

# 天弘中证中美互联网指数型发起式证券投资基金（QDII）

## 2021年第2季度报告

2021年06月30日

基金管理人:天弘基金管理有限公司

基金托管人:中国工商银行股份有限公司

报告送出日期:2021年07月21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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年07月19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。

本报告期自2021年04月01日起至2021年06月30日止。

## § 2 基金产品概况

基金简称	天弘中证中美互联网
基金主代码	009225
基金运作方式	契约型开放式、发起式
基金合同生效日	2020年05月27日
报告期末基金份额总额	110,046,294.76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	中证中美互联网指数收益率×95%+人民币活期存款收益率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，风险和收益高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金为被动管理的指数型基金，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。	
基金管理人	天弘基金管理有限公司	
基金托管人	中国工商银行股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	天弘中证中美互联网A	天弘中证中美互联网C
下属分级基金的交易代码	009225	009226
报告期末下属分级基金的份额总额	79,012,612.72份	31,033,682.04份
境外投资顾问	英文名称:无	
	中文名称:无	
境外资产托管人	英文名称:The Northern Trust Company	
	中文名称:美国北美信托银行有限公司	

### § 3 主要财务指标和基金净值表现

#### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2021年04月01日 - 2021年06月30日)	
	天弘中证中美互联网A	天弘中证中美互联网C
1. 本期已实现收益	-618,917.58	-269,193.94
2. 本期利润	3,651,118.00	1,492,967.38
3. 加权平均基金份额本期利润	0.0554	0.0573
4. 期末基金资产净值	98,912,566.74	38,734,648.57
5. 期末基金份额净值	1.2519	1.2481

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。

#### 3.2 基金净值表现

##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

天弘中证中美互联网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	①-③	②-④

				④		
过去三个月	3.18%	1.10%	3.45%	1.13%	-0.27%	-0.03%
过去六个月	2.67%	1.60%	3.08%	1.58%	-0.41%	0.02%
过去一年	21.80%	1.57%	24.18%	1.52%	-2.38%	0.05%
自基金合同生效日起至今	25.19%	1.51%	35.38%	1.50%	-10.19%	0.01%

## 天弘中证中美互联网C净值表现

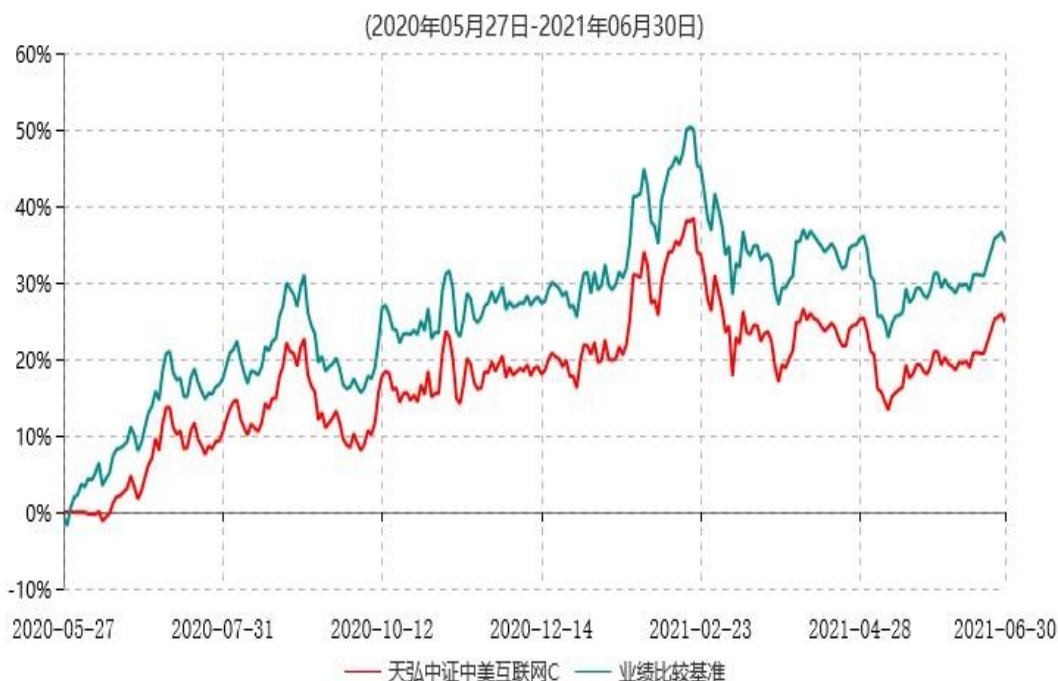
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.10%	1.10%	3.45%	1.13%	-0.35%	-0.03%
过去六个月	2.51%	1.60%	3.08%	1.58%	-0.57%	0.02%
过去一年	21.46%	1.57%	24.18%	1.52%	-2.72%	0.05%
自基金合同生效日起至今	24.81%	1.51%	35.38%	1.50%	-10.57%	0.01%

## 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

天弘中证中美互联网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



天弘中证中美互联网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：1、本基金合同于2020年05月27日生效。

2、按照本基金合同的约定，基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。本基金的建仓期为2020年05月27日至2020年11月26日，建仓期结束时及至报告期末，各项资产配置比例均符合基金合同的约定。

#### § 4 管理人报告

#### 4.1 基金经理（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		
胡超	基金经理	2020年05月	-	8年	男，金融学硕士。历任普华永道咨询（深圳）有限公司高级顾问、中合中小企业融资担保股份有限公司高级业务经理、中国人民财产保险股份有限公司海外投资业务主管。2016年6月加盟本公司，历任国际业务研究员。

注：1、上述任职日期/离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 境外投资顾问为本基金提供投资建议的主要成员简介

本基金未聘请境外投资顾问。

#### 4.3 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况说明

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。

#### 4.4 公平交易专项说明

##### 4.4.1 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。

#### 4.4.2 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，未产生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，未导致不公平交易和利益输送。

#### 4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

2021年上半年，随着新冠疫苗上市并开始接种，尽管部分国家与地区仍然存在疫情爆发，但是投资人对于疫情的担忧已经逐步褪去。随着全球经济进入复苏通道，通胀抬升预期逐渐强化，对于各国央行何时以及如何收紧货币政策的担忧导致市场的波动性逐步提升。尽管如此，上半年纳斯达克指数依然创下历史新高，美股主要龙头互联网公司基本面稳健。中概股方面，除了面临货币政策转向的担忧之外，部分龙头公司亦受到行业政策性因素影响，股价自高点回调较大。

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。截至2021年06月30日，天弘中证中美互联网A基金份额净值为1.2519元，天弘中证中美互联网C基金份额净值为1.2481元。报告期内份额净值增长率天弘中证中美互联网A为3.18%，同期业绩比较基准增长率为3.45%；天弘中证中美互联网C为3.10%，同期业绩比较基准增长率为3.45%。

#### 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

#### 5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	131,012,492.28	91.26
	其中：普通股	97,834,282.97	68.15

	存托凭证	33,178,209.31	23.11
	优先股	-	-
	房地产信托	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
	其中：远期	-	-
	期货	-	-
	期权	-	-
	权证	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	货币市场工具	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	10,274,599.54	7.16
8	其他资产	2,272,855.81	1.58
9	合计	143,559,947.63	100.00

注：本报告期末，本基金通过港股通交易机制投资的港股公允价值为31,528,068.69元，占基金资产净值的比例为22.90%。

## 5.2 报告期末在各个国家（地区）证券市场的股票及存托凭证投资分布

国家(地区)	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
美国	99,484,423.59	72.27
中国香港	31,528,068.69	22.90
合计	131,012,492.28	95.18

注：1、国家（地区）类别根据其所在的证券交易所确定。

2、ADR、GDR 按照存托凭证本身挂牌的证券交易所确定。

## 5.3 报告期末按行业分类的股票及存托凭证投资组合

行业类别	公允价值(人民币元)	占基金资产净值比例(%)
能源	-	-



基础材料	-	-
工业	-	-
消费者非必需品	60,756,869.02	44.14
消费者常用品	-	-
医疗保健	-	-
金融	-	-
信息技术	7,645,833.73	5.55
电信服务	60,741,662.98	44.13
公用事业	-	-
房地产	1,868,126.55	1.36
合计	131,012,492.28	95.18

注：以上分类采用全球行业分类标准（GICS）。

#### 5.4 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及存托凭证投资明细

序号	公司名称 (英文)	公司名称 (中文)	证券 代码	所在证 券市场	所属国 家(地 区)	数量 (股)	公允价 值(人民 币元)	占基金资产 净值比例 (%)
1	Amazon.com Inc	-	US0231351067	纳斯达克证券交易所	美国	609	13,534,280.57	9.83
2	Meituan	美团	KYG596691041	香港证券交易所	中国香港	50,600	13,489,880.66	9.80
3	Alibaba Group Holding Ltd	阿里巴巴	US01609W1027	纽约证券交易所	美国	8,982	13,158,822.92	9.56
4	Facebook Inc	-	US30303M1027	纳斯达克证券交易所	美国	5,789	13,003,491.30	9.45
5	Alphabet Inc	-	US02079K3059	纳斯达克证券交易所	美国	417	6,577,844.56	4.78
			US02079K10	纳斯达克证券交易所	美国	389	6,298,329.28	4.58

			79	交易所				
6	Tencent Holdings Ltd	腾讯控股	KYG875721634	香港证券交易所	中国香港	25,100	12,196,961.47	8.86
7	Netflix Inc	-	US64110L1061	纳斯达克证券交易所	美国	2,596	8,858,303.34	6.44
8	Pinduoduo Inc	拼多多	US7223041028	纳斯达克证券交易所	美国	6,449	5,291,803.71	3.84
9	JD.com Inc	京东集团	US47215P1066	纳斯达克证券交易所	美国	9,662	4,981,539.57	3.62

#### 5.5 报告期末按债券信用等级分类的债券投资组合

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名的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

#### 5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

#### 5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名金融衍生品投资明细

本基金本报告期末未持有金融衍生品。

#### 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

本基金本报告期末未持有基金。

#### 5.10 投资组合报告附注

5.10.1 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。

5.10.2 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。

#### 5.10.3 其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
----	----	----------

1	存出保证金	7,756.71
2	应收证券清算款	131,236.74
3	应收股利	-
4	应收利息	585.76
5	应收申购款	2,133,276.60
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	2,272,855.81

#### 5.10.4 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。

#### 5.10.5 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。

#### 5.10.6 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

单位：份

	天弘中证中美互联网A	天弘中证中美互联网C
报告期期初基金份额总额	53,718,852.99	21,133,688.37
报告期期间基金总申购份额	35,976,356.96	21,305,175.47
减：报告期期间基金总赎回份额	10,682,597.23	11,405,181.80
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	79,012,612.72	31,033,682.04

### § 7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

### § 8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期

					限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	9.09%	10,000,000.00	9.09%	三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,000.00	9.09%	10,000,000.00	9.09%	-

## § 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，本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

## § 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中证中美互联网指数型发起式证券投资基金（QDII）募集的文件
- 2、天弘中证中美互联网指数型发起式证券投资基金（QDII）基金合同
- 3、天弘中证中美互联网指数型发起式证券投资基金（QDII）托管协议
- 4、天弘中证中美互联网指数型发起式证券投资基金（QDII）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](http://www.thfund.com.cn)

天弘基金管理有限公司  
二〇二一年七月二十一日