

天弘中证医药100指数型发起式证券投资基金

2021年第4季度报告

2021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

报告送出日期:2022年01月24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2022年01月20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10月01日起至2021年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	天弘中证医药100
基金主代码	001550
基金运作方式	契约型开放式、发起式
基金合同生效日	2015年06月30日
报告期末基金份额总额	1,195,318,625.93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。本基金投资策略主要包括大类资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、参与融资及转融通证券出借业务策略、存托凭证投资策略、其他金融工具投资策略。
业绩比较基准	中证医药100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	国泰君安证券股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	天弘中证医药100A	天弘中证医药100C
下属分级基金的交易代码	001550	001551
报告期末下属分级基金的份额总额	430, 101, 817. 84份	765, 216, 808. 09份

§ 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10月01日 - 2021年12月31日)	
	天弘中证医药100A	天弘中证医药100C
1. 本期已实现收益	-159, 978. 55	-530, 270. 70
2. 本期利润	12, 923, 862. 33	25, 038, 401. 10
3. 加权平均基金份额本期利润	0. 0302	0. 0340
4. 期末基金资产净值	478, 990, 112. 49	840, 127, 773. 05
5. 期末基金份额净值	1. 1137	1. 0979

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

天弘中证医药100A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	2. 58%	0. 92%	2. 13%	0. 93%	0. 45%	-0. 01%

过去六个月	-10.07%	1.25%	-11.67%	1.27%	1.60%	-0.02%
过去一年	-1.25%	1.31%	-4.68%	1.31%	3.43%	0.00%
过去三年	87.93%	1.41%	65.55%	1.43%	22.38%	-0.02%
过去五年	48.04%	1.34%	25.20%	1.36%	22.84%	-0.02%
自基金合同生效日起至今	11.37%	1.59%	4.74%	1.59%	6.63%	0.00%

天弘中证医药100C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	2.52%	0.92%	2.13%	0.93%	0.39%	-0.01%
过去六个月	-10.16%	1.25%	-11.67%	1.27%	1.51%	-0.02%
过去一年	-1.45%	1.31%	-4.68%	1.31%	3.23%	0.00%
过去三年	86.78%	1.41%	65.55%	1.43%	21.23%	-0.02%
过去五年	46.45%	1.34%	25.20%	1.36%	21.25%	-0.02%
自基金合同生效日起至今	9.79%	1.59%	4.74%	1.59%	5.05%	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

天弘中证医药100A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06月30日-2021年12月31日)



天弘中证医药100C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06月30日-2021年12月31日)



- 注：1、本基金合同于2015年06月30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	证	说明
----	----	--------	---	----

		基金经理期限		券从业年限	
		任职日期	离任日期		
贺雨轩	本基金基金经理	2021年07月	-	6年	男,通信与信息系统硕士。历任国信证券股份有限公司数据挖掘工程师,2016年10月加盟本公司,历任智能投资部研究员、指数与数量投资部高级研究员等。
沙川	本基金基金经理	2019年10月	2021年11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10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 报告期内基金的投资策略和运作分析

本基金在2021年4季度充分尊重基金合同约定，采用完全复制的投资策略来控制跟踪误差，尽力降低交易成本，同时参与新股申购和转融通证券出借业务，从而在跟踪误差允许范围内获取超额收益。

期间基金运行平稳，日均跟踪偏离和年化跟踪误差均控制在合理范围内，并取得了一定的超额收益。其中跟踪偏离和跟踪误差主要来自本基金每日的申购赎回导致的基金仓位变化和成分股调整导致的结构变化。超额收益主要来自本基金所申购的新股在上市后的涨幅贡献、基准指数成分股的分红、以及参与转融通业务获得的利息收入等。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2021年12月31日，天弘中证医药100A基金份额净值为1.1137元，天弘中证医药100C基金份额净值为1.0979元。报告期内份额净值增长率天弘中证医药100A为2.58%，同期业绩比较基准增长率为2.13%；天弘中证医药100C为2.52%，同期业绩比较基准增长率为2.13%。

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	1,259,149,771.75	94.01
	其中：股票	1,259,149,771.75	94.01
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	69,369,644.13	5.18
8	其他资产	10,907,587.14	0.81
9	合计	1,339,427,003.02	100.00

注：本报告期末，本基金参与转融通证券出借业务出借证券的公允价值为 196,558,606.00 元，占基金资产净值的比例为 14.90%。

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	1,028,145,973.07	77.94
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	105,361,587.49	7.99
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	63,229,678.74	4.79
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	60,061,950.28	4.55
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	1,256,799,189.58	95.28

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,406,562.60	0.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	4,713.80	0.00
F	批发和零售业	136,987.04	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	4,608.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	395,481.97	0.03
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	287,458.48	0.02
N	水利、环境和公共设施管理业	50,198.91	0.00
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	18,161.78	0.00
R	文化、体育和娱乐业	46,409.59	0.00
S	综合	-	-
	合计	2,350,582.17	0.18

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	603707	健友股份	510,249	21,430,458.00	1.62
2	300630	普利制药	378,195	20,815,852.80	1.58
3	000739	普洛药业	563,430	19,770,758.70	1.50
4	600566	济川药业	651,074	18,451,437.16	1.40
5	688298	东方生物	70,865	16,334,382.50	1.24
6	000999	华润三九	451,980	15,475,795.20	1.17
7	300841	康华生物	71,451	15,199,056.72	1.15
8	600085	同仁堂	321,932	14,480,501.36	1.10
9	603939	益丰药房	260,594	14,361,335.34	1.09
10	002653	海思科	702,447	14,329,918.80	1.09

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	688262	国芯科技	7,129	299,275.42	0.02
2	688553	汇宇制药	8,928	286,678.08	0.02
3	688087	英科再生	2,469	230,604.60	0.02
4	688670	金迪克	2,310	171,194.10	0.01
5	688265	南模生物	2,374	166,298.70	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，【南京健友生化制药股份有限公司】于 2021 年 12 月 21 日收到中国证券监督管理委员会江苏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	346,106.79
2	应收证券清算款	6,014,202.45
3	应收股利	-
4	应收利息	106,559.55
5	应收申购款	4,440,718.35
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	10,907,587.14

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

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600566	济川药业	4,990,674.00	0.38	转融通证券出借

2	603707	健友股份	4,720,800.00	0.36	转融通证券出借
3	688298	东方生物	4,448,650.00	0.34	转融通证券出借
4	300630	普利制药	4,298,624.00	0.33	转融通证券出借
5	000999	华润三九	3,519,872.00	0.27	转融通证券出借
6	002653	海思科	3,345,600.00	0.25	转融通证券出借
7	603939	益丰药房	2,694,879.00	0.20	转融通证券出借
8	000739	普洛药业	2,547,534.00	0.19	转融通证券出借
9	600085	同仁堂	2,195,024.00	0.17	转融通证券出借

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	688262	国芯科技	299,275.42	0.02	新股未上市
2	688553	汇宇制药	286,678.08	0.02	科创板打新限售
3	688087	英科再生	230,604.60	0.02	科创板打新限售
4	688670	金迪克	171,194.10	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

	天弘中证医药100A	天弘中证医药100C
--	------------	------------

报告期期初基金份额总额	415,362,550.44	669,700,187.88
报告期期间基金总申购份额	84,451,195.16	433,704,470.67
减：报告期期间基金总赎回份额	69,711,927.76	338,187,850.46
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	430,101,817.84	765,216,808.09

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

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 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

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06月30日至2018年06月30日。截至本报告期末，发起资金持有份额为0.00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

根据《企业会计准则第22号—金融工具确认和计量》（财会〔2017〕7号）、《企业会计准则第23号—金融资产转移》（财会〔2017〕8号）、《企业会计准则第24号—套期会计》（财会〔2017〕9号）、《企业会计准则第37号—金融工具列报》（财会〔2017〕14号）和《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》（财会〔2020〕22号）等相关规定，自2022年1月1日起，天弘基金管理有限公司旗下资产管理产品开始执行新金融工具相关会计准则。具体信息请参见基金管理人在规定媒介披露的《天弘基金管理有限公司关于旗下资产管理产品执行新金融工具相关会计准则的公告》。

§ 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中证医药100指数型发起式证券投资基金募集的文件
- 2、天弘中证医药100指数型发起式证券投资基金基金合同
- 3、天弘中证医药100指数型发起式证券投资基金托管协议
- 4、天弘中证医药100指数型发起式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

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
二〇二二年一月二十四日