**

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。

**7.4.7.16 衍生工具收益****7.4.7.16.1 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。

**7.4.7.16.2 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。

**7.4.7.17 股利收益**

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020 年12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019 年12月31日
股票投资产生的股利收益	290,948.49	16,904,904.77
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	290,948.49	16,904,904.77

**7.4.7.18 公允价值变动收益**

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年01月01日至2020年12 月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年12 月31日
1. 交易性金融资产	703,054,737.47	510,793,409.90
——股票投资	1,553,834.35	314,106,651.68
——债券投资	-	-
——资产支持证券投资	-	-

——基金投资	701,500,903.12	196,686,758.22
——贵金属投资	-	-
——其他	-	-
2. 衍生工具	-	0.00
——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	703,054,737.47	510,793,409.90

#### 7.4.7.19 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年 12月31日
基金赎回费收入	7,015,831.87	3,867,758.51
基金转换费收入	147,598.05	94,041.70
合计	7,163,429.92	3,961,800.21

#### 7.4.7.20 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年 12月31日
交易所市场交易费用	11,055,850.43	7,995,865.35
银行间市场交易费用	-	-
交易基金产生的费用	87,409.15	75,430.14
其中：申购费	29,278.03	38,973.71
赎回费	35,050.48	4,112.62
交易费	23,080.64	32,343.81
合计	11,143,259.58	8,071,295.49

## 7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年 12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年 12月31日
审计费用	100,000.00	100,000.00
信息披露费	120,000.00	100,000.00
证券出借违约金	-	-
指数使用费	-	392,852.31
其他费用	-	20.00
合计	220,000.00	592,872.31

## 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、基金销售机构、基金注册登 记机构
国泰君安证券股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
蚂蚁科技集团股份有限公司	基金管理人的股东
天津信托有限责任公司	基金管理人的股东
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
芜湖高新投资有限公司	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
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
新疆天聚宸兴股权投资合伙企业（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

注：1、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2、浙江蚂蚁小微金融服务集团股份有限公司于2020年07月13日更名为蚂蚁科技集团股份有限公司。

#### 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 2020年01月01日至2020年12月31日		上年度可比期间 2019年01月01日至2019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
国泰君安 证券股份 有限公司	5,293,031,217.02	50.77%	1,705,489,550.86	21.60%

##### 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 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年01月01日至2020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

国泰君安 证券股份 有限公司	2,282,900.11	50.77%	-	-
关联方名 称	上年度可比期间 2019年01月01日至2019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
国泰君安 证券股份 有限公司	620,775.85	18.86%	439,010.33	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，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

#### 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 2020年01月01日至202 0年12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至201 9年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,445,968.16	10,712,839.31
其中：支付销售机构的客户维护费	5,998,301.31	4,545,988.25

注：1、本基金基金资产中投资于目标ETF的部分不收取管理费，支付基金管理人天弘基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值扣除所持有目标ETF基金份额部分的基金资产后的余额（若为负数，则取零）的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 - 前一日所持有目标ETF基金份额部分的基金资产) × 0.50% / 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 2020年01月01日至2020 年12月31日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019 年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	289,193.67	2,142,567.79

注：本基金基金资产中投资于目标ETF的部分不收取托管费，支付基金托管人国泰君安证券股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值扣除所持有目标ETF基金份额部分的基金资产后的余额(若为负数，则取零)的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 - 前一日所持有目标ETF基金份额部分的基金资产) × 0.10% / 当年天数。

#### 7.4.10.2.3 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 2020年01月01日至2020年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	天弘创业板ETF联接基金A	天弘创业板ETF联接基金C	合计
天弘基金 管理有限 公司	-	998,622.01	998,622.01
国泰君安 证券股份 有限公司	-	38,282.15	38,282.15
合计	-	1,036,904.16	1,036,904.16
获得销售 服务费的 各关联方 名称	上年度可比期间 2019年01月01日至2019年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	天弘创业板ETF联接基金A	天弘创业板ETF联接基金C	合计

天弘基金 管理有限 公司	0.00	966,616.76	966,616.76
国泰君安 证券股份 有限公司	0.00	18,041.67	18,041.67
合计	0.00	984,658.43	984,658.43

注：1、支付基金销售机构的销售服务费按前一日C类基金份额基金资产净值0.20%的年费率计提，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。销售服务费的计算公式为：日销售服务费=前一日C类基金份额基金资产净值×0.20%/当年天数。

2、本基金A类份额不收取销售服务费。

#### 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

天弘创业板ETF联接基金A

份额单位：份

项目	本期 2020年01月01日至	上年度可比期间 2019年01月01日至
----	--------------------	-------------------------



	2020年12月31日	2019年12月31日
报告期初持有的基金份额	-	5,000,000.00
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	-	5,000,000.00
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

天弘创业板ETF联接基金C

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2020年01月01日至 2020年12月31日	2019年01月01日至 2019年12月31日
报告期初持有的基金份额	-	5,000,000.00
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	-	5,000,000.00
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

注：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。

#### 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

本基金本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。

#### 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		上年度可比期间	
	2020年01月01日至2020年12月31日		2019年01月01日至2019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
国泰君安证券股份	207,903,316.36	3,899,414.95	139,473,194.97	3,099,280.45

有限公司				
------	--	--	--	--

注：本基金的银行存款由基金托管人国泰君安证券股份有限公司保管，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 2020年01月01日至2020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
国泰君安证券股份有限公司	003003	天元股份	网下申购	756	7,930.44
国泰君安证券股份有限公司	300917	特发服务	网下申购	2,803	52,640.34
上年度可比期间 2019年01月01日至2019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
-	-	-	-	-	-

#### 7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本报告期末，本基金持有1,184,971,574份目标ETF基金份额（上年度末：1,325,906,997份），占其总份额的比例为94.42%（上年度末：90.63%）。

#### 7.4.11 利润分配情况—按摊余成本法核算的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（2020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

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	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
300999	金龙鱼	2020-09-29	2021-04-15	创业板打新限售	25.70	88.29	12,114	311,329.80	1,069,545.06	-
300896	爱美客	2020-09-21	2021-03-29	创业板打新限售	118.27	603.36	473	55,941.71	285,389.28	-
300901	中胤时尚	2020-10-19	2021-04-29	创业板打新限售	8.96	15.00	9,611	86,144.56	144,165.00	-
300860	锋尚文化	2020-08-06	2021-02-24	创业板打新限售	138.02	126.67	381	52,585.62	48,261.27	-
300861	美畅股份	2020-08-06	2021-02-24	创业板打新限售	43.76	51.10	895	39,165.20	45,734.50	-
300926	博俊科技	2020-12-29	2021-01-07	新股未上市	10.76	10.76	3,584	38,563.84	38,563.84	-
300919	中伟股份	2020-12-15	2021-06-23	创业板打新限售	24.60	61.51	610	15,006.00	37,521.10	-
300900	广联航空	2020-10-	2021-04-	创业板打	17.87	33.16	879	15,707.7	29,147.6	-

		19	29	新限售				3	4	
300927	江天化学	2020-12-29	2021-01-07	新股未上市	13.39	13.39	2,163	28,962.57	28,962.57	-
300910	瑞丰新材	2020-11-20	2021-05-27	创业板打新限售	30.26	47.87	474	14,343.24	22,690.38	-
300878	维康药业	2020-08-17	2021-03-03	创业板打新限售	41.34	48.72	401	16,577.34	19,536.72	-
300891	惠云钛业	2020-09-10	2021-03-17	创业板打新限售	3.64	16.40	1,143	4,160.52	18,745.20	-
300908	仲景食品	2020-11-13	2021-05-24	创业板打新限售	39.74	60.44	285	11,325.90	17,225.40	-
300884	狄耐克	2020-11-05	2021-05-12	创业板打新限售	24.87	33.51	499	12,410.13	16,721.49	-
300892	品渥食品	2020-09-11	2021-03-24	创业板打新限售	26.66	60.01	272	7,251.52	16,322.72	-
300909	汇创达	2020-11-11	2021-05-18	创业板打新限售	29.57	40.67	386	11,414.02	15,698.62	-
3008	谱尼	2020	2021	创业	44.4	74.5	210	9,33	15,6	-

87	测试	-09-09	-03-16	板打 新限售	7	2		8.70	49.20	
300913	兆龙互连	2020-11-27	2021-06-07	创业 板打 新限售	13.21	23.94	630	8,322.30	15,082.20	-
300864	南大环境	2020-08-13	2021-02-25	创业 板打 新限售	71.71	90.85	166	11,903.86	15,081.10	-
300889	爱克股份	2020-09-09	2021-03-16	创业 板打 新限售	27.97	30.12	479	13,397.63	14,427.48	-
300890	翔丰华	2020-09-10	2021-03-18	创业 板打 新限售	14.69	48.85	286	4,201.34	13,971.10	-
300925	C法本	2020-12-21	2021-06-30	创业 板打 新限售	20.08	37.33	353	7,088.24	13,177.49	-
300876	蒙泰高新	2020-08-14	2021-02-25	创业 板打 新限售	20.09	36.62	350	7,031.50	12,817.00	-
300879	大叶股份	2020-08-25	2021-03-01	创业 板打 新限售	10.58	27.12	466	4,930.28	12,637.92	-
300882	万胜智能	2020-08-27	2021-03-10	创业 板打 新限售	10.33	25.79	440	4,545.20	11,347.60	-

				售						
300911	亿田智能	2020-11-24	2021-06-03	创业板打新限售	24.35	33.06	309	7,524.15	10,215.54	-
300918	南山智尚	2020-12-15	2021-06-22	创业板打新限售	4.97	8.94	1,063	5,283.11	9,503.22	-
300881	盛德鑫泰	2020-08-25	2021-03-05	创业板打新限售	14.17	32.31	291	4,123.47	9,402.21	-
300922	C天秦	2020-12-18	2021-06-25	创业板打新限售	16.05	31.58	287	4,606.35	9,063.46	-
300917	特发服务	2020-12-14	2021-06-21	创业板打新限售	18.78	31.94	281	5,277.18	8,975.14	-
003030	祖名股份	2020-12-25	2021-01-06	新股未上市	15.18	15.18	480	7,286.40	7,286.40	-
300886	华业香料	2020-09-08	2021-03-16	创业板打新限售	18.59	45.67	147	2,732.73	6,713.49	-
003031	中瓷电子	2020-12-24	2021-01-04	新股未上市	15.27	15.27	387	5,909.49	5,909.49	-
7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券	证券	成功	可流	流通	认购	期末	数量	期末	期末	备注

代码	名称	认购日	通日	受限类型	价格	估值单价	(单位:张)	成本总额	估值总额	
123083	朗新转债	2020-12-09	2021-01-06	新债未上市	100.00	100.00	61	6,100.00	6,100.00	-
123090	三诺转债	2020-12-21	2021-01-12	新债未上市	100.00	100.00	67	6,700.00	6,700.00	-

注:1、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于6个月的限售期。

2、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。

3、创业板新股博俊科技（证券代码：300926）于2021年01月07日起上市流通，本基金获配的股数中359股根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》于上市后进入限售期，可流通日为2021年07月07日。

4、创业板新股江天化学（证券代码：300927）于2021年01月07日起上市流通，本基金获配的股数中217股根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》于上市后进入限售期，可流通日为2021年07月07日。

5、以上“可流通日”的日期，最终以上市公司公告为准。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
300182	捷成股份	2020-12-30	拟披露重大事项	3.23	2021-01-07	3.40	115,123	422,745.30	371,847.29	-

注:本基金截至2020年12月31日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

### 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2020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抵押的债券。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2020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抵押的债券。

### 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

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

本基金的基金管理人奉行全面风险管理理念，建立了以审计与风险控制委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、内控合规部、风险管理部、内审部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。在全面风险管理体系的框架下，董事会负责监督检查公司的合法合规运营、内部控制、风险管理，从而控制公司的整体运营风险。在董事会下设立审计与风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理委员会，主要负责拟定公司风险管理战略，经董事会批准后组织实施；组织实施经董事会批准的年度风险预算、风险可容忍度限额及其他量化风险管理工具；根据公司总体风险控制目标，制定各业务和各环节风险控制目标和要求；落实公司就重大风险管理作出的决定或决议；听取并讨论会议议题，就重大风险管理事项形成决议；拟定或批准公司风险管理制度、流程。在业务操作层面风险管理职责主要由内控合规部和风险管理部负责，内控合规部负责对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理提供合规控制标准，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标；内控合规部对公司总经理负责，并由督察长分管。风险管理部通过投资交易系统的风控参数设置，保证各投资组合的投资比例合规；参与各投资组合新股申购、一级债申购、银行间交易等场外交易的风险识别与评估，保证各投资组合场外交易的事中合规控制；负责各投资组合投资绩效、大类风险的识别、计量和控制。



风险管理部向公司首席风控官进行汇报。内审部对公司内部控制和风险管理的有效性，经营效率和效果等方面开展独立评价活动，向总经理和督察长汇报。

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存放在本基金的托管人国泰君安证券股份有限公司开立于具有基金托管人资格的中国工商银行股份有限公司的托管账户，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

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

##### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本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

单位：人民币元

长期信用评级	本期末	上年度末
--------	-----	------

	2020年12月31日	2019年12月31日
AAA	-	-
AAA以下	12,800.00	-
未评级	-	-
合计	12,800.00	-

#### 7.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本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上出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

于2020年12月31日，本基金所承担的全部金融负债的合同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(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 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期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上市公司发行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为0.06%。

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。于2020年12月31日，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。

#### 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。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，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。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金和债券投资等。

#### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2020年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	207,903,316.36	-	-	-	207,903,316.36
结算备付金	7,899,874.45	-	-	-	7,899,874.45
存出保证金	6,261,623.47	-	-	-	6,261,623.47
交易性金融资产	-	-	12,800.00	3,581,727,806.12	3,581,740,606.12
应收证券清算款	-	-	-	129,282,666.03	129,282,666.03
应收利息	-	-	-	123,454.65	123,454.65
应收申购款	-	-	-	14,633,941.88	14,633,941.88
资产总计	222,064,814.28	-	12,800.00	3,725,767,868.68	3,947,845,482.96
负债					
应付赎回款	-	-	-	175,259,918.26	175,259,918.26
应付管理人报酬	-	-	-	122,947.86	122,947.86
应付托管费	-	-	-	24,589.55	24,589.55
应付销售服务费	-	-	-	520,748.16	520,748.16
应付交易费用	-	-	-	1,509,810.00	1,509,810.00
其他负债	-	-	-	239,418.17	239,418.17
负债总计	-	-	-	177,677,432.00	177,677,432.00
利率敏感度缺口	222,064,814.28	-	12,800.00	3,548,090,436.68	3,770,168,050.96
上年度末2019年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	139,473,194.97	-	-	-	139,473,194.97
结算备付金	3,203,747.14	-	-	-	3,203,747.14
存出保证金	2,484,723.89	-	-	-	2,484,723.89
交易性金融资产	-	-	-	2,391,141,557.32	2,391,141,557.32
应收证券清算款	-	-	-	21,752,254.91	21,752,254.91
应收利息	-	-	-	72,481.97	72,481.97
应收申购款	-	-	-	11,612,279.16	11,612,279.16

资产总计	145,161,666.00	-	-	2,424,578,573.36	2,569,740,239.36
负债					
应付赎回款	-	-	-	49,855,697.45	49,855,697.45
应付管理人报酬	-	-	-	71,816.03	71,816.03
应付托管费	-	-	-	14,363.20	14,363.20
应付销售服务费	-	-	-	273,208.64	273,208.64
应付交易费用	-	-	-	439,010.33	439,010.33
应交税费	-	-	-	152,535.18	152,535.18
其他负债	-	-	-	209,440.29	209,440.29
负债总计	-	-	-	51,016,071.12	51,016,071.12
利率敏感度缺口	145,161,666.00	-	-	2,373,562,502.24	2,518,724,168.24

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2020年12月31日，本基金持有的交易性债券投资占基金资产净值的比例为0.00%（2019年12月31日：0.00%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2019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。本基金主要投资于能通过股票组合赎回或二级市场交易卖出的目标ETF份额以及证券交易所上市的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金通过指数化分散投资降低其他价格风险。本基金投资组合中，投资于目标ETF的比例不低于基金资产净值的90%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中，上述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进

行风险度量，包括VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 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 2020年12月31日		上年度末 2019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	43,639,680.47	1.16	8,884,455.81	0.35
交易性金融资产—基金投资	3,538,088,125.65	93.84	2,382,257,101.51	94.58
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	3,581,727,806.12	95.00	2,391,141,557.32	94.93

#### 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 2020年12月31日	上年度末 2019年12月31日
	业绩比较基准上升5%	218,669,746.96	119,565,247.98
	业绩比较基准下降5%	-218,669,746.96	-119,565,247.98

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

## (1) 公允价值

## (a) 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。

## (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

## (i) 各层次金融工具公允价值

于2020年12月31日，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中属于第一层次的余额为3,579,310,468.00元，属于第二层次的余额为2,430,138.12元，无属于第三层次的余额(2019年12月31日：第一层次2,391,134,979.28元，第二层次6,578.04元，无属于第三层次的余额)。

## (ii) 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。

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，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股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

## (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

## (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2020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(2019年12月31日：同)。

## (d) 不以公允价值计量的金融工具

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。

(2) 除公允价值外，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	43,639,680.47	1.11
	其中：股票	43,639,680.47	1.11
2	基金投资	3,538,088,125.65	89.62
3	固定收益投资	12,800.00	0.00
	其中：债券	12,800.00	0.00
	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	215,803,190.81	5.47
8	其他各项资产	150,301,686.03	3.81
9	合计	3,947,845,482.96	100.00

## 8.2 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	1,255,060.99	0.03
B	采矿业	-	-
C	制造业	28,434,478.81	0.75
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	57,412.72	0.00
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	4,090,290.64	0.11
J	金融业	3,189,563.94	0.08
K	房地产业	8,975.14	0.00
L	租赁和商务服务业	166,680.00	0.00



M	科学研究和技术服务业	1,340,426.52	0.04
N	水利、环境和公共设施管理业	228,508.45	0.01
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	3,151,715.73	0.08
R	文化、体育和娱乐业	1,716,567.53	0.05
S	综合	-	-
	合计	43,639,680.47	1.16

### 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

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	13,877	4,872,353.47	0.13
2	300059	东方财富	91,479	2,835,849.00	0.08
3	300760	迈瑞医疗	5,610	2,389,860.00	0.06
4	300015	爱尔眼科	24,069	1,802,527.41	0.05
5	300124	汇川技术	15,226	1,420,585.80	0.04
6	300122	智飞生物	8,474	1,253,389.34	0.03
7	300014	亿纬锂能	14,983	1,221,114.50	0.03
8	300498	温氏股份	66,479	1,211,912.17	0.03
9	300347	泰格医药	7,084	1,144,845.24	0.03
10	300999	金龙鱼	12,114	1,069,545.06	0.03
11	300274	阳光电源	12,889	931,616.92	0.02
12	300142	沃森生物	21,353	823,371.68	0.02
13	300782	卓胜微	1,321	753,683.34	0.02
14	300601	康泰生物	3,994	696,953.00	0.02
15	300450	先导智能	8,153	684,770.47	0.02

16	300413	芒果超媒	9,304	674,540.00	0.02
17	300454	深信服	2,615	648,546.15	0.02
18	300433	蓝思科技	18,388	562,856.68	0.01
19	300408	三环集团	14,432	537,592.00	0.01
20	300012	华测检测	18,720	512,366.40	0.01
21	300677	英科医疗	2,750	462,412.50	0.01
22	300285	国瓷材料	10,241	461,971.51	0.01
23	300496	中科创达	3,723	435,591.00	0.01
24	300003	乐普医疗	15,886	431,781.48	0.01
25	300207	欣旺达	13,542	415,874.82	0.01
26	300253	卫宁健康	23,387	409,272.50	0.01
27	300136	信维通信	11,134	399,487.92	0.01
28	300182	捷成股份	115,123	371,847.29	0.01
29	300037	新宙邦	3,600	365,040.00	0.01
30	300529	健帆生物	5,348	362,701.36	0.01
31	300144	宋城演艺	20,284	359,432.48	0.01
32	300033	同花顺	2,853	353,714.94	0.01
33	300759	康龙化成	2,900	349,160.00	0.01
34	300558	贝达药业	3,223	346,053.51	0.01
35	300308	中际旭创	6,700	340,762.00	0.01
36	300699	光威复材	3,807	339,013.35	0.01
37	300595	欧普康视	4,132	338,493.44	0.01
38	300724	捷佳伟创	2,300	334,880.00	0.01
39	300676	华大基因	2,482	319,085.92	0.01
40	300073	当升科技	4,883	316,662.55	0.01
41	300661	圣邦股份	1,200	316,560.00	0.01
42	300896	爱美客	473	285,389.28	0.01
43	300357	我武生物	3,574	274,125.80	0.01
44	300628	亿联网络	3,648	266,741.76	0.01
45	300383	光环新网	14,967	256,983.39	0.01
46	300088	长信科技	27,963	248,591.07	0.01

47	300146	汤臣倍健	10,282	248,310.30	0.01
48	300316	晶盛机电	8,126	244,430.08	0.01
49	300463	迈克生物	5,002	233,093.20	0.01
50	300001	特锐德	7,706	226,248.16	0.01
51	300271	华宇软件	9,284	221,609.08	0.01
52	300070	碧水源	27,899	213,427.35	0.01
53	300482	万孚生物	2,357	210,267.97	0.01
54	300618	寒锐钴业	2,200	208,802.00	0.01
55	300244	迪安诊断	5,961	204,343.08	0.01
56	300024	机器人	16,123	198,312.90	0.01
57	300418	昆仑万维	9,577	191,061.15	0.01
58	300115	长盈精密	7,695	189,681.75	0.01
59	300017	网宿科技	27,123	186,877.47	0.00
60	300009	安科生物	12,274	180,182.32	0.00
61	300315	掌趣科技	34,674	177,184.14	0.00
62	300251	光线传媒	14,309	172,709.63	0.00
63	300212	易华录	5,509	168,850.85	0.00
64	300773	拉卡拉	5,600	167,552.00	0.00
65	300058	蓝色光标	27,780	166,680.00	0.00
66	300296	利亚德	25,691	163,394.76	0.00
67	300502	新易盛	2,900	160,892.00	0.00
68	300223	北京君正	1,700	155,533.00	0.00
69	300747	锐科激光	1,750	153,755.00	0.00
70	300630	普利制药	3,641	152,521.49	0.00
71	300298	三诺生物	4,200	150,360.00	0.00
72	300901	中胤时尚	9,611	144,165.00	0.00
73	300457	赢合科技	4,778	143,578.90	0.00
74	300775	三角防务	3,600	141,912.00	0.00
75	300451	创业慧康	10,249	138,668.97	0.00
76	300476	胜宏科技	6,127	132,159.39	0.00
77	300188	美亚柏科	6,000	129,240.00	0.00

78	300294	博雅生物	3,802	127,519.08	0.00
79	300226	上海钢联	1,880	123,328.00	0.00
80	300166	东方国信	10,654	116,661.30	0.00
81	300474	景嘉微	1,652	115,491.32	0.00
82	300567	精测电子	2,100	115,374.00	0.00
83	300674	宇信科技	3,343	113,427.99	0.00
84	300369	绿盟科技	7,327	111,956.56	0.00
85	300026	红日药业	24,158	110,643.64	0.00
86	300456	赛微电子	4,400	104,808.00	0.00
87	300113	顺网科技	6,022	103,277.30	0.00
88	300770	新媒股份	1,460	102,638.00	0.00
89	300072	三聚环保	17,256	98,014.08	0.00
90	300010	豆神教育	9,754	95,199.04	0.00
91	300180	华峰超纤	15,561	91,965.51	0.00
92	300133	华策影视	14,527	89,776.86	0.00
93	300741	华宝股份	1,600	87,792.00	0.00
94	300748	金力永磁	2,300	83,582.00	0.00
95	300682	朗新科技	5,350	78,217.00	0.00
96	300616	尚品宅配	959	76,393.94	0.00
97	300666	江丰电子	1,400	69,314.00	0.00
98	300633	开立医疗	2,600	67,236.00	0.00
99	300766	每日互动	3,400	56,066.00	0.00
100	300860	锋尚文化	381	48,261.27	0.00
101	300861	美畅股份	895	45,734.50	0.00
102	300768	迪普科技	1,234	44,905.26	0.00
103	300761	立华股份	1,391	43,148.82	0.00
104	300783	三只松鼠	1,000	41,090.00	0.00
105	300926	博俊科技	3,584	38,563.84	0.00
106	300919	中伟股份	610	37,521.10	0.00
107	300900	广联航空	879	29,147.64	0.00
108	300927	江天化学	2,163	28,962.57	0.00

109	300910	瑞丰新材	474	22,690.38	0.00
110	003026	中晶科技	461	21,740.76	0.00
111	300878	维康药业	401	19,536.72	0.00
112	300891	惠云钛业	1,143	18,745.20	0.00
113	003028	振邦智能	432	18,010.08	0.00
114	300908	仲景食品	285	17,225.40	0.00
115	300884	狄耐克	499	16,721.49	0.00
116	300892	品渥食品	272	16,322.72	0.00
117	300909	汇创达	386	15,698.62	0.00
118	300887	谱尼测试	210	15,649.20	0.00
119	300913	兆龙互连	630	15,082.20	0.00
120	300864	南大环境	166	15,081.10	0.00
121	300889	爱克股份	479	14,427.48	0.00
122	300890	翔丰华	286	13,971.10	0.00
123	300925	C法本	353	13,177.49	0.00
124	300876	蒙泰高新	350	12,817.00	0.00
125	300879	大叶股份	466	12,637.92	0.00
126	300882	万胜智能	440	11,347.60	0.00
127	300911	亿田智能	309	10,215.54	0.00
128	300918	南山智尚	1,063	9,503.22	0.00
129	300881	盛德鑫泰	291	9,402.21	0.00
130	300922	C天秦	287	9,063.46	0.00
131	300917	特发服务	281	8,975.14	0.00
132	003030	祖名股份	480	7,286.40	0.00
133	300886	华业香料	147	6,713.49	0.00
134	003031	中瓷电子	387	5,909.49	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	326,159,863.61	12.95
2	300059	东方财富	283,560,541.15	11.26
3	300760	迈瑞医疗	255,703,049.43	10.15
4	300498	温氏股份	253,922,423.82	10.08
5	300015	爱尔眼科	159,888,171.91	6.35
6	300142	沃森生物	144,386,556.62	5.73
7	300122	智飞生物	123,883,731.86	4.92
8	300014	亿纬锂能	116,277,861.56	4.62
9	300124	汇川技术	111,814,517.96	4.44
10	300347	泰格医药	109,147,928.56	4.33
11	300601	康泰生物	93,375,117.89	3.71
12	300003	乐普医疗	90,033,760.66	3.57
13	300136	信维通信	86,516,576.43	3.43
14	300454	深信服	75,987,428.04	3.02
15	300413	芒果超媒	70,551,144.67	2.80
16	300253	卫宁健康	70,280,354.74	2.79
17	300433	蓝思科技	64,854,407.33	2.57
18	300012	华测检测	62,757,645.33	2.49
19	300408	三环集团	59,431,060.16	2.36
20	300383	光环新网	59,157,642.72	2.35
21	300033	同花顺	56,626,686.08	2.25
22	300661	圣邦股份	56,597,341.45	2.25
23	300450	先导智能	55,515,428.25	2.20

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	424,318,923.37	16.85
2	300059	东方财富	334,547,312.98	13.28
3	300760	迈瑞医疗	309,950,413.06	12.31
4	300498	温氏股份	271,958,330.20	10.80
5	300015	爱尔眼科	203,353,396.39	8.07
6	300142	沃森生物	160,202,992.32	6.36
7	300122	智飞生物	159,248,398.57	6.32
8	300124	汇川技术	147,097,638.18	5.84
9	300014	亿纬锂能	138,489,961.63	5.50
10	300347	泰格医药	134,105,343.03	5.32
11	300601	康泰生物	109,271,892.23	4.34
12	300003	乐普医疗	97,692,685.77	3.88
13	300136	信维通信	94,023,910.76	3.73
14	300454	深信服	87,664,628.18	3.48
15	300413	芒果超媒	85,553,256.50	3.40
16	300433	蓝思科技	76,170,327.07	3.02
17	300253	卫宁健康	75,004,620.68	2.98
18	300012	华测检测	73,656,385.47	2.92
19	300408	三环集团	69,633,864.70	2.76
20	300450	先导智能	68,281,751.64	2.71
21	300033	同花顺	62,876,766.00	2.50
22	300383	光环新网	62,554,767.89	2.48
23	300274	阳光电源	62,404,565.23	2.48
24	300529	健帆生物	59,976,451.63	2.38
25	300144	宋城演艺	58,576,761.86	2.33
26	300676	华大基因	56,714,799.54	2.25
27	300661	圣邦股份	56,128,525.06	2.23
28	300285	国瓷材料	55,453,997.32	2.20
29	300207	欣旺达	54,702,571.62	2.17
30	300496	中科创达	53,492,253.11	2.12
31	300088	长信科技	52,490,747.30	2.08

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	4,801,570,325.30
卖出股票收入（成交）总额	5,634,056,203.59

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	12,800.00	0.00
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	12,800.00	0.00

#### 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

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	123090	三诺转债	67	6,700.00	0.00



2	123083	朗新转债	61	6,100.00	0.00
---	--------	------	----	----------	------

#### 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 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名基金投资明细

金额单位：人民币元

序号	基金名称	类型	运作方式	管理人	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	天弘创业板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	3,538,088,125.65	93.84

#### 8.11 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

#### 8.12 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

#### 8.13 投资组合报告附注

8.13.1 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。

8.13.2 基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

**8.13.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	6,261,623.47
2	应收证券清算款	129,282,666.03
3	应收股利	-
4	应收利息	123,454.65
5	应收申购款	14,633,941.88
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	150,301,686.03

**8.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

**8.13.5 期末前十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	300999	金龙鱼	1,069,545.06	0.03	创业板打新限售

**8.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分**

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

**§ 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

份额	持有	户均持有的	持有人结构
----	----	-------	-------

级别	户数 (户)	基金份额	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 创业 板ETF 联接 基金A	381, 117	2,414.85	193,922,203.41	21.0 7%	726,419,686.67	78.93%
天弘 创业 板ETF 联接 基金C	513, 537	4,573.33	521,557,336.60	22.2 1%	1,827,017,238. 45	77.79%
合计	894, 654	3,653.83	715,479,540.01	21.8 9%	2,553,436,925. 12	78.11%

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）。

## 9.2 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	天弘创业板ETF联 接基金A	1,506,553.05	0.16%
	天弘创业板ETF联 接基金C	1,501,737.14	0.06%
	合计	3,008,290.19	0.09%

## 9.3 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	天弘创业板ETF联	0~10

和研究部门负责人持有本开放式基金	接基金A	
	天弘创业板ETF联接基金C	0~10
	合计	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	天弘创业板ETF联接基金A	0~10
	天弘创业板ETF联接基金C	0~10
	合计	0~10

## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

	天弘创业板ETF联接基金A	天弘创业板ETF联接基金C
基金合同生效日(2015年07月08日)基金份额总额	5,000,000.00	5,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	1,393,458,982.17	2,139,931,810.74
本报告期基金总申购份额	2,817,908,081.05	13,017,236,140.89
减：本报告期基金总赎回份额	3,291,025,173.14	12,808,593,376.58
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	920,341,890.08	2,348,574,575.05

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。

## § 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，经天弘基金管理有限公司股东会2020年第2次会议审议通过，黄浩先生担任公司董事，祖国明先生不再担任公司董事。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，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

### 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普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）支付服务费 100,000.00 元。截至本报告期末，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）已为本基金提供审计服务 5 年 6 个月。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人、托管人及其高级管理人员没有发生受稽查或处罚的情况。

### 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	
安信证券	2	-	-	-	-	-
东方财富证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	4	3,163,485,933.80	30.34%	1,364,424.23	30.34%	-
光大证券	2	-	-	-	-	-

广发证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券	8	5,293,031,217.02	50.77%	2,282,900.11	50.77%	-
海通证券	2	1,153,106,349.58	11.06%	497,339.94	11.06%	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	816,430,169.55	7.83%	352,130.34	7.83%	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投证券	2	-	-	-	-	-

注：1、基金专用交易单元的选择标准为：该证券经营机构财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；经营行为规范，内控制度健全，最近两年未因重大违规行为受到监管机关的处罚；研究实力较强，能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、市场分析报告、行业研究报告、个股分析报告及全面的信息服务。

2、基金专用交易单元的选择程序：本基金管理人根据上述标准进行考察后，确定选用交易席位的证券经营机构。然后基金管理人和被选用的证券经营机构签订交易席位租用协议。

3、本基金报告期内新租用交易单元：方正证券深圳交易单元、海通证券深圳交易单元、开源证券深圳交易单元、西部证券深圳交易单元。

4、本基金报告期内停止租用交易单元：无。

### 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	债券交易	债券回购交易	权证交易	基金交易
----	------	--------	------	------

名称	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
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	109,594,478.29	23.12%
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	26,400.00	62.14%	-	-	-	-	125,043,568.27	26.38%
海通证券	-	-	-	-	-	-	197,879,129.84	41.75%
开源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	16,082.27	37.86%	-	-	-	-	41,417,195.40	8.74%
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-

### 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	天弘基金管理有限公司关于系统升级维护的通知	中国证监会指定媒介	2020-01-03

2	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国农业银行股份有限公司申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2020-01-07
3	天弘基金管理有限公司关于旗下基金在泰信财富基金销售有限公司暂停办理基金销售业务的公告	中国证监会指定媒介	2020-01-11
4	天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金 联接基金 招募说明书（更新）摘要	中国证监会指定媒介	2020-01-18
5	天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书（更新）	中国证监会指定媒介	2020-01-18
6	天弘基金管理有限公司关于深圳分公司经营场所变更的公告	中国证监会指定媒介	2020-01-18
7	天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金2019年第4季度报告	中国证监会指定媒介	2020-01-20
8	天弘基金管理有限公司及全资子公司投资旗下偏股型公募基金的公告	中国证监会指定媒介	2020-02-04
9	天弘基金管理有限公司关于增加广东顺德农村商业银行股份有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投、转换业务的公告	中国证监会指定媒介	2020-02-17
10	天弘基金管理有限公司关于增加泉州银行股份有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投、转换业务以及参加其费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2020-03-04



11	天弘基金管理有限公司关于增加海通证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投、转换业务以及参加其费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2020-03-23
12	天弘基金管理有限公司关于推迟披露旗下公募基金2019年年度报告的公告	中国证监会指定媒介	2020-03-25
13	天弘基金管理有限公司关于调整网上直销交易系统通联支付渠道费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2020-04-02
14	天弘基金管理有限公司关于提醒客户及时提供或更新身份信息资料的公告	中国证监会指定媒介	2020-04-04
15	天弘基金管理有限公司关于终止泰诚财富基金销售（大连）有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定媒介	2020-04-04
16	天弘基金管理有限公司关于增加华信期货股份有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投、转换业务以及参加其费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2020-04-15
17	天弘基金管理有限公司关于增加重庆银行股份有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投、转换业务以及参加其费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2020-04-17
18	天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金20	中国证监会指定媒介	2020-04-22

	20年第一季度报告		
19	天弘基金管理有限公司关于增加中国银河证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投、转换业务以及参加其费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2020-04-23
20	天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金2019年年度报告	中国证监会指定媒介	2020-04-24
21	天弘基金管理有限公司关于增加申万宏源西部证券有限公司为天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金销售机构并开通申购、赎回、定投、转换业务以及参加其费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2020-05-20
22	天弘基金管理有限公司关于增加华金证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投、转换业务以及参加其费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2020-06-10
23	天弘基金管理有限公司关于参加交通银行手机银行基金申购及定投费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2020-07-01
24	天弘基金管理有限公司关于增加中信证券华南股份有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投、转换业务以及参加其费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2020-07-08
25	天弘基金管理有限公司关于	中国证监会指定媒介	2020-07-09

	增加渤海证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、转换业务以及参加其费率优惠活动的公告		
26	天弘基金管理有限公司关于增加华宝证券有限责任公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投、转换业务以及参加其费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2020-07-09
27	天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金2020年第二季度报告	中国证监会指定媒介	2020-07-21
28	天弘基金管理有限公司关于增加招商银行股份有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投、转换业务的公告	中国证监会指定媒介	2020-07-22
29	天弘基金管理有限公司关于股东名称变更的公告	中国证监会指定媒介	2020-07-22
30	天弘基金管理有限公司关于参加招商银行股份有限公司申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2020-07-30
31	天弘基金管理有限公司关于增加北京度小满基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投、转换业务以及参加其费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2020-08-03
32	天弘基金管理有限公司关于增加四川天府银行股份有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投、	中国证监会指定媒介	2020-08-05

	转换业务以及参加其费率优惠活动的公告		
33	天弘基金管理有限公司关于增加中邮证券有限责任公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投、转换业务以及参加其费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2020-08-10
34	天弘基金管理有限公司关于增加华泰证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投、转换业务以及参加其费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2020-08-13
35	天弘基金管理有限公司关于增加财通证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投、转换业务以及参加其费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2020-08-17
36	天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金产品资料概要（更新）	中国证监会指定媒介	2020-08-27
37	天弘基金管理有限公司关于增加中信银行股份有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投、转换业务以及参加其费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2020-08-27
38	天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金2020年中期报告	中国证监会指定媒介	2020-08-31
39	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会指定媒介	2020-09-14
40	天弘基金管理有限公司关于	中国证监会指定媒介	2020-09-16

	旗下部分基金在光大证券股份有限公司开通定投业务以及参加其申购费率优惠活动的公告		
41	天弘基金管理有限公司关于增加兴业银行股份有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投、转换业务以及参加其费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2020-10-15
42	天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金招募说明书（更新）	中国证监会指定媒介	2020-10-22
43	天弘基金管理有限公司关于增加上海浦东发展银行股份有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投、转换业务的公告	中国证监会指定媒介	2020-10-26
44	天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金2020年第三季度报告	中国证监会指定媒介	2020-10-28
45	天弘基金管理有限公司关于增加中国中金财富证券有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投、转换业务以及参加其费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2020-10-29
46	天弘基金管理有限公司关于增加国金证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投、转换业务以及参加其费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2020-10-30
47	关于注意防范冒用天弘基金	中国证监会指定媒介	2020-11-24

	相关名义进行诈骗活动的风险提示		
--	-----------------	--	--

## § 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

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。

### 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准天弘创业板指数型发起式证券投资基金募集的文件
- 2、天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金基金合同
- 3、天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金托管协议
- 4、天弘创业板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

### 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](http://www.thfund.com.cn)

天弘基金管理有限公司  
二〇二一年三月三十一日