

天弘中证 800 指数型发起式证券投资基金

2022 年中期报告

2022 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:广发证券股份有限公司

送出日期:2022 年 08 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。本中期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。

基金托管人广发证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年08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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2022年01月01日起至2022年06月30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	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
4.8 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	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 净资产（基金净值）变动表	18
6.4 报表附注	20
§7 投资组合报告	49
7.1 期末基金资产组合情况	49
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	50
7.3 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	52
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	78
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	80
7.6 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	80
7.7 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	81
7.8 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	81
7.9 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	81
7.10 本基金投资股指期货的投资政策	81
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	81
7.12 投资组合报告附注	81
§8 基金份额持有人信息	82
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	82
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	83

8.3 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.....	83
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	83
§9 开放式基金份额变动.....	83
§10 重大事件揭示.....	84
10.1 基金份额持有人大会决议.....	84
10.2 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.....	84
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	84
10.4 基金投资策略的改变.....	84
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	84
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	84
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	84
10.8 其他重大事件.....	85
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	86
11.1 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.....	87
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	87
§12 备查文件目录.....	88
12.1 备查文件目录.....	88
12.2 存放地点.....	88
12.3 查阅方式.....	88

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	天弘中证800指数型发起式证券投资基金	
基金简称	天弘中证800	
基金主代码	001588	
基金运作方式	契约型开放式、发起式	
基金合同生效日	2015年07月16日	
基金管理人	天弘基金管理有限公司	
基金托管人	广发证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	45,681,850.83份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	天弘中证800A	天弘中证800C
下属分级基金的交易代码	001588	001589
报告期末下属分级基金的份额总额	16,613,432.75份	29,068,418.08份

2.2 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，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。本基金产品投资策略主要包括大类资产配置、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等策略。
业绩比较基准	中证800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。

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	广发证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	童建林	崔瑞娟
	联系电话	022-83310208	020-66338888
	电子邮箱	service@thfund.com.cn	cuirj@gf.com.cn
客户服务电话		95046	95575
传真		022-83865569	020-87553363-6731
注册地址		天津自贸试验区（中心商务区）新华路3678号宝风大厦23层	广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街2号618室
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	广州市天河区马场路26号广发证券大厦34楼
邮政编码		300203	510627
法定代表人		韩歆毅	林传辉

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
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.thfund.com.cn
基金中期报告备置地点	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
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 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2022年01月01日-2022年06月30日)	
	天弘中证800A	天弘中证800C
本期已实现收益	55,350.94	68,178.37
本期利润	-1,417,115.31	-2,405,946.03
加权平均基金份额本期利润	-0.0909	-0.0916
本期加权平均净值利润率	-7.46%	-7.62%
本期基金份额净值增长率	-8.39%	-8.49%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2022年06月30日)	
期末可供分配利润	4,494,035.11	7,296,258.39
期末可供分配基金份额利润	0.2705	0.2510
期末基金资产净值	21,107,467.86	36,364,676.47
期末基金份额净值	1.2705	1.2510
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2022年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	27.05%	25.10%

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）扣除相关费用和信用减值损失后的余额，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

天弘中证800A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标	业绩比较 基准收益	业绩比较 基准收益	①-③	②-④

		准差②	率③	率标准差 ④		
过去一个月	9.33%	0.99%	8.54%	1.00%	0.79%	-0.01%
过去三个月	6.11%	1.39%	4.97%	1.40%	1.14%	-0.01%
过去六个月	-8.39%	1.38%	-9.43%	1.39%	1.04%	-0.01%
过去一年	-10.00%	1.15%	-11.50%	1.16%	1.50%	-0.01%
过去三年	39.94%	1.18%	19.47%	1.19%	20.47%	-0.01%
自基金合同 生效日起至 今	27.05%	1.31%	5.92%	1.32%	21.13%	-0.01%

天弘中证800C

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
过去一个月	9.31%	0.99%	8.54%	1.00%	0.77%	-0.01%
过去三个月	6.06%	1.39%	4.97%	1.40%	1.09%	-0.01%
过去六个月	-8.49%	1.38%	-9.43%	1.39%	0.94%	-0.01%
过去一年	-10.17%	1.15%	-11.50%	1.16%	1.33%	-0.01%
过去三年	39.08%	1.18%	19.47%	1.19%	19.61%	-0.01%
自基金合同 生效日起至 今	25.10%	1.31%	5.92%	1.32%	19.18%	-0.01%

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

天弘中证800A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16日-2022年06月30日)



天弘中证800C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16日-2022年06月30日)



- 注：1、本基金合同于2015年07月16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、深圳、四川、浙江设有分公司。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%

截至2022年6月30日，公司共管理运作160只公募基金，公司业务范围涵盖二级市场股票投资、债券投资、现金管理、衍生品投资等。公司始终秉承“稳健理财，值得信赖”的理念，坚持为投资者带来优质的基金产品和理财服务。

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		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张子法	本基金基金经理	2017年04月	-	15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1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

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策略跟踪指数，完全复制指数，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。

报告期内，本基金跟踪误差严格约束在基金合同的规定范围内，其来源主要是申购赎回、成分股调整、以及成分股分红和打新等因素。当由于申赎或打新锁定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基于风险控制的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。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2022年06月30日，天弘中证800A基金份额净值为1.2705元，天弘中证800C基金份额净值为1.2510元。报告期内份额净值增长率天弘中证800A为-8.39%，同期业绩比较基准增长率为-9.43%；天弘中证800C为-8.49%，同期业绩比较基准增长率为-9.43%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

回看上半年，受俄乌冲突、美国加息、疫情反复等因素影响，我国经济下行明显，为应对这些压力和实现2022年确立的政策目标，政府通过了一系列稳增长政策。回顾一下历程，在1、2月经济开门红后，本土疫情区域性反复，在动态清零和静态管理的应对措施下，物流和人流受到较大影响，3、4月边际下行，服务业及消费受到冲击，5月起常态化核酸检测的大范围推广统筹经济发展与疫情防控，实现人流和物流的有效修复，消费、出口、工业生产及服务业在5、6月出现显著反弹。展望下半年，结合429政治局会议、523稳住经济大盘会议等政策要求，我们认为常态化核酸检测可以有效保障经济修复，前期一系列稳增长政策将逐步兑现；结构上，制造业投资及基建投资是拉动经济增长的核心动力，受被动储蓄释放、政府消费拉动和刺激政策兑现影响，消费边际回升力度最大；政策方面，货币政策宽信用贯穿全年，宽货币可能存在从就业和增长目标向通胀切换进而适当回归中性，财政政策重在落实前期政策效果。概括来说，下半年政策宽松、流动性充裕是大方向，经济复苏也是大方向。

俄乌冲突、美联储加息超预期以及疫情冲击是上半年行情较大波动的主要影响因素，海外交易由滞涨向衰退演绎，全球权益市场纷纷下跌，A股指数V型反弹，随后走出独立行情。短期来看，随着市场主要指数均反弹至甚至超过疫情前的位置，疫情冲击后经济的环比修复预期已经被市场反映的比较充分，持续性反弹的动能弱化，市场可能维持区间震荡行情。中期来看，未来一个季度可能会看到中长期贷款增速的回升，届时市场可能会再度获得贝塔收益，但下半年资本市场仍然可能存在着受复苏不及预期，海外经济衰退等潜在因素的影响。

4.6 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。估值委员会成员由公司分管投资的高级管理人员、督察长、首席风控官、分管估值业务高级管理人员以及研究管理人员组成。

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（投资经理）、股票/债券研究员、基金运营部、风险管理部和内控合规部的相关人员组成。

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。

4.7 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。

4.8 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

2022年4月11日至2022年5月19日，本基金连续20个工作日基金资产净值低于5000万，未连续60个工作日基金资产净值低于5000万。

§ 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，本基金托管人在对天弘中证800指数型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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，天弘中证800指数型发起式证券投资基金的管理人——天弘基金管理有限公司在天弘中证800指数型发起式证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对天弘基金管理有限公司编制和披露的天弘中证800指数型发起式证券投资基金2022年中期报告中财务指标、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进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：天弘中证800指数型发起式证券投资基金

报告截止日：2022年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	3,180,003.57	2,824,212.19
结算备付金		2,661.71	46,832.82
存出保证金		10,917.81	13,339.09
交易性金融资产	6.4.7.2	54,766,346.21	48,203,138.83
其中：股票投资		54,758,445.52	48,142,842.73
基金投资		-	-
债券投资		7,900.69	60,296.10
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
其他投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-

债权投资		-	-
其中：债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
其他投资		-	-
其他债权投资		-	-
其他权益工具投资		-	-
应收清算款		172,049.56	54,326.58
应收股利		-	-
应收申购款		488,858.77	86,397.05
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.5	-	652.11
资产总计		58,620,837.63	51,228,898.67
负债和净资产	附注号	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付清算款		-	4,794.43
应付赎回款		1,038,550.13	168,811.64
应付管理人报酬		22,370.21	21,933.04
应付托管费		4,474.03	4,386.61
应付销售服务费		5,574.36	5,397.23
应付投资顾问费		-	-
应交税费		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.6	77,724.57	145,543.65
负债合计		1,148,693.30	350,866.60

净资产：			
实收基金	6.4.7.7	45,681,850.83	37,017,372.81
其他综合收益		-	-
未分配利润	6.4.7.8	11,790,293.50	13,860,659.26
净资产合计		57,472,144.33	50,878,032.07
负债和净资产总计		58,620,837.63	51,228,898.67

注：报告截止日2022年06月30日，天弘中证800指数型发起式证券投资基金A类基金份额净值1.2705元，天弘中证800指数型发起式证券投资基金C类基金份额净值1.2510元；基金份额总额45,681,850.83份，其中天弘中证800指数型发起式证券投资基金A类基金份额16,613,432.75份，天弘中证800指数型发起式证券投资基金C类基金份额29,068,418.08份。

6.2 利润表

会计主体：天弘中证800指数型发起式证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2022年01月01日至 2022年06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至202 1年06月30日
一、营业总收入		-3,561,053.34	2,538,135.87
1. 利息收入		11,337.01	12,214.12
其中：存款利息收入	6.4.7.9	11,337.01	12,195.76
债券利息收入		-	18.36
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）		373,040.94	3,366,984.77
其中：股票投资收益	6.4.7.10	-171,312.46	2,964,034.60

基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.11	20,590.14	12,012.02
资产支持证券投资 收益	6.4.7.12	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.13	-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	523,763.26	390,938.15
以摊余成本计量的 金融资产终止确认 产生的收益		-	-
其他投资收益		-	-
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.16	-3,946,590.65	-859,398.36
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.17	1,159.36	18,335.34
减：二、营业总支出		262,008.00	289,267.25
1. 管理人报酬		125,228.35	131,857.41
2. 托管费		25,045.62	26,371.45
3. 销售服务费		31,267.26	30,980.52
4. 投资顾问费		-	-
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 信用减值损失	6.4.7.18	-	-
7. 税金及附加		-	-
8. 其他费用	6.4.7.19	80,466.77	100,057.87
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		-3,823,061.34	2,248,868.62
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”		-3,823,061.34	2,248,868.62

号填列)			
五、其他综合收益的税后净额		-	-
六、综合收益总额		-3,823,061.34	2,248,868.62

6.3 净资产（基金净值）变动表

会计主体：天弘中证800指数型发起式证券投资基金

本报告期：2022年01月01日至2022年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产 (基金净值)	37,017,372.8 1	-	13,860,659.2 6	50,878,032.0 7
加：会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产 (基金净值)	37,017,372.8 1	-	13,860,659.2 6	50,878,032.0 7
三、本期增减变动额 (减少以“-”号填列)	8,664,478.02	-	-2,070,365.7 6	6,594,112.26
(一)、综合收益总额	-	-	-3,823,061.3 4	-3,823,061.3 4
(二)、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)	8,664,478.02	-	1,752,695.58	10,417,173.6 0
其中：1. 基金申购款	23,651,188.3 0	-	4,934,891.52	28,586,079.8 2
2. 基金赎回	-14,986,710.	-	-3,182,195.9	-18,168,906.

款	28		4	22
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	45,681,850.83	-	11,790,293.50	57,472,144.33
项 目	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日			
	实收基金	其他综合收益	未分配利润	净资产合计
一、上期期末净资产(基金净值)	41,698,216.55	-	14,627,604.15	56,325,820.70
加: 会计政策变更	-	-	-	-
前期差错更正	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
二、本期期初净资产(基金净值)	41,698,216.55	-	14,627,604.15	56,325,820.70
三、本期增减变动额(减少以“-”号填列)	-2,647,112.26	-	1,010,096.36	-1,637,015.90
(一)、综合收益总额	-	-	2,248,868.62	2,248,868.62
(二)、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)	-2,647,112.26	-	-1,238,772.26	-3,885,884.52
其中: 1. 基金申购款	27,365,860.62	-	10,217,516.17	37,583,376.79

2. 基金赎回款	-30,012,972.88	-	-11,456,288.43	-41,469,261.31
(三)、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)	-	-	-	-
(四)、其他综合收益结转留存收益	-	-	-	-
四、本期期末净资产(基金净值)	39,051,104.29	-	15,637,700.51	54,688,804.80

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4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

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

天弘中证800指数型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]1339号《关于准予天弘中证800指数型发起式证券投资基金注册的批复》注册,由天弘基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘中证800指数型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式发起式基金,存续期限不定,首次募集期间为2015年7月15日,首次设立募集不包括认购资金利息共募集10,000,000.00元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第959号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《天弘中证800指数型发起式证券投资基金基金合同》于2015年7月16日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为10,000,000.00份基金份额。本基金的基金管理人为天弘基金管理有限公司,基金托管人为广发证券股份有限公司。

根据《天弘中证800指数型发起式证券投资基金基金合同》和《天弘中证800指数型发起式证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金根据申购费用收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。认购/申购、赎回基金时收取认/申购费用、赎回费用,而不是从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为天弘中证800指数型发起式证券投资基金A类(以下简称“A类基金”);认购/申购、赎回基金时不收取认/申购费用、赎回费

用，而是在本类别基金资产中计提销售服务费的，称为天弘中证800指数型发起式证券投资基金C类(以下简称“C类基金”)。本基金A类和C类两种收费模式并存，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。投资者可自行选择申购某一类别的基金份额，但各类别基金份额之间不能相互转换。

本基金为发起式基金，基金募集份额总额不少于1,000万份，基金募集金额不少于1,000万元，其中基金管理人作为发起资金的提供方认购的金额为1,000万元且承诺持有期限不少于三年。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘中证800指数型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，以中证800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，本基金也可少量投资于其他股票（非标的指数成份股及其备选成份股，含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、银行存款、债券、债券回购、权证、股指期货、资产支持证券、货币市场工具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）。本基金可以根据相关法律法规的规定参与融资和转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金投资于股票的资产比例不低于基金资产的90%，投资于中证800指数成份股和备选成份股的资产比例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，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准：中证800指数收益率 \times 95%+银行活期存款利率(税后) \times 5%。

6.4.2 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》、《天弘中证800指数型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2022年度上半年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2022年06月30日的财务状况以及2022年度上半年的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

除6.4.4.1、6.4.4.2、6.4.4.3之外，本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.4.1 金融资产和金融负债的分类

新金融工具准则

金融工具，是指形成一方的金融资产并形成其他方的金融负债或权益工具的合同。当本基金成为金融工具合同的一方时，确认相关的金融资产或金融负债。

(1) 金融资产

金融资产于初始确认时分类为：以摊余成本计量的金融资产、以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产及以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。金融资产的分类取决于本基金管理金融资产的商业模式和金融资产的合同现金流量特征。本基金现无金融资产分类为以公允价值计量且其变动计入其他综合收益的金融资产。

债务工具

本基金持有的债务工具是指从发行方角度分析符合金融负债定义的工具，分别采用以下两种方式进行计量：

以摊余成本计量：

本基金管理以摊余成本计量的金融资产的商业模式为以收取合同现金流量为目标，且以摊余成本计量的金融资产的合同现金流量特征与基本借贷安排相一致，即在特定日期产生的现金流量，仅为对本金和以未偿付本金金额为基础的利息的支付。本基金持有的以摊余成本计量的金融资产主要为银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。

以公允价值计量且其变动计入当期损益：

本基金将持有的未划分为以摊余成本计量的债务工具，以公允价值计量且其变动计入当期损益。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主要为债券投资、资产支持证券投资，在资产负债表中以交易性金融资产列示。

权益工具

权益工具是指从发行方角度分析符合权益定义的工具。本基金将对其没有控制、共同控制和重大影响的权益工具(主要为股票投资)按照公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为交易性金融资产。

(2) 金融负债

金融负债于初始确认时分类为以摊余成本计量的金融负债和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。本基金持有的以摊余成本计量的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。

(3) 衍生金融工具

本基金将持有的衍生金融工具以公允价值计量且其变动计入当期损益，在资产负债表中列示为衍生金融资产/负债。

原金融工具准则(截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则)

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

(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、债券投资、资产支持证券投资和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。

6.4.4.2 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

新金融工具准则

金融资产或金融负债在初始确认时以公允价值计量。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产和金融负债，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，确认为应计利息，包含在交易性金融资产的账面价值中。对于其他类别的金融资产和金融负债，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。

本基金对于以摊余成本计量的金融资产，以预期信用损失为基础确认损失准备。

本基金考虑有关过去事项、当前状况以及对未来经济状况的预测等合理且有依据的信息，以发生违约的风险为权重，计算合同应收的现金流量与预期能收到的现金流量之间差额的现值的概率加权金额，确认预期信用损失。

于每个资产负债表日，本基金对于处于不同阶段的金融工具的预期信用损失分别进行计量。金融工具自初始确认后信用风险未显著增加的，处于第一阶段，本基金按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后信用风险已显著增加但尚未发生信用减值的，处于第二阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备；金融工具自初始确认后已经发生信用减值的，处于第三阶段，本基金按照该工具整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

对于在资产负债表日具有较低信用风险的金融工具，本基金假设其信用风险自初始确认后并未显著增加，认定为处于第一阶段的金融工具，按照未来12个月内的预期信用损失计量损失准备。

本基金对于处于第一阶段和第二阶段的金融工具，按照其未扣除减值准备的账面余额和实际利率计算利息收入。对于处于第三阶段的金融工具，按照其账面余额减已计提减值准备后的摊余成本和实际利率计算利息收入。

对于其他各类应收款项，无论是否存在重大融资成分，本基金均按照整个存续期的预期信用损失计量损失准备。

本基金将计提或转回的损失准备计入当期损益。

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。

原金融工具准则(截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则)

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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。

6.4.4.3 收入/（损失）的确认和计量

新金融工具准则

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。债券投资和资产支持证券投资在持有期间应取得的按票面利率（对于贴现债为按发行价计算的利率）或合同利率计算的利息扣除在适用情况下由债券和资产支持证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投资收益。

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相关交易费用及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。

本基金参与的转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司（以下简称“证金公司”）出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息确认为利息收入，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益。

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。

原金融工具准则（截至2021年12月31日前适用的原金融工具准则）

本基金于2022年1月1日起执行新金融工具准则，但选择不重述比较信息。因此，比较信息继续适用本基金以前年度的如下会计政策。

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。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。

本基金参与的转融通证券出借业务，是指基金以一定的费率通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司（以下简称“证金公司”）出借证券，证金公司到期归还所借证券及相应权益补偿并支付费用的业务。由于基金参与转融通证券出借业务不属于实质性证券转让行为，基金保留了出借证券所有权上几乎所有的风险和报酬，故不终止确认该出借证券，仍按原金融资产类别进行后续计量，并将出借证券获得的利息和因借入人未能按期归还产生的罚息确认为利息收入，将出借证券发生除送股、转增股份外其他权益事项时产生的权益补偿收入和采取现金清偿方式下产生的差价收入确认为投资收益。

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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于2017年颁布了修订后的《企业会计准则第22号—金融工具确认和计量》、《企业会计准则第23号—金融资产转移》、《企业会计准则第24号—套期会计》及《企业会计准则第37号—金融工具列报》（以下合称“新金融工具准则”），财政部、中国银行保险监督管理委员会于2020年12月30日发布了《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金自2022年1月1日起执行新金融工具准则。此外，中国证监会于2022年颁布了修订后的《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〉》，本基金的基金管理人已采用上述准则及通知编制本基金2022年度财务报表，对本基金财务报表的影响列示如下：

(a) 金融工具

根据新金融工具准则的相关规定，本基金对于首次执行该准则的累积影响数调整 2022 年年初留存收益以及财务报表其他相关项目金额，2021 年度的比较财务报表未重列。于 2021 年 12 月 31 日及 2022 年 1 月 1 日，本基金均没有指定为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。

(i) 于 2022 年 1 月 1 日，本财务报表中金融资产和金融负债按照原金融工具准则和新金融工具准则的规定进行分类和计量的结果如下：

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、应收利息、应收证券清算款和应收申购款，金额分别为 2,824,212.19 元、46,832.82 元、13,339.09 元、652.11 元、54,326.58 元和 86,397.05 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融资产为银行存款、结算备付金、存出保证金、其他资产-应收利息、应收清算款和应收申购款，金额分别为 2,824,832.85 元、46,856.03 元、13,345.69 元、0.00 元、54,326.58 元和 86,397.05 元。

原金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 48,203,138.83 元。新金融工具准则下以公允价值计量且其变动计入当期损益计量的金融资产为交易性金融资产，金额为 48,203,140.47 元。

原金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付证券清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 4,794.43 元、168,811.64 元、21,933.04 元、4,386.61 元、5,397.23 元、7,501.10 元和 8,042.55 元。新金融工具准则下以摊余成本计量的金融负债为应付清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付托管费、应付销售服务费、其他负债-应付交易费用和其他负债-其他应付款，金额分别为 4,794.43 元、168,811.64 元、21,933.04 元、4,386.61 元、5,397.23 元、7,501.10 元和 8,042.55 元。

i) 于 2021 年 12 月 31 日，本基金持有的“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等对应的应计利息余额均列示在“应收利息”或“应付利息”科目中。于 2022 年 1 月 1 日，本基金根据新金融工具准则下的计量类别，将上述应计利息分别转入“银行存款”、“结算备付金”、“存出保证金”、“交易性金融资产”、“买入返售金融资产”、“卖出回购金融资产款”等科目项下列示，无期初留存收益影响。

(b) 修订后的《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>》

根据中国证监会于 2022 年颁布的修订后的《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>》，本基金的基金管理人在编制本财务报表时调整了部分财务报表科目的列报和披露，这些调整未对本基金财务报表产生重大影响。

6.4.5.2 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。

6.4.5.3 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。

6.4.6 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。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末	
	2022年06月30日	
活期存款	3,180,003.57	
等于：本金	3,179,316.62	
加：应计利息	686.95	
减：坏账准备	-	
定期存款	-	
等于：本金	-	
加：应计利息	-	
减：坏账准备	-	
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	-	
等于：本金	-	
加：应计利息	-	
减：坏账准备	-	
合计	3,180,003.57	

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末			
	2022年06月30日			
	成本	应计利息	公允价值	公允价值变动
股票	54,435,789.24	-	54,758,445.52	322,656.28
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	-

债券	交易所市场	7,900.00	0.69	7,900.69	-
	银行间市场	-	-	-	-
	合计	7,900.00	0.69	7,900.69	-
资产支持证券		-	-	-	-
基金		-	-	-	-
其他		-	-	-	-
合计		54,443,689.24	0.69	54,766,346.21	322,656.28

注：股票投资的成本、公允价值及公允价值变动均包含中国存托凭证的成本、公允价值及公允价值变动。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.6 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	151.47
应付证券出借违约金	-
应付交易费用	5,106.33

其中：交易所市场	5,106.33
银行间市场	-
应付利息	-
预提费用	64,466.77
其他应付	8,000.00
合计	77,724.57

6.4.7.7 实收基金

6.4.7.7.1 天弘中证800A

金额单位：人民币元

项目 (天弘中证800A)	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	13,894,373.82	13,894,373.82
本期申购	5,767,520.60	5,767,520.60
本期赎回(以“-”号填列)	-3,048,461.67	-3,048,461.67
本期末	16,613,432.75	16,613,432.75

6.4.7.7.2 天弘中证800C

金额单位：人民币元

项目 (天弘中证800C)	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	23,122,998.99	23,122,998.99
本期申购	17,883,667.70	17,883,667.70
本期赎回(以“-”号填列)	-11,938,248.61	-11,938,248.61
本期末	29,068,418.08	29,068,418.08

注：申购含转换转入份额；赎回含转换转出份额。

6.4.7.8 未分配利润

6.4.7.8.1 天弘中证800A

单位：人民币元

项目 (天弘中证800A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	6,793,169.99	-1,417,533.47	5,375,636.52
本期利润	55,350.94	-1,472,466.25	-1,417,115.31
本期基金份额交易产生的变动数	1,329,352.73	-793,838.83	535,513.90
其中：基金申购款	2,817,383.36	-1,572,137.37	1,245,245.99
基金赎回款	-1,488,030.63	778,298.54	-709,732.09
本期已分配利润	-	-	-
本期末	8,177,873.66	-3,683,838.55	4,494,035.11

6.4.7.8.2 天弘中证800C

单位：人民币元

项目 (天弘中证800C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
本期期初	10,844,510.10	-2,359,487.36	8,485,022.74
本期利润	68,178.37	-2,474,124.40	-2,405,946.03
本期基金份额交易产生的变动数	2,780,886.82	-1,563,705.14	1,217,181.68
其中：基金申购款	8,367,397.80	-4,677,752.27	3,689,645.53
基金赎回款	-5,586,510.98	3,114,047.13	-2,472,463.85
本期已分配利润	-	-	-
本期末	13,693,575.29	-6,397,316.90	7,296,258.39

6.4.7.9 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
活期存款利息收入	11,122.35
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	110.95

其他	103.71
合计	11,337.01

6.4.7.10 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
卖出股票成交总额	3,807,088.51
减：卖出股票成本总额	3,965,302.10
减：交易费用	13,098.87
买卖股票差价收入	-171,312.46

6.4.7.11 债券投资收益

6.4.7.11.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
债券投资收益——利息收入	18.04
债券投资收益——买卖债券（债转股及债券到期兑付）差价收入	20,572.10
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	20,590.14

6.4.7.11.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	138,591.66
减：卖出债券（债	118,000.00

转股及债券到期兑付) 成本总额	
减: 应计利息总额	18.99
减: 交易费用	0.57
买卖债券差价收入	20,572.10

6.4.7.12 资产支持证券投资收益

本基金本报告期未取得资产支持证券投资收益。

6.4.7.13 贵金属投资收益

本基金本报告期未取得贵金属投资收益。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期未取得买卖权证差价收入。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期未取得其他衍生工具投资收益。

6.4.7.15 股利收益

单位: 人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
股票投资产生的股利收益	523,763.26
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	523,763.26

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位: 人民币元

项目名称	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
1. 交易性金融资产	-3,946,590.65

——股票投资	-3,946,294.55
——债券投资	-296.10
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——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	-3,946,590.65

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
基金赎回费收入	1,143.40
基金转换费收入	15.96
合计	1,159.36

6.4.7.18 信用减值损失

本基金本报告期内未发生信用减值损失。

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2022年01月01日至2022年06月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
指数使用费	16,000.00

合计	80,466.77
----	-----------

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 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。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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
广发证券股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30日		上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30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
广发证券 股份有限	-	-	21,177,846.83	100.00%

公司				
----	--	--	--	--

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2022年01月01日至2022年06月30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
-	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30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
广发证券股份有限公司	4,898.68	100.00%	2,149.41	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。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022年06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日

当期发生的基金应支付的管理费	125,228.35	131,857.41
其中：支付销售机构的客户维护费	35,194.56	35,550.21

注:1、支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值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×该日适用费率/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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2022年01月01日至2022 年06月30日	上年度可比期间 2021年01月01日至2021 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	25,045.62	26,371.45

注:支付基金托管人广发证券股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值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×该日适用费率/当年天数。

6.4.10.2.3 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 2022年01月01日至2022年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	天弘中证800A	天弘中证800C	合计
天弘基金 管理有限 公司	-	15,783.17	15,783.17
广发证券 股份有限 公司	-	169.68	169.68
合计	-	15,952.85	15,952.85

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	天弘中证800A	天弘中证800C	合计
天弘基金管理有限公司	-	17,786.16	17,786.16
广发证券股份有限公司	-	408.24	408.24
合计	-	18,194.40	18,194.40

注：1、支付基金销售机构的销售服务费按前一日各级基金资产净值的约定年费率计提，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。天弘中证800C按0.20%计提销售服务费。销售服务费的计算公式为：

日销售服务费 = 前一日各级基金资产净值 × 该日适用费率 / 当年天数。

2、天弘中证800A不收取销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金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。

6.4.10.4 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

6.4.10.4.1 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。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.5.2 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

本基金本报告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。

6.4.10.6 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 2022年01月01日至2022年06月30日		上年度可比期间 2021年01月01日至2021年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
广发证券股份有限公司	3,180,003.57	11,122.35	3,114,973.51	11,878.06

注：本基金由基金托管人广发证券股份有限公司保管的银行存款，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。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券交易。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本报告期末，本基金（因追踪指数成份股而被动）持有广发证券的股票5,700股（上年度末：4,900股），估值总额为人民币106,590.00元（上年度末：120,491.00元），占基金资产净值的比例为0.19%（上年度末：0.24%）；持有君正集团的股票6,500股（上年度末：5,600股），估值总额为人民币31,720.00元（上年度末：29,288.00元），占基金资产净值的比例为0.06%（上年度末：0.06%）。

6.4.11 利润分配情况——固定净值型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。

6.4.12 期末（2022年06月30日）本基金持有的流通受限证券**6.4.12.1 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

6.4.12.1.1 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	受限期	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113060	浙22转债	2022-06-14	1个月内(含)	新债未上市	100.00	100.01	70	7,000.00	7,000.52	-
127064	杭氧转债	2022-05-19	1-6个月(含)	新债未上市	100.00	100.02	9	900.00	900.17	-

6.4.12.2 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
002670	国盛金控	2022-06-01	未刊登重要事项(未如期刊登临时公告)	9.60	2022-07-14	9.99	2,200	22,007.49	21,120.00	-

注：本基金截至2022年06月30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。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2022年06月30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。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2022年06月30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。

6.4.12.4 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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型指数基金，采用指数复制投资策略，按照个股在标的指数中的基准权重构建股票组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应地调整，以复制和跟踪标的指数。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在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，力争获取高于标的指数的投资收益。

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。

6.4.13.2 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和定期存款存放在本基金的托管人广发证券股份有限公司开立于具有基金托管资格的银行的托管账户及其他具有基金托管资格的国有银行和大型股份制银行，并实施不同区间的额度管理，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金以非约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司出借证券，本基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近1年的分类结果为A类，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。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级的债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级的同业存单。

6.4.13.2.4 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 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
AAA	7,000.52	58,000.00
AAA以下	900.17	2,296.10
未评级	-	-
合计	7,900.69	60,296.10

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级的同业存单。

6.4.13.3 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2022年06月30日，本基金所承担的全部金融负债的合约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。

6.4.13.3.1 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时间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6.4.12。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%。本期末，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符合法律法规的相关要求。

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。本期末，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。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

本基金的管理人定期对组合中债券投资和资产支持证券投资部分面临的利率风险进行监控，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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2022 年 06 月 30 日	1 年以内	1-5 年	5 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,180,003.57	-	-	-	3,180,003.57
结算备付金	2,661.71	-	-	-	2,661.71
存出保证金	10,917.81	-	-	-	10,917.81
交易性金融资产	-	-	7,900.69	54,758,445.52	54,766,346.21
应收清算款	-	-	-	172,049.56	172,049.56
应收申购款	-	-	-	488,858.77	488,858.77
资产总计	3,193,583.09	-	7,900.69	55,419,353.85	58,620,837.63
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,038,550.13	1,038,550.13
应付管理人报酬	-	-	-	22,370.21	22,370.21
应付托管费	-	-	-	4,474.03	4,474.03
应付销售服务费	-	-	-	5,574.36	5,574.36
其他负债	-	-	-	77,724.57	77,724.57
负债总计	-	-	-	1,148,693.30	1,148,693.30
利率敏感度缺口	3,193,583.09	-	7,900.69	54,270,660.55	57,472,144.33
上年度末 2021 年 12 月 31 日					
资产					
银行存款	2,824,212.19	-	-	-	2,824,212.19
结算备付金	46,832.82	-	-	-	46,832.82
存出保证金	13,339.09	-	-	-	13,339.09
交易性金融资产	-	-	60,296.10	48,142,842.73	48,203,138.83
应收证券清算款	-	-	-	54,326.58	54,326.58
应收利息	-	-	-	652.11	652.11
应收申购款	-	-	-	86,397.05	86,397.05
资产总计	2,884,384.10	-	60,296.10	48,284,218.47	51,228,898.67
负债					
应付证券清算款	-	-	-	4,794.43	4,794.43
应付赎回款	-	-	-	168,811.64	168,811.64
应付管理人报酬	-	-	-	21,933.04	21,933.04
应付托管费	-	-	-	4,386.61	4,386.61
应付销售服务费	-	-	-	5,397.23	5,397.23

应付交易费用	-	-	-	7,501.10	7,501.10
其他负债	-	-	-	138,042.55	138,042.55
负债总计	-	-	-	350,866.60	350,866.60
利率敏感度缺口	2,884,384.10	-	60,296.10	47,933,351.87	50,878,032.07

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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2022年06月30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0.01% (2021年12月31日：0.12%)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响 (2021年12月31日：同)。

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，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。

本基金原则上采用完全复制法，跟踪中证800指数，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金投资组合，并根据标的指数组成及其权重的变动而进行相应调整。但因特殊情况 (如流动性不足等) 导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2022年06月30日		上年度末 2021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	54,758,445.52	95.28	48,142,842.73	94.62

产—股票投资				
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
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	54,758,445.52	95.28	48,142,842.73	94.62

6.4.13.4.3.2 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 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日
	业绩比较基准上升5%	2,968,436.25	2,519,262.17
	业绩比较基准下降5%	-2,968,436.25	-2,519,262.17

6.4.14 公允价值

6.4.14.1 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。

6.4.14.2 持续的以公允价值计量的金融工具

6.4.14.2.1 各层次金融工具的公允价值

金额单位：人民币元

公允价值计量结果所属的层次	本期末 2022年06月30日	上年度末 2021年12月31日

第一层次	54,737,325.52	48,118,773.56
第二层次	29,020.69	84,365.27
第三层次	-	-
合计	54,766,346.21	48,203,138.83

6.4.14.2.2 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。

6.4.14.3 非持续的以公允价值计量的金融工具的说明

于2022年06月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2021年12月31日：同)。

6.4.14.4 不以公允价值计量的金融工具的相关说明

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。

6.4.15 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

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。

§ 7 投资组合报告

7.1 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	54,758,445.52	93.41
	其中：股票	54,758,445.52	93.41
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	7,900.69	0.01

	其中：债券	7,900.69	0.01
	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	3,182,665.28	5.43
8	其他各项资产	671,826.14	1.15
9	合计	58,620,837.63	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	616,349.80	1.07
B	采矿业	1,723,935.46	3.00
C	制造业	32,858,678.46	57.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,425,181.50	2.48
E	建筑业	957,793.75	1.67
F	批发和零售业	611,482.84	1.06
G	交通运输、仓储和邮政业	1,426,547.10	2.48
H	住宿和餐饮业	27,280.00	0.05
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,282,967.15	3.97
J	金融业	9,371,096.41	16.31
K	房地产业	1,066,487.13	1.86
L	租赁和商务服务业	728,432.80	1.27
M	科学研究和技术服务业	789,094.72	1.37
N	水利、环境和公共设施管理业	93,950.23	0.16

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	20,844.00	0.04
Q	卫生和社会工作	404,061.30	0.70
R	文化、体育和娱乐业	221,402.20	0.39
S	综合	93,790.80	0.16
	合计	54,719,375.65	95.21

7.2.2 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	39,069.87	0.07
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	-	-
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	39,069.87	0.07

7.3 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

7.3.1 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	600519	XD贵州茅	1,300	2,658,500.00	4.63
2	300750	宁德时代	2,800	1,495,200.00	2.60
3	600036	招商银行	24,100	1,017,020.00	1.77
4	601318	中国平安	21,145	987,260.05	1.72
5	601012	隆基绿能	11,837	788,699.31	1.37
6	000858	五粮液	3,797	766,728.21	1.33
7	002594	比亚迪	1,800	600,282.00	1.04
8	000333	美的集团	9,486	572,859.54	1.00
9	601166	兴业银行	28,300	563,170.00	0.98
10	300059	东方财富	20,531	521,487.40	0.91
11	600900	长江电力	22,200	513,264.00	0.89
12	601888	中国中免	1,900	442,567.00	0.77
13	603259	药明康德	4,028	418,871.72	0.73
14	600030	中信证券	18,960	410,673.60	0.71
15	600887	伊利股份	9,900	385,605.00	0.67
16	000568	泸州老窖	1,500	369,810.00	0.64
17	002415	海康威视	9,175	332,135.00	0.58
18	601398	工商银行	68,100	324,837.00	0.57
19	002475	立讯精密	9,582	323,775.78	0.56
20	600276	恒瑞医药	8,615	319,530.35	0.56
21	600809	山西汾酒	980	318,304.00	0.55

22	300760	迈瑞医疗	1,000	313,200.00	0.54
23	600438	通威股份	5,200	311,272.00	0.54
24	000651	格力电器	9,200	310,224.00	0.54
25	600309	万华化学	3,080	298,729.20	0.52
26	002714	牧原股份	5,220	288,509.40	0.50
27	000725	京东方 A	72,900	287,226.00	0.50
28	000001	平安银行	18,800	281,624.00	0.49
29	002142	宁波银行	7,625	273,051.25	0.48
30	000002	万科 A	13,201	270,620.50	0.47
31	601328	交通银行	53,400	265,932.00	0.46
32	601899	紫金矿业	28,000	261,240.00	0.45
33	002129	TCL中环	4,400	259,116.00	0.45
34	000792	盐湖股份	8,400	251,664.00	0.44
35	002812	恩捷股份	1,000	250,450.00	0.44
36	603288	海天味业	2,764	249,755.04	0.43
37	002466	天齐锂业	2,000	249,600.00	0.43
38	600048	保利发展	13,900	242,694.00	0.42
39	603799	华友钴业	2,521	241,058.02	0.42
40	002460	赣锋锂业	1,601	238,068.70	0.41
41	300124	汇川技术	3,600	237,132.00	0.41
42	300015	爱尔眼科	5,290	236,833.30	0.41
43	002304	洋河股份	1,200	219,780.00	0.38
44	600031	三一重工	11,500	219,190.00	0.38
45	300014	亿纬锂能	2,245	218,887.50	0.38
46	601668	XD中国建	40,680	216,417.60	0.38
47	600436	片仔癀	600	214,038.00	0.37
48	601088	中国神华	6,400	213,120.00	0.37
49	002352	顺丰控股	3,800	212,078.00	0.37
50	300498	温氏股份	9,880	210,345.20	0.37
51	002271	东方雨虹	3,950	203,306.50	0.35
52	600690	海尔智家	7,300	200,458.00	0.35

53	300274	阳光电源	2,040	200,430.00	0.35
54	600089	特变电工	7,300	199,947.00	0.35
55	601816	京沪高铁	38,100	191,262.00	0.33
56	601288	农业银行	62,000	187,240.00	0.33
57	600837	海通证券	18,700	183,447.00	0.32
58	600000	浦发银行	22,800	182,628.00	0.32
59	600016	民生银行	48,240	179,452.80	0.31
60	603986	兆易创新	1,252	178,046.92	0.31
61	300122	智飞生物	1,600	177,616.00	0.31
62	688981	中芯国际	3,900	176,163.00	0.31
63	600406	国电南瑞	6,480	174,960.00	0.30
64	603501	韦尔股份	1,000	173,030.00	0.30
65	601919	中远海控	12,290	170,831.00	0.30
66	002049	紫光国微	900	170,748.00	0.30
67	601688	华泰证券	11,901	168,994.20	0.29
68	002709	天赐材料	2,708	168,058.48	0.29
69	600585	海螺水泥	4,701	165,851.28	0.29
70	000625	长安汽车	9,568	165,717.76	0.29
71	600919	江苏银行	22,950	163,404.00	0.28
72	000661	长春高新	700	163,394.00	0.28
73	600104	上汽集团	9,002	160,325.62	0.28
74	601225	陕西煤业	7,500	158,850.00	0.28
75	000063	中兴通讯	6,200	158,286.00	0.28
76	601601	中国太保	6,650	156,474.50	0.27
77	002241	歌尔股份	4,602	154,627.20	0.27
78	300142	沃森生物	3,100	150,009.00	0.26
79	002230	科大讯飞	3,600	148,392.00	0.26
80	600111	北方稀土	4,200	147,672.00	0.26
81	688599	天合光能	2,205	143,876.25	0.25
82	002459	晶澳科技	1,820	143,598.00	0.25
83	002371	北方华创	500	138,560.00	0.24

84	300450	先导智能	2,120	133,941.60	0.23
85	601988	中国银行	40,900	133,334.00	0.23
86	601211	国泰君安	8,700	132,240.00	0.23
87	002027	分众传媒	19,560	131,638.80	0.23
88	000338	潍柴动力	10,500	130,935.00	0.23
89	601169	北京银行	28,700	130,298.00	0.23
90	000100	TCL科技	27,200	130,288.00	0.23
91	600660	福耀玻璃	3,100	129,611.00	0.23
92	600745	闻泰科技	1,500	127,665.00	0.22
93	601229	上海银行	19,270	126,218.50	0.22
94	601985	中国核电	18,300	125,538.00	0.22
95	600050	中国联通	36,100	124,906.00	0.22
96	688169	石头科技	200	123,340.00	0.21
97	601766	中国中车	23,600	122,720.00	0.21
98	300769	德方纳米	300	122,604.00	0.21
99	600522	中天科技	5,300	122,430.00	0.21
100	601390	中国中铁	19,900	122,186.00	0.21
101	300896	爱美客	200	120,002.00	0.21
102	600893	航发动力	2,600	118,326.00	0.21
103	603659	璞泰来	1,400	118,160.00	0.21
104	601669	中国电建	14,800	116,476.00	0.20
105	300347	泰格医药	1,000	114,450.00	0.20
106	601658	邮储银行	21,100	113,729.00	0.20
107	601615	明阳智能	3,300	111,540.00	0.19
108	300661	圣邦股份	600	109,212.00	0.19
109	600009	上海机场	1,886	106,936.20	0.19
110	000776	广发证券	5,700	106,590.00	0.19
111	600028	中国石化	26,000	106,080.00	0.18
112	600196	复星医药	2,400	105,816.00	0.18
113	600905	三峡能源	16,600	104,414.00	0.18
114	601009	南京银行	10,000	104,200.00	0.18

115	600010	包钢股份	44,300	104,105.00	0.18
116	600019	XD宝钢股	17,292	104,097.84	0.18
117	002410	广联达	1,900	103,436.00	0.18
118	600958	东方证券	10,084	102,957.64	0.18
119	600999	招商证券	7,140	102,887.40	0.18
120	601628	中国人寿	3,300	102,564.00	0.18
121	600570	恒生电子	2,351	102,362.54	0.18
122	000596	古井贡酒	401	100,113.66	0.17
123	601857	中国石油	18,800	99,640.00	0.17
124	000895	双汇发展	3,400	99,620.00	0.17
125	601818	光大银行	32,100	96,621.00	0.17
126	002050	三花智控	3,513	96,537.24	0.17
127	002311	海大集团	1,600	96,016.00	0.17
128	300759	康龙化成	1,000	95,220.00	0.17
129	600760	中航沈飞	1,560	94,302.00	0.16
130	002179	中航光电	1,483	93,903.56	0.16
131	600256	广汇能源	8,900	93,806.00	0.16
132	688012	中微公司	797	93,049.75	0.16
133	601633	长城汽车	2,500	92,600.00	0.16
134	600346	恒力石化	4,120	91,628.80	0.16
135	300496	中科创达	700	91,336.00	0.16
136	002074	国轩高科	2,000	91,200.00	0.16
137	002493	荣盛石化	5,900	90,801.00	0.16
138	002920	德赛西威	600	88,800.00	0.15
139	600460	士兰微	1,700	88,400.00	0.15
140	300316	晶盛机电	1,300	87,867.00	0.15
141	688390	固德威	280	87,642.80	0.15
142	600763	通策医疗	500	87,220.00	0.15
143	002821	凯莱英	300	86,700.00	0.15
144	300782	卓胜微	640	86,400.00	0.15
145	600926	杭州银行	5,720	85,685.60	0.15

146	000538	云南白药	1,403	84,727.17	0.15
147	600426	华鲁恒升	2,890	84,388.00	0.15
148	002001	新和成	3,644	83,119.64	0.14
149	601989	中国重工	22,100	81,991.00	0.14
150	001979	招商蛇口	6,100	81,923.00	0.14
151	600176	中国巨石	4,701	81,844.41	0.14
152	000768	中航西飞	2,700	81,783.00	0.14
153	688111	金山办公	402	79,242.24	0.14
154	002202	金风科技	5,351	79,194.80	0.14
155	000963	华东医药	1,747	78,894.52	0.14
156	601939	建设银行	13,000	78,780.00	0.14
157	600096	云天化	2,500	78,700.00	0.14
158	300751	迈为股份	160	78,544.00	0.14
159	603993	洛阳钼业	13,700	78,501.00	0.14
160	603290	斯达半导	200	77,180.00	0.13
161	300012	华测检测	3,300	76,593.00	0.13
162	300207	欣旺达	2,400	75,840.00	0.13
163	601006	大秦铁路	11,500	75,785.00	0.13
164	601138	工业富联	7,700	75,768.00	0.13
165	600584	长电科技	2,800	75,600.00	0.13
166	000166	申万宏源	17,520	75,160.80	0.13
167	601877	正泰电器	2,100	75,138.00	0.13
168	002497	雅化集团	2,300	75,095.00	0.13
169	002407	多氟多	1,500	73,365.00	0.13
170	601377	兴业证券	10,400	73,320.00	0.13
171	600132	重庆啤酒	500	73,300.00	0.13
172	600588	用友网络	3,361	72,967.31	0.13
173	600600	青岛啤酒	700	72,744.00	0.13
174	002240	盛新锂能	1,200	72,432.00	0.13
175	601066	中信建投	2,500	72,275.00	0.13
176	601600	中国铝业	15,200	72,200.00	0.13

177	603806	福斯特	1,099	72,006.48	0.13
178	600029	南方航空	9,800	71,638.00	0.12
179	600741	华域汽车	3,100	71,300.00	0.12
180	600383	金地集团	5,300	71,232.00	0.12
181	600188	兖矿能源	1,800	71,064.00	0.12
182	002180	纳思达	1,400	70,868.00	0.12
183	601186	中国铁建	8,900	70,310.00	0.12
184	300390	天华超净	800	69,920.00	0.12
185	601838	成都银行	4,200	69,636.00	0.12
186	000786	北新建材	2,000	69,240.00	0.12
187	300408	三环集团	2,300	69,230.00	0.12
188	600085	同仁堂	1,300	68,744.00	0.12
189	600157	永泰能源	43,200	68,688.00	0.12
190	000009	中国宝安	5,020	67,719.80	0.12
191	600795	国电电力	17,300	67,643.00	0.12
192	601111	中国国航	5,800	67,338.00	0.12
193	000876	新希望	4,401	67,335.30	0.12
194	601117	中国化学	7,100	66,811.00	0.12
195	600885	DR宏发股	1,596	66,792.60	0.12
196	603019	中科曙光	2,300	66,746.00	0.12
197	600150	中国船舶	3,500	66,430.00	0.12
198	601238	广汽集团	4,300	65,532.00	0.11
199	600547	山东黄金	3,516	65,256.96	0.11
200	600141	兴发集团	1,480	65,105.20	0.11
201	300999	金龙鱼	1,200	64,824.00	0.11
202	688005	容百科技	500	64,720.00	0.11
203	601100	恒立液压	1,044	64,435.68	0.11
204	603613	国联股份	725	64,235.00	0.11
205	003816	中国广核	22,900	64,120.00	0.11
206	300763	锦浪科技	300	63,900.00	0.11
207	300073	当升科技	700	63,238.00	0.11

208	601800	XD中国交	6,800	63,104.00	0.11
209	600989	宝丰能源	4,300	62,995.00	0.11
210	603185	上机数控	400	62,396.00	0.11
211	002648	卫星化学	2,400	62,040.00	0.11
212	600015	华夏银行	11,900	61,999.00	0.11
213	002384	东山精密	2,700	61,911.00	0.11
214	600563	法拉电子	300	61,548.00	0.11
215	600392	盛和资源	2,710	61,246.00	0.11
216	603369	今世缘	1,200	61,200.00	0.11
217	600886	国投电力	5,800	60,900.00	0.11
218	002756	永兴材料	400	60,884.00	0.11
219	688099	晶晨股份	600	60,600.00	0.11
220	688180	君实生物	800	60,272.00	0.10
221	601788	光大证券	3,800	59,888.00	0.10
222	600011	华能国际	8,500	59,840.00	0.10
223	601868	中国能建	25,199	59,721.63	0.10
224	000301	东方盛虹	3,500	59,185.00	0.10
225	000157	中联重科	9,600	59,136.00	0.10
226	603260	合盛硅业	500	58,980.00	0.10
227	603486	科沃斯	480	58,507.20	0.10
228	688396	华润微	990	58,479.30	0.10
229	600418	江淮汽车	3,400	58,344.00	0.10
230	002236	大华股份	3,550	58,291.00	0.10
231	600115	中国东航	10,600	58,194.00	0.10
232	300601	康泰生物	1,280	57,830.40	0.10
233	603833	欧派家居	380	57,258.40	0.10
234	000425	徐工机械	10,600	57,134.00	0.10
235	002008	大族激光	1,700	56,321.00	0.10
236	002601	龙佰集团	2,800	56,140.00	0.10
237	605117	德业股份	200	55,978.00	0.10
238	600399	抚顺特钢	3,100	55,490.00	0.10

239	688122	西部超导	601	55,412.20	0.10
240	002555	三七互娱	2,600	55,198.00	0.10
241	600233	圆通速递	2,700	55,053.00	0.10
242	000938	紫光股份	2,823	54,766.20	0.10
243	300363	博腾股份	700	54,593.00	0.09
244	600941	中国移动	900	54,450.00	0.09
245	688008	澜起科技	896	54,279.68	0.09
246	601058	赛轮轮胎	4,800	54,096.00	0.09
247	600765	中航重机	1,680	54,062.40	0.09
248	603392	万泰生物	348	54,044.40	0.09
249	300285	国瓷材料	1,500	53,880.00	0.09
250	601916	浙商银行	16,200	53,784.00	0.09
251	300595	欧普康视	940	53,758.60	0.09
252	601555	东吴证券	7,747	53,686.71	0.09
253	601901	方正证券	8,000	53,680.00	0.09
254	600499	科达制造	2,600	53,664.00	0.09
255	002736	国信证券	5,600	53,592.00	0.09
256	600486	扬农化工	400	53,312.00	0.09
257	300628	亿联网络	700	53,305.00	0.09
258	600487	亨通光电	3,660	53,216.40	0.09
259	000983	山西焦煤	3,970	53,158.30	0.09
260	000977	浪潮信息	2,000	52,960.00	0.09
261	600732	爱旭股份	1,600	52,832.00	0.09
262	002841	视源股份	700	52,724.00	0.09
263	600352	浙江龙盛	5,100	51,918.00	0.09
264	300454	深信服	500	51,890.00	0.09
265	603456	九洲药业	1,000	51,700.00	0.09
266	601336	新华保险	1,601	51,536.19	0.09
267	300037	新宙邦	980	51,508.80	0.09
268	601799	星宇股份	300	51,300.00	0.09
269	600219	南山铝业	13,900	51,291.00	0.09

270	000069	华侨城 A	7,900	51,271.00	0.09
271	603077	和邦生物	12,000	51,120.00	0.09
272	300529	健帆生物	1,000	50,890.00	0.09
273	603345	安井食品	300	50,361.00	0.09
274	002268	卫士通	1,170	50,204.70	0.09
275	002385	大北农	6,400	49,984.00	0.09
276	601108	财通证券	6,310	49,659.70	0.09
277	300919	中伟股份	400	49,560.00	0.09
278	000519	中兵红箭	1,700	49,555.00	0.09
279	603882	金城医学	600	49,530.00	0.09
280	002007	华兰生物	2,155	49,134.00	0.09
281	300413	芒果超媒	1,470	49,039.20	0.09
282	601995	中金公司	1,100	48,939.00	0.09
283	002120	韵达股份	2,864	48,859.84	0.09
284	600298	安琪酵母	1,000	48,750.00	0.08
285	600845	宝信软件	889	48,539.40	0.08
286	601618	中国中冶	13,800	48,300.00	0.08
287	688126	沪硅产业	2,101	48,280.98	0.08
288	300033	同花顺	500	48,075.00	0.08
289	600862	XD中航高	1,700	47,770.00	0.08
290	300144	宋城演艺	3,080	47,278.00	0.08
291	601360	三六零	5,500	46,860.00	0.08
292	000630	铜陵有色	14,300	46,618.00	0.08
293	300003	乐普医疗	2,500	46,425.00	0.08
294	000988	华工科技	2,000	46,340.00	0.08
295	002252	上海莱士	7,800	46,254.00	0.08
296	603605	珀莱雅	280	46,250.40	0.08
297	601155	新城控股	1,800	45,774.00	0.08
298	300724	捷佳伟创	500	44,675.00	0.08
299	000703	恒逸石化	4,238	44,541.38	0.08
300	000783	长江证券	7,500	44,475.00	0.08

301	601077	渝农商行	12,000	44,400.00	0.08
302	002353	杰瑞股份	1,100	44,330.00	0.08
303	600332	白云山	1,400	44,226.00	0.08
304	688188	柏楚电子	200	44,008.00	0.08
305	601162	天风证券	13,830	43,979.40	0.08
306	601696	中银证券	3,300	43,890.00	0.08
307	601168	西部矿业	3,700	43,771.00	0.08
308	688777	中控技术	600	43,656.00	0.08
309	603026	XD石大胜	300	43,605.00	0.08
310	300957	贝泰妮	200	43,506.00	0.08
311	300146	汤臣倍健	2,000	43,300.00	0.08
312	601878	浙商证券	3,800	43,244.00	0.08
313	002625	光启技术	2,500	43,175.00	0.08
314	300433	蓝思科技	3,900	43,173.00	0.08
315	002028	思源电气	1,200	42,792.00	0.07
316	002056	横店东磁	1,600	42,592.00	0.07
317	300223	北京君正	400	42,500.00	0.07
318	002916	深南电路	452	42,356.92	0.07
319	002938	鹏鼎控股	1,400	42,294.00	0.07
320	002602	世纪华通	8,695	41,909.90	0.07
321	688363	华熙生物	294	41,800.92	0.07
322	002797	第一创业	6,500	41,665.00	0.07
323	600988	赤峰黄金	2,600	41,470.00	0.07
324	002507	涪陵榨菜	1,200	41,424.00	0.07
325	600489	中金黄金	5,600	41,384.00	0.07
326	600918	中泰证券	5,400	41,310.00	0.07
327	603589	口子窖	700	41,027.00	0.07
328	600521	华海药业	1,800	40,860.00	0.07
329	601021	春秋航空	700	40,845.00	0.07
330	601636	旗滨集团	3,200	40,800.00	0.07
331	000932	华菱钢铁	7,980	40,618.20	0.07

332	601128	常熟银行	5,300	40,492.00	0.07
333	603517	绝味食品	700	40,474.00	0.07
334	000066	中国长城	3,737	40,434.34	0.07
335	002185	华天科技	4,300	40,334.00	0.07
336	000708	中信特钢	2,000	40,300.00	0.07
337	603267	鸿远电子	300	40,299.00	0.07
338	002603	以岭药业	1,640	39,852.00	0.07
339	688185	康希诺	200	39,816.00	0.07
340	000830	鲁西化工	2,300	39,767.00	0.07
341	601607	上海医药	2,190	39,595.20	0.07
342	002326	永太科技	1,200	39,516.00	0.07
343	002078	太阳纸业	3,200	39,392.00	0.07
344	603899	晨光股份	700	39,256.00	0.07
345	601728	中国电信	10,500	39,165.00	0.07
346	600039	四川路桥	3,700	38,961.00	0.07
347	600546	山煤国际	2,000	38,920.00	0.07
348	002791	坚朗五金	300	38,916.00	0.07
349	603444	吉比特	100	38,800.00	0.07
350	600109	国金证券	4,300	38,700.00	0.07
351	600183	生益科技	2,265	38,482.35	0.07
352	601865	福莱特	1,000	38,100.00	0.07
353	002624	完美世界	2,650	38,080.50	0.07
354	603939	益丰药房	720	38,037.60	0.07
355	600153	建发股份	2,900	37,903.00	0.07
356	600549	厦门钨业	1,730	37,402.60	0.07
357	002422	科伦药业	2,000	37,400.00	0.07
358	601898	中煤能源	3,600	37,368.00	0.07
359	600348	华阳股份	2,400	37,104.00	0.06
360	600018	上港集团	6,300	36,729.00	0.06
361	000738	航发控制	1,300	36,530.00	0.06
362	000970	中科三环	1,940	36,433.20	0.06

363	601872	招商轮船	6,300	36,288.00	0.06
364	600875	东方电气	2,200	36,190.00	0.06
365	000999	华润三九	800	36,000.00	0.06
366	600705	中航产融	10,400	35,984.00	0.06
367	601990	南京证券	4,300	35,862.00	0.06
368	300676	华大基因	500	35,850.00	0.06
369	600497	驰宏锌锗	6,900	35,811.00	0.06
370	600177	雅戈尔	5,400	35,802.00	0.06
371	688036	传音控股	400	35,692.00	0.06
372	600362	江西铜业	2,000	35,660.00	0.06
373	300088	长信科技	4,800	35,616.00	0.06
374	689009	九号公司	800	35,600.00	0.06
375	002138	顺络电子	1,300	35,425.00	0.06
376	300699	光威复材	600	35,322.00	0.06
377	601699	潞安环能	2,400	35,088.00	0.06
378	000998	隆平高科	2,100	34,986.00	0.06
379	002508	老板电器	970	34,949.10	0.06
380	600160	巨化股份	2,650	34,847.50	0.06
381	000831	五矿稀土	1,100	34,375.00	0.06
382	002557	洽洽食品	600	34,158.00	0.06
383	603127	昭衍新药	300	34,140.00	0.06
384	002673	西部证券	5,200	34,008.00	0.06
385	600859	王府井	1,300	33,774.00	0.06
386	600516	方大炭素	4,433	33,690.80	0.06
387	002030	达安基因	1,958	33,658.02	0.06
388	000807	云铝股份	3,400	33,592.00	0.06
389	000960	锡业股份	2,000	33,540.00	0.06
390	600143	金发科技	3,500	33,320.00	0.06
391	002409	雅克科技	600	33,306.00	0.06
392	002414	高德红外	2,580	33,204.60	0.06
393	002572	索菲亚	1,200	33,000.00	0.06

394	600482	中国动力	2,100	32,991.00	0.06
395	000039	中集集团	2,380	32,963.00	0.06
396	002273	水晶光电	2,718	32,914.98	0.06
397	601997	贵阳银行	5,660	32,884.60	0.06
398	002465	海格通信	3,600	32,724.00	0.06
399	603198	迎驾贡酒	500	32,570.00	0.06
400	002568	百润股份	1,080	32,443.20	0.06
401	300136	信维通信	1,900	32,015.00	0.06
402	000975	银泰黄金	3,280	31,947.20	0.06
403	600061	国投资本	5,016	31,901.76	0.06
404	601216	君正集团	6,500	31,720.00	0.06
405	600536	中国软件	780	31,660.20	0.06
406	300832	新产业	700	31,577.00	0.05
407	000629	攀钢钒钛	8,300	31,540.00	0.05
408	600161	天坛生物	1,293	31,394.04	0.05
409	601319	中国人保	6,200	31,372.00	0.05
410	000728	国元证券	5,040	31,348.80	0.05
411	300058	蓝色光标	4,800	31,344.00	0.05
412	300357	我武生物	600	31,218.00	0.05
413	600170	上海建工	10,300	31,209.00	0.05
414	002092	中泰化学	4,000	31,040.00	0.05
415	603160	汇顶科技	500	30,965.00	0.05
416	601577	长沙银行	3,900	30,927.00	0.05
417	002294	信立泰	1,100	30,910.00	0.05
418	600704	物产中大	6,000	30,780.00	0.05
419	300474	景嘉微	450	30,775.50	0.05
420	002372	伟星新材	1,280	30,771.20	0.05
421	600739	辽宁成大	2,100	30,618.00	0.05
422	603195	公牛集团	200	30,582.00	0.05
423	300244	迪安诊断	980	30,478.00	0.05
424	601966	玲珑轮胎	1,200	30,444.00	0.05

425	600079	人福医药	1,902	30,432.00	0.05
426	300558	贝达药业	500	30,400.00	0.05
426	300418	昆仑万维	1,900	30,400.00	0.05
428	000636	风华高科	1,600	30,064.00	0.05
429	002739	万达电影	2,200	30,030.00	0.05
430	600315	上海家化	700	29,925.00	0.05
431	300253	卫宁健康	3,400	29,852.00	0.05
432	600699	均胜电子	1,900	29,849.00	0.05
433	000547	航天发展	2,497	29,814.18	0.05
434	000408	藏格矿业	900	29,646.00	0.05
435	688521	芯原股份	600	29,640.00	0.05
436	600415	小商品城	5,300	29,521.00	0.05
437	002223	鱼跃医疗	1,150	29,509.00	0.05
438	600606	绿地控股	7,440	29,462.40	0.05
439	002506	协鑫集成	7,900	29,388.00	0.05
440	300296	利亚德	4,000	29,200.00	0.05
441	600985	淮北矿业	2,000	29,120.00	0.05
442	600372	中航电子	1,500	29,085.00	0.05
443	300618	寒锐钴业	500	28,960.00	0.05
444	600867	通化东宝	2,800	28,952.00	0.05
445	600637	东方明珠	3,990	28,528.50	0.05
446	601198	东兴证券	3,200	28,480.00	0.05
447	600380	XD健康元	2,304	28,454.40	0.05
448	600655	豫园股份	3,000	28,320.00	0.05
449	601998	中信银行	5,900	28,025.00	0.05
450	600236	桂冠电力	4,600	28,014.00	0.05
451	300308	中际旭创	900	27,945.00	0.05
452	688561	奇安信	500	27,900.00	0.05
453	600026	中远海能	2,700	27,891.00	0.05
454	601016	节能风电	5,800	27,840.00	0.05
455	002683	广东宏大	1,000	27,830.00	0.05

456	002065	东华软件	4,400	27,808.00	0.05
457	002156	通富微电	1,800	27,720.00	0.05
458	002600	领益智造	5,500	27,610.00	0.05
459	000513	丽珠集团	761	27,555.81	0.05
460	600171	上海贝岭	1,100	27,533.00	0.05
461	002408	齐翔腾达	3,376	27,379.36	0.05
462	000887	中鼎股份	1,500	27,360.00	0.05
463	600258	XD首旅酒	1,100	27,280.00	0.05
464	600642	申能股份	4,800	27,264.00	0.05
465	600879	航天电子	4,200	27,258.00	0.05
466	600316	洪都航空	900	27,216.00	0.05
467	000623	吉林敖东	1,843	27,202.68	0.05
468	600038	中直股份	600	27,120.00	0.05
469	000729	燕京啤酒	2,800	27,048.00	0.05
470	300026	红日药业	3,500	26,950.00	0.05
471	000400	许继电气	1,400	26,880.00	0.05
472	002299	圣农发展	1,400	26,852.00	0.05
473	000750	国海证券	7,360	26,716.80	0.05
474	002936	郑州银行	9,903	26,639.07	0.05
475	002203	海亮股份	2,300	26,565.00	0.05
476	300866	安克创新	400	26,528.00	0.05
477	002985	北摩高科	451	26,419.58	0.05
478	600820	隧道股份	4,301	26,322.12	0.05
479	000878	云南铜业	2,300	26,197.00	0.05
480	603568	伟明环保	783	26,128.71	0.05
481	600673	东阳光	2,900	26,071.00	0.05
482	300383	光环新网	2,500	26,050.00	0.05
483	600580	卧龙电驱	1,799	25,941.58	0.05
484	601717	郑煤机	1,800	25,938.00	0.05
485	002439	启明星辰	1,300	25,909.00	0.05
486	688256	寒武纪	400	25,880.00	0.05

487	600801	华新水泥	1,320	25,753.20	0.04
488	603233	大参林	816	25,540.80	0.04
489	002131	利欧股份	13,100	25,414.00	0.04
490	600369	西南证券	6,400	25,408.00	0.04
491	603218	日月股份	1,000	25,400.00	0.04
492	002183	怡亚通	3,500	25,235.00	0.04
493	300017	网宿科技	4,700	25,192.00	0.04
494	600166	福田汽车	8,900	25,187.00	0.04
495	600848	上海临港	1,856	25,167.36	0.04
496	600529	山东药玻	900	25,155.00	0.04
497	002430	杭氧股份	800	25,008.00	0.04
498	300024	机器人	2,480	24,998.40	0.04
499	600325	华发股份	3,300	24,981.00	0.04
500	600909	华安证券	5,490	24,979.50	0.04
501	002195	二三四五	11,079	24,927.75	0.04
502	002958	青农商行	7,500	24,900.00	0.04
503	601005	重庆钢铁	13,000	24,830.00	0.04
504	000739	普洛药业	1,200	24,768.00	0.04
505	600027	华电国际	6,300	24,759.00	0.04
506	600008	首创环保	8,500	24,650.00	0.04
507	002444	巨星科技	1,300	24,492.00	0.04
508	002064	华峰化学	2,900	24,476.00	0.04
509	600025	华能水电	3,500	24,465.00	0.04
510	002373	千方科技	2,200	24,464.00	0.04
511	688029	南微医学	280	24,416.00	0.04
512	300677	英科医疗	960	24,345.60	0.04
513	002926	华西证券	3,100	24,304.00	0.04
514	300001	特锐德	1,400	24,234.00	0.04
515	601881	中国银河	2,500	24,175.00	0.04
516	600118	中国卫星	1,200	24,096.00	0.04
517	600271	航天信息	2,200	24,068.00	0.04

518	603087	甘李药业	500	23,985.00	0.04
519	000825	太钢不锈	4,400	23,980.00	0.04
520	000027	深圳能源	3,740	23,973.40	0.04
521	603658	安图生物	490	23,956.10	0.04
522	000050	深天马 A	2,400	23,928.00	0.04
523	688002	睿创微纳	599	23,792.28	0.04
524	002500	山西证券	4,130	23,706.20	0.04
525	002212	天融信	2,300	23,345.00	0.04
526	688009	中国通号	5,101	23,107.53	0.04
527	601866	中远海发	7,700	23,100.00	0.04
528	600863	内蒙华电	6,300	22,995.00	0.04
529	002250	联化科技	1,400	22,918.00	0.04
530	600208	新湖中宝	8,300	22,908.00	0.04
531	000060	中金岭南	5,100	22,746.00	0.04
532	002249	大洋电机	3,700	22,718.00	0.04
533	688065	凯赛生物	203	22,695.40	0.04
534	000778	新兴铸管	4,700	22,654.00	0.04
535	600998	九州通	1,900	22,629.00	0.04
536	600062	华润双鹤	880	22,580.80	0.04
537	002032	苏泊尔	400	22,536.00	0.04
538	600066	宇通客车	2,600	22,490.00	0.04
539	601992	金隅集团	8,100	22,437.00	0.04
540	300009	安科生物	2,216	22,403.76	0.04
541	002152	广电运通	2,400	22,248.00	0.04
542	603858	步长制药	1,124	22,154.04	0.04
543	000021	深科技	1,900	22,116.00	0.04
544	000401	冀东水泥	2,100	22,092.00	0.04
545	002966	苏州银行	3,620	22,082.00	0.04
546	300070	碧水源	4,232	22,048.72	0.04
547	300182	捷成股份	4,000	22,000.00	0.04
548	603156	养元饮品	964	21,902.08	0.04

549	002831	裕同科技	740	21,867.00	0.04
550	300251	光线传媒	2,300	21,781.00	0.04
551	300168	万达信息	2,300	21,712.00	0.04
552	603885	吉祥航空	1,200	21,588.00	0.04
553	600390	五矿资本	4,400	21,516.00	0.04
554	002128	电投能源	1,500	21,480.00	0.04
555	002191	劲嘉股份	2,000	21,440.00	0.04
556	600511	国药股份	800	21,424.00	0.04
557	002221	东华能源	2,300	21,413.00	0.04
558	600667	XD太极实	2,900	21,402.00	0.04
559	600970	中材国际	2,200	21,318.00	0.04
560	300482	万孚生物	520	21,169.20	0.04
561	603707	健友股份	750	21,150.00	0.04
562	000997	新大陆	1,600	21,136.00	0.04
563	002670	国盛金控	2,200	21,120.00	0.04
564	002505	鹏都农牧	6,200	21,018.00	0.04
565	600528	中铁工业	2,600	20,930.00	0.04
566	002607	中公教育	3,600	20,844.00	0.04
567	002244	滨江集团	2,400	20,760.00	0.04
568	600056	中国医药	1,400	20,748.00	0.04
569	600839	四川长虹	7,200	20,736.00	0.04
570	600598	北大荒	1,400	20,664.00	0.04
571	688289	圣湘生物	697	20,638.17	0.04
572	002155	湖南黄金	1,700	20,638.00	0.04
573	000987	越秀金控	2,935	20,633.05	0.04
574	000656	金科股份	7,200	20,592.00	0.04
575	600201	生物股份	2,247	20,582.52	0.04
576	600021	上海电力	2,000	20,500.00	0.04
577	600498	烽火通信	1,412	20,445.76	0.04
578	002396	星网锐捷	900	20,376.00	0.04
579	600297	广汇汽车	7,800	20,358.00	0.04

580	600155	华创阳安	2,400	20,352.00	0.04
581	002127	南极电商	3,800	20,292.00	0.04
582	600259	广晟有色	400	20,260.00	0.04
583	002266	浙富控股	4,200	20,118.00	0.04
584	000930	中粮科技	2,212	19,996.48	0.03
585	000012	南玻 A	2,690	19,959.80	0.03
586	300888	稳健医疗	300	19,950.00	0.03
587	688208	道通科技	602	19,817.84	0.03
588	600827	百联股份	1,500	19,815.00	0.03
589	600409	三友化工	2,400	19,656.00	0.03
590	002019	亿帆医药	1,401	19,585.98	0.03
591	000686	东北证券	2,800	19,572.00	0.03
592	600718	东软集团	1,700	19,567.00	0.03
593	002153	石基信息	1,232	19,551.84	0.03
594	600755	厦门国贸	2,600	19,500.00	0.03
595	000883	湖北能源	3,800	19,418.00	0.03
596	000581	威孚高科	1,000	19,250.00	0.03
597	002124	天邦食品	2,860	19,219.20	0.03
598	600566	济川药业	700	19,012.00	0.03
599	600959	江苏有线	5,824	18,986.24	0.03
600	600064	南京高科	1,720	18,920.00	0.03
601	600535	天士力	1,800	18,918.00	0.03
602	603712	七一二	600	18,900.00	0.03
602	600282	南钢股份	6,000	18,900.00	0.03
604	000690	宝新能源	4,300	18,834.00	0.03
605	002511	中顺洁柔	1,500	18,780.00	0.03
606	600060	海信视像	1,500	18,750.00	0.03
607	601179	中国西电	4,000	18,720.00	0.03
608	300376	易事特	2,300	18,676.00	0.03
609	600895	张江高科	1,500	18,675.00	0.03
610	600782	新钢股份	3,700	18,648.00	0.03

611	000709	河钢股份	8,200	18,532.00	0.03
612	601880	辽港股份	10,900	18,530.00	0.03
613	600022	山东钢铁	10,600	18,444.00	0.03
614	300463	迈克生物	900	18,441.00	0.03
615	601778	晶科科技	3,400	18,360.00	0.03
616	002939	长城证券	1,800	18,288.00	0.03
617	002701	奥瑞金	3,500	18,200.00	0.03
618	600728	佳都科技	2,800	18,088.00	0.03
619	002002	鸿达兴业	4,856	18,015.76	0.03
620	002468	申通快递	1,501	17,891.92	0.03
621	000598	兴蓉环境	3,500	17,885.00	0.03
622	002595	豪迈科技	800	17,872.00	0.03
623	600037	歌华有线	1,900	17,841.00	0.03
624	600500	中化国际	2,680	17,822.00	0.03
625	600808	马钢股份	4,700	17,813.00	0.03
626	300630	普利制药	506	17,785.90	0.03
627	600216	浙江医药	1,300	17,745.00	0.03
628	600517	国网英大	3,400	17,646.00	0.03
629	002532	天山铝业	2,700	17,631.00	0.03
630	600663	陆家嘴	1,700	17,612.00	0.03
631	002745	木林森	1,800	17,586.00	0.03
632	600567	山鹰国际	6,300	17,451.00	0.03
633	601236	红塔证券	1,890	17,255.70	0.03
634	601456	国联证券	1,400	17,178.00	0.03
635	002004	华邦健康	3,068	17,119.44	0.03
636	605499	东鹏饮料	100	17,086.00	0.03
637	000785	居然之家	3,800	16,910.00	0.03
638	300115	长盈精密	1,640	16,908.40	0.03
639	002429	兆驰股份	4,400	16,896.00	0.03
640	603866	桃李面包	1,019	16,864.45	0.03
641	000800	一汽解放	1,800	16,812.00	0.03

642	603225	新凤鸣	1,456	16,802.24	0.03
643	601958	金钼股份	1,900	16,796.00	0.03
644	601808	中海油服	1,200	16,740.00	0.03
645	603883	DR老百姓	494	16,736.72	0.03
646	002390	信邦制药	2,400	16,584.00	0.03
647	600597	光明乳业	1,300	16,419.00	0.03
648	300166	东方国信	1,780	16,411.60	0.03
649	601860	紫金银行	5,700	16,359.00	0.03
650	600507	方大特钢	2,340	16,356.60	0.03
651	300072	三聚环保	3,229	16,338.74	0.03
652	603927	中科软	700	16,324.00	0.03
653	601106	中国一重	5,300	16,271.00	0.03
654	002690	美亚光电	750	16,260.00	0.03
655	600398	海澜之家	3,400	16,150.00	0.03
656	002048	宁波华翔	1,000	16,020.00	0.03
657	600572	康恩贝	3,600	15,948.00	0.03
658	601718	际华集团	5,100	15,810.00	0.03
659	600737	中粮糖业	2,100	15,792.00	0.03
660	601118	海南橡胶	3,300	15,774.00	0.03
661	002368	太极股份	820	15,752.20	0.03
662	000937	冀中能源	2,100	15,666.00	0.03
663	000540	中天金融	8,100	15,633.00	0.03
664	600435	北方导航	1,800	15,516.00	0.03
665	600967	内蒙一机	1,700	15,504.00	0.03
666	000559	万向钱潮	2,600	15,444.00	0.03
667	000089	深圳机场	2,000	15,440.00	0.03
668	002705	新宝股份	700	15,393.00	0.03
669	600582	天地科技	3,200	15,296.00	0.03
670	600764	中国海防	600	15,144.00	0.03
671	688321	微芯生物	600	15,114.00	0.03
672	000898	鞍钢股份	4,660	15,005.20	0.03

673	600871	石化油服	7,900	14,931.00	0.03
674	002110	三钢闽光	2,450	14,920.50	0.03
675	601000	唐山港	5,778	14,907.24	0.03
676	000877	天山股份	1,200	14,760.00	0.03
677	000959	首钢股份	3,100	14,756.00	0.03
678	600329	达仁堂	600	14,748.00	0.03
679	300979	华利集团	200	14,616.00	0.03
680	601568	北元集团	2,280	14,455.20	0.03
681	601333	广深铁路	6,600	14,388.00	0.03
682	001914	招商积余	800	14,376.00	0.03
683	000156	华数传媒	1,800	14,346.00	0.02
684	603317	天味食品	502	14,291.94	0.02
685	000537	广宇发展	1,100	14,289.00	0.02
686	000402	金融街	2,400	14,280.00	0.02
687	600195	中牧股份	1,158	14,197.08	0.02
688	002233	塔牌集团	1,600	14,160.00	0.02
689	600811	东方集团	5,000	14,150.00	0.02
690	002010	传化智联	2,200	14,146.00	0.02
691	002281	光迅科技	800	14,064.00	0.02
692	688006	杭可科技	200	14,012.00	0.02
693	600556	天下秀	1,700	13,991.00	0.02
694	002867	周大生	900	13,977.00	0.02
695	003035	南网能源	2,200	13,970.00	0.02
696	300212	易华录	800	13,920.00	0.02
697	000488	晨鸣纸业	2,454	13,840.56	0.02
698	688819	天能股份	400	13,832.00	0.02
699	000685	中山公用	1,800	13,824.00	0.02
700	600126	杭钢股份	2,680	13,721.60	0.02
701	600120	浙江东方	3,419	13,710.19	0.02
702	002174	游族网络	1,400	13,678.00	0.02
703	603638	艾迪精密	660	13,530.00	0.02

704	600446	金证股份	1,300	13,494.00	0.02
705	600167	联美控股	1,790	13,407.10	0.02
706	002382	蓝帆医疗	1,400	13,370.00	0.02
707	601098	中南传媒	1,400	13,216.00	0.02
708	002081	金螳螂	2,600	13,208.00	0.02
709	000158	常山北明	2,200	13,200.00	0.02
710	000990	诚志股份	1,200	13,140.00	0.02
711	002925	盈趣科技	610	13,127.20	0.02
712	600707	彩虹股份	2,800	13,104.00	0.02
713	603650	彤程新材	400	13,032.00	0.02
714	002416	爱施德	1,400	13,020.00	0.02
715	601200	上海环境	1,280	13,004.80	0.02
716	600373	中文传媒	1,300	12,987.00	0.02
717	001965	招商公路	1,700	12,971.00	0.02
718	601608	中信重工	3,400	12,886.00	0.02
719	002387	维信诺	1,900	12,768.00	0.02
720	002146	荣盛发展	4,200	12,726.00	0.02
721	000967	盈峰环境	2,500	12,650.00	0.02
722	601611	中国核建	1,500	12,585.00	0.02
723	688088	虹软科技	397	12,541.23	0.02
724	600623	华谊集团	1,500	12,450.00	0.02
725	000528	柳工	1,910	12,434.10	0.02
726	002948	青岛银行	3,420	12,380.40	0.02
727	603000	人民网	1,100	12,320.00	0.02
728	002399	海普瑞	700	12,306.00	0.02
729	600095	湘财股份	1,600	12,304.00	0.02
730	600376	首开股份	2,497	12,260.27	0.02
731	600131	国网信通	900	12,105.00	0.02
732	002423	中粮资本	1,800	12,078.00	0.02
733	601598	中国外运	3,100	12,028.00	0.02
734	300257	开山股份	800	11,968.00	0.02

735	000563	陕国投 A	3,830	11,949.60	0.02
736	601187	厦门银行	2,000	11,920.00	0.02
737	601825	XD沪农商	1,900	11,913.00	0.02
738	600307	酒钢宏兴	6,100	11,834.00	0.02
739	600901	江苏租赁	2,300	11,799.00	0.02
740	600906	财达证券	1,300	11,687.00	0.02
741	601991	大唐发电	4,800	11,664.00	0.02
742	600006	东风汽车	1,500	11,325.00	0.02
743	603228	景旺电子	484	11,291.72	0.02
744	000961	中南建设	3,700	11,285.00	0.02
745	600717	天津港	2,790	11,187.90	0.02
746	002434	万里扬	1,300	11,115.00	0.02
747	000718	苏宁环球	3,000	11,040.00	0.02
748	002242	九阳股份	600	11,016.00	0.02
749	000553	安道麦A	900	10,899.00	0.02
750	601928	凤凰传媒	1,500	10,725.00	0.02
751	000671	阳光城	4,800	10,512.00	0.02
752	000415	渤海租赁	4,800	10,416.00	0.02
753	000031	大悦城	2,600	10,400.00	0.02
754	600968	海油发展	4,000	10,320.00	0.02
755	601969	海南矿业	1,200	10,308.00	0.02
756	601698	中国卫通	900	10,179.00	0.02
757	600787	中储股份	1,700	9,673.00	0.02
758	600835	上海机电	700	9,611.00	0.02
759	600928	西安银行	2,600	9,542.00	0.02
760	600339	中油工程	3,300	9,537.00	0.02
761	600648	外高桥	700	9,520.00	0.02
762	002563	森马服饰	1,600	9,472.00	0.02
763	601869	长飞光纤	300	9,276.00	0.02
764	002945	华林证券	600	9,150.00	0.02
765	002815	崇达技术	700	8,967.00	0.02

766	000028	国药一致	300	8,937.00	0.02
767	000869	张裕A	300	8,922.00	0.02
768	601228	广州港	2,400	8,808.00	0.02
769	001289	龙源电力	400	8,704.00	0.02
770	600377	宁沪高速	1,000	8,570.00	0.01
771	300869	康泰医学	300	8,478.00	0.01
772	000717	韶钢松山	2,400	8,400.00	0.01
773	300741	华宝股份	300	8,346.00	0.01
774	000062	深圳华强	650	8,255.00	0.01
775	600927	永安期货	400	8,068.00	0.01
776	603056	德邦股份	600	8,058.00	0.01
777	002653	海思科	500	8,055.00	0.01
778	603379	三美股份	360	8,010.00	0.01
779	601156	东航物流	400	7,920.00	0.01
780	001872	招商港口	500	7,800.00	0.01
781	600299	安迪苏	800	7,664.00	0.01
782	601298	青岛港	1,400	7,658.00	0.01
783	601139	深圳燃气	1,100	7,634.00	0.01
784	603868	飞科电器	100	7,575.00	0.01
785	603355	莱克电气	280	7,064.40	0.01
786	600823	世茂股份	2,200	6,556.00	0.01
787	603515	欧普照明	370	6,456.50	0.01
788	601828	美凯龙	1,050	6,363.00	0.01
789	600350	山东高速	1,200	6,300.00	0.01
790	603786	科博达	100	6,157.00	0.01
791	001227	兰州银行	1,200	5,904.00	0.01
792	603719	良品铺子	200	5,726.00	0.01
793	001203	大中矿业	500	5,650.00	0.01
794	002946	新乳业	400	5,196.00	0.01
795	601665	齐鲁银行	1,000	4,880.00	0.01
796	601003	柳钢股份	1,000	4,050.00	0.01

797	002901	大博医疗	100	3,914.00	0.01
798	600956	新天绿能	300	3,696.00	0.01
799	600917	重庆燃气	400	2,888.00	0.01
800	603983	丸美股份	100	2,680.00	0.00

7.3.2 期末积极投资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	601089	N福元	1,407	29,617.35	0.05
2	001268	N联合	341	9,452.52	0.02

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	600519	贵州茅台	544,328.00	1.07
2	300750	宁德时代	296,418.00	0.58
3	000792	盐湖股份	270,264.00	0.53
4	688536	思瑞浦	252,003.20	0.50
5	600036	招商银行	216,425.00	0.43
6	601318	中国平安	210,338.00	0.41
7	600089	特变电工	172,108.88	0.34
8	000858	五粮液	144,166.00	0.28
9	688169	石头科技	135,390.00	0.27
10	000333	美的集团	129,460.00	0.25
11	601012	隆基绿能	120,313.00	0.24
12	601166	兴业银行	118,170.00	0.23
13	300661	圣邦股份	115,717.00	0.23
14	600030	中信证券	115,051.80	0.23
15	300059	东方财富	112,562.00	0.22

16	600900	长江电力	105,571.00	0.21
17	300769	德方纳米	105,017.00	0.21
18	002594	比亚迪	101,539.00	0.20
19	688188	柏楚电子	97,936.00	0.19
20	601888	中国中免	94,797.00	0.19

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。

7.4.2 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	688536	思瑞浦	230,577.22	0.45
2	000733	振华科技	91,289.00	0.18
3	002340	格林美	76,284.00	0.15
4	688188	柏楚电子	59,344.00	0.12
5	000723	美锦能源	58,694.00	0.12
6	605358	立昂微	54,496.44	0.11
7	601689	拓普集团	53,655.00	0.11
8	600884	杉杉股份	50,769.00	0.10
9	001270	铖昌科技	50,591.76	0.10
10	600036	招商银行	47,064.00	0.09
11	002179	中航光电	46,771.00	0.09
12	600754	锦江酒店	46,420.00	0.09
13	002013	中航机电	44,659.00	0.09
14	000596	古井贡酒	44,412.00	0.09
15	601318	中国平安	44,325.00	0.09
16	300750	宁德时代	44,182.00	0.09
17	600938	中国海油	39,180.00	0.08
18	601888	中国中免	37,994.00	0.07
19	001227	兰州银行	37,465.72	0.07

20	000333	美的集团	36,939.00	0.07
----	--------	------	-----------	------

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。

7.4.3 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	14,527,199.44
卖出股票收入（成交）总额	3,807,088.51

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。

7.5 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)	7,900.69	0.01
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	7,900.69	0.01

7.6 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	113060	浙22转债	70	7,000.52	0.01
2	127064	杭氧转债	9	900.17	0.00

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 本基金投资股指期货的投资政策

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**7.11.1 本期国债期货投资政策**

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.11.2 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本基金投资的前十名证券发行主体中，【兴业银行股份有限公司】于2021年08月13日收到中国人民银行出具公开处罚的通报，于2022年03月21日收到中国银行保险监督管理委员会出具公开处罚的通报；【招商银行股份有限公司】于2022年03月21日收到中国银行保险监督管理委员会出具公开处罚的通报。

7.12.2 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。

7.12.3 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	10,917.81
2	应收清算款	172,049.56
3	应收股利	-
4	应收利息	-

5	应收申购款	488,858.77
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	671,826.14

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 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。

7.12.5.2 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。

7.12.6 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持有 人户 数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			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 中证8 00A	3,69 9	4,491.33	-	-	16,613,432.75	100.0 0%
天弘 中证8 00C	3,59 4	8,088.04	12,890,750.89	44.3 5%	16,177,667.19	55.65%

合计	7,145	6,393.54	12,890,750.89	28.22%	32,791,099.94	71.78%
----	-------	----------	---------------	--------	---------------	--------

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）。

8.2 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	天弘中证800A	18,095.45	0.11%
	天弘中证800C	2,086.32	0.01%
	合计	20,181.77	0.04%

8.3 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、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	天弘中证800A	0
	天弘中证800C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	天弘中证800A	0~10
	天弘中证800C	0
	合计	0~10

8.4 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07月16日至2018年07月16日。截至本报告期末，发起资金持有份额为0.00份。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	天弘中证800A	天弘中证800C
--	----------	----------

基金合同生效日(2015年07月16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	13,894,373.82	23,122,998.99
本报告期基金总申购份额	5,767,520.60	17,883,667.70
减:本报告期基金总赎回份额	3,048,461.67	11,938,248.61
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	16,613,432.75	29,068,418.08

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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,本基金的基金管理人未发生重大人事变动。

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。

10.3 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。

10.4 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。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生变化。

10.6 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、托管人的托管业务部门及其高级管理人员没有发生受稽查或处罚的情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	
东方财富证券	2	15,859,599.02	87.44%	6,806.24	87.44%	-
东兴证券	1	2,276,439.43	12.55%	977.79	12.56%	-
广发证券	2	2,424.00	0.01%	-	-	-

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：无。

4、本基金报告期内停止租用交易单元：无。

10.7.2 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

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	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
东方财富证券	117,134.96	57.28%	-	-	-	-	-	-
东兴证券	76,456.70	37.39%	-	-	-	-	-	-
广发证券	10,900.00	5.33%	-	-	-	-	-	-

10.8 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旗下资产管理产品执行新金融工具相关会计准则的公告	中国证券报、中国证监会指定媒介	2022-01-04
2	天弘中证800指数型发起式证券投资基金2021年第四季度报告	中国证券报、中国证监会指定媒介	2022-01-24
3	天弘基金管理有限公司运用固有资金投资旗下公募基金的公告	中国证券报、中国证监会指定媒介	2022-03-17
4	天弘中证800指数型发起式证券投资基金2021年年度报告	中国证券报、中国证监会指定媒介	2022-03-31
5	天弘基金管理有限公司关于调整旗下部分基金在基金销售机构及直销机构的单笔最低申购金额、单笔最低赎回份额及最低持有份额的公告	中国证券报、中国证监会指定媒介	2022-04-15
6	天弘中证800指数型发起式证券投资基金招募说明书（更新）	中国证券报、中国证监会指定媒介	2022-04-20
7	天弘中证800指数型发起式证券投资基金2022年第一季度报告	中国证券报、中国证监会指定媒介	2022-04-22
8	天弘基金管理有限公司关于终止深圳前海凯恩斯基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证券报、中国证监会指定媒介	2022-04-22
9	天弘基金管理有限公司关于设立浙江分公司公告	中国证券报、中国证监会指定媒介	2022-04-26
10	天弘基金管理有限公司关于注销天津理财中心的公告	中国证券报、中国证监会指定媒介	2022-05-06

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20220101-20220630	12,890,750.89	-	-	12,890,750.89	28.22%
产品特有风险							
<p>基金管理人秉承谨慎勤勉、独立决策、规范运作、充分披露原则，公平对待投资者，保障投资者合法权益。当单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%时，由此可能导致的特有风险主要包括：</p> <p>(1) 超出基金管理人允许的单一投资者持有基金份额比例的申购申请不被确认的风险；</p> <p>(2) 极端市场环境下投资者集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对赎回申请的风险；</p> <p>(3) 持有基金份额占比较高的投资者大额赎回可能引发基金净值大幅波动的风险；</p> <p>(4) 持有基金份额占比较高的投资者在召开基金份额持有人大会并对重大事项进行投票表决时，可能拥有较大话语权；</p> <p>(5) 极端情况下，持有基金份额占比较高的投资者大量赎回后，可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平，面临转换基金运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等风险。</p>							

注：份额占比精度处理方式四舍五入。

11.2 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》。

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，调整了本基金在基金销售机构及直销机构的单笔最低申购金额、单笔最低赎回份额及最低持有份额，并于2022年4月20日生效。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调整旗下部分基金在基金销售机构及直销机构的单笔最低申购金额、单笔最低赎回份额及最低持有份额的公告》。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准天弘中证800指数型发起式证券投资基金募集的文件
- 2、天弘中证800指数型发起式证券投资基金基金合同
- 3、天弘中证800指数型发起式证券投资基金托管协议
- 4、天弘中证800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

12.2 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

12.3 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
二〇二二年八月三十一日