

天弘中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金

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:国泰君安证券股份有限公司

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。

基金托管人国泰君安证券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	证券ETF
场内简称	证券ETF
基金主代码	159841
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2021年01月28日
报告期末基金份额总额	590,838,465.00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。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。
业绩比较基准	中证全指证券公司指数收益率
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。
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

§ 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）
1. 本期已实现收益	13,932,778.09
2. 本期利润	55,044,374.28
3. 加权平均基金份额本期利润	0.1022
4. 期末基金资产净值	588,010,935.90
5. 期末基金份额净值	0.9952

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

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	8.68%	1.58%	6.55%	1.60%	2.13%	-0.02%
自基金合同生效日起至今	-0.48%	1.47%	-5.72%	1.51%	5.24%	-0.04%

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

天弘中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2021年01月28日-2021年06月30日)



注：1、本基金合同于2021年01月28日生效，本基金合同生效起至披露时点不满1年。

2、按照本基金合同的约定，基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。本基金的建仓期为2021年01月28日至2021年07月27日，截止本报告期末本基金仍处于建仓期。

§ 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		
陈瑶	基金经理	2021	-	10	女，金融学硕士。2011年7

		年01 月		年	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。
沙川	基金经理	2021 年01 月	-	10 年	男，数学硕士。历任中国中投证券有限责任公司量化分析师。2013年9月加盟本公司，历任金融工程研究员。

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 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

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。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

本基金在2021年2季度按照基金合同约定采用完全复制的投资策略来控制跟踪误差。并适当减少交易成本，并参与新股申购，从而力争在跟踪误差允许范围内获取超额收益。

期间基金整体运行平稳，日均跟踪偏离和年化跟踪误差均控制在合理范围内。其中日均跟踪偏离和跟踪误差主要来自基金仓位相对基准的偏离，指数成分股调整导致的结构偏离以及持有的新股上市后涨幅与基准指数涨幅的差异。超额收益主要来自指数成分股分红、基金所申购新股上市后的较大幅度涨幅。由于成立时间不满6个月，所以未参与转融通证券出借业务，无相关利息收入。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2021年06月30日，本基金份额净值为0.9952元，本报告期份额净值增长率8.68%，同期业绩比较基准增长率6.55%。

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(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	582,788,612.39	97.35
	其中：股票	582,788,612.39	97.35
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	12,364,060.77	2.07

8	其他资产	3,472,322.05	0.58
9	合计	598,624,995.21	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）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
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	-	-
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	581,430,914.05	98.88
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	581,430,914.05	98.88

5.2.2 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	11,290.28	0.00

B	采矿业	-	-
C	制造业	1,151,378.14	0.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.00
E	建筑业	25,371.37	0.00
F	批发和零售业	73,523.22	0.01
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	18,247.24	0.00
J	金融业	34,721.10	0.01
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	30,146.60	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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,357,698.34	0.23

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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	300059	东方财富	2,828,783	92,755,794.57	15.77
2	600030	中信证券	2,959,400	73,807,436.00	12.55
3	600837	海通证券	3,353,800	38,568,700.00	6.56
4	601688	华泰证券	1,789,105	28,267,859.00	4.81
5	601211	国泰君安	1,566,900	26,856,666.00	4.57

6	600999	招商证券	1,289,000	24,516,780.00	4.17
7	601377	兴业证券	1,861,600	17,983,056.00	3.06
8	000776	广发证券	1,030,100	15,595,714.00	2.65
9	000166	申万宏源	3,131,900	14,657,292.00	2.49
10	600958	东方证券	1,450,700	14,492,493.00	2.46

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)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	688609	九联科技	10,372	158,587.88	0.03
2	688661	和林微纳	1,452	121,982.52	0.02
3	688575	亚辉龙	3,435	110,229.15	0.02
4	300957	贝泰妮	303	76,343.88	0.01
5	688533	上声电子	3,493	66,751.23	0.01

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

本基金本报告期末未持有股指期货。

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 本基金投资的前十名证券发行主体中，【广发证券股份有限公司】于2020年07月20日收到中国证券监督管理委员会广东监管局出具责令改正、暂停受理或办理业务的通报；【国泰君安证券股份有限公司】于2020年11月10日收到中国证券监督管理委员会上海监管局出具警示函的通报；【海通证券股份有限公司】分别于2020年09月10日、2020年12月24日、2021年02月07日、2021年04月26日收到中国证券监督管理委员会出具警示函的通报，于2021年03月31日收到中国证券监督管理委员会上海监管局出具责令改正、暂停受理或办理业务的通报；【华泰证券股份有限公司】于2020年11月23日收到中国证券监督管理委员会江苏监管局出具警示函的通报；【兴业证券股份有限公司】于2020年11月10日收到中国证券监督管理委员会福建监管局出具警示函的通报；【招商证券股份有限公司】于2020年08月18日收到中国证券监督管理委员会出具警示函的通报，于2020年11月20日收到上海证券交易所出具警示函的通报，于2021年05月26日收到中国人民银行深圳市中心支行出具公开处罚的通报；【中信证券股份有限公司】于2020年12月30日收到中国证券监督管理委员会出具警示函的通报，于2021年01月23日收到中国证券监督管理委员会深圳监管局出具责令改正的通报。

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	525,190.84
2	应收证券清算款	2,861,135.57
3	应收股利	-
4	应收利息	4,339.30
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	81,656.34
8	其他	-
9	合计	3,472,322.05

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 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

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	688609	九联科技	158,587.88	0.03	科创板打新限售
2	688661	和林微纳	121,982.52	0.02	科创板打新限售
3	688575	亚辉龙	110,229.15	0.02	科创板打新限售
4	300957	贝泰妮	76,343.88	0.01	创业板打新限售
5	688533	上声电子	66,751.23	0.01	科创板打新限售

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

单位：份

报告期期初基金份额总额	524,838,465.00
报告期期间基金总申购份额	673,800,000.00
减：报告期期间基金总赎回份额	607,800,000.00
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	590,838,465.00

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期基金管理人未持有本基金份额。

7.2 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 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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。

8.2 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。

§ 9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准天弘中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金募集的文件
- 2、天弘中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金基金合同
- 3、天弘中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金托管协议
- 4、天弘中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金招募说明书
- 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

9.2 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

9.3 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
二〇二一年七月二十一日