

# 天弘沪深 300 交易型开放式指数证券投资基金

## 2021 年中期报告

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:招商证券股份有限公司

送出日期:2021 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。

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年08月27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2021年01月01日起至2021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	7
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
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	15
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	15
§6 中期财务会计报告(未经审计)	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	19
6.4 报表附注	20
§7 投资组合报告	75
7.1 期末基金资产组合情况	75
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	76
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	77
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	96
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	98
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	98
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	98
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	98
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	99
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	99
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	100
7.12 投资组合报告附注	100
§8 基金份额持有人信息	102
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	102
8.2 期末上市基金前十名持有人	102

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	103
8.4 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.....	103
§9 开放式基金份额变动.....	103
§10 重大事件揭示.....	103
10.1 基金份额持有人大会决议.....	103
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.....	103
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	104
10.4 基金投资策略的改变.....	104
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	104
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.....	104
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	104
10.8 其他重大事件.....	106
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	108
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.....	108
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	109
§12 备查文件目录.....	109
12.1 备查文件目录.....	109
12.2 存放地点.....	109
12.3 查阅方式.....	109

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	天弘300
场内简称	天弘300
基金主代码	515330
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019年12月05日
基金管理人	天弘基金管理有限公司
基金托管人	招商证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	5,045,709,496.00份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2019-12-26

### 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。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。本基金产品投资策略主要包括：债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、融资及转融通投资策略、存托凭证投资策略等。
业绩比较基准	沪深300指数收益率
风险收益特征	本基金属股票型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	天弘基金管理有限公司	招商证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	童建林
	联系电话	022-83310208
	电子邮箱	service@thfund.com.cn
客户服务电话	95046	95565
传真	022-83865569	0755-82960794
注册地址	天津自贸区（中心商务区）响螺湾旷世国际大厦A座1704-241号	深圳市福田区福田街道福华一路111号
办公地址	天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层	深圳市福田区福田街道福华一路111号
邮政编码	300203	518000
法定代表人	胡晓明	霍达

注：在本报告截止日至报告批准送出日之间，法定住所变更为：天津自贸试验区（中心商务区）新华路3678号宝风大厦23层；法定代表人变更为：韩歆毅。

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网	www.thfund.com.cn

址	
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	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

## § 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 (2021年01月01日- 2021年06月30日)	
	本期已实现收益	344,583,194.47
本期利润	97,655,476.07	
加权平均基金份额本期利润	0.0210	
本期加权平均净值利润率	1.55%	
本期基金份额净值增长率	1.06%	
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2021年06月30日)	
	期末可供分配利润	1,103,955,411.69
	期末可供分配基金份额利润	0.2188
	期末基金资产净值	6,850,761,417.94
	期末基金份额净值	1.3577
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2021年06月30日)	
	基金份额累计净值增长率	35.77%

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	-1.49%	0.81%	-2.02%	0.80%	0.53%	0.01%
过去三个月	4.32%	0.98%	3.48%	0.98%	0.84%	0.00%
过去六个月	1.06%	1.31%	0.24%	1.31%	0.82%	0.00%
过去一年	28.77%	1.32%	25.46%	1.33%	3.31%	-0.01%
自基金合同生效日起至今	35.77%	1.36%	35.70%	1.37%	0.07%	-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



天弘沪深300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

(2019年12月05日-2021年06月30日)



注：1、本基金合同于2019年12月05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、天津、深圳、四川设有分公司。公司股权结构为：

股东名称	股权比例
蚂蚁科技集团股份有限公司	51%
天津信托有限责任公司	16.8%
内蒙古君正能源化工集团股份有限公司	15.6%
芜湖高新投资有限公司	5.6%
新疆天瑞博丰股权投资合伙企业（有限合伙）	3.5%
新疆天惠新盟股权投资合伙企业（有限合伙）	2%
新疆天阜恒基股权投资合伙企业（有限合伙）	2%
新疆天聚宸兴股权投资合伙企业（有限合伙）	3.5%
合计	100%

截至2021年6月30日，本基金管理人共管理117只基金：天弘精选混合型证券投资基金、天弘永利债券型证券投资基金、天弘永定价值成长混合型证券投资基金、天弘周期策略混合型证券投资基金、天弘文化新兴产业股票型证券投资基金、天弘添利债券型证券投资基金（LOF）、天弘丰利债券型证券投资基金（LOF）、天弘现金管家货币市场基金、天弘债券型发起式证券投资基金、天弘安康颐养混合型证券投资基金、天弘余额宝货币市场基金、天弘稳利定期开放债券型证券投资基金、天弘弘利债券型证券投资基金、天弘通利混合型证券投资基金、天弘同利债券型证券投资基金（LOF）、天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金、天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金、天弘云端生活优选灵活配置混合型证券投资基金、天弘新活力灵活配置混合型发起式证券投资基金、天弘互联网灵活配置混合型证券投资基金、天弘惠利灵活配置混合型证券投资基金、天弘新价值灵活配置混合型证券投资基金、天弘云商宝货币市场基金、天弘医疗健康混合型证券投资基金、天弘中证医药100指数型发起式证券投资基金、天弘中证500指数增强型证券投资基金、天弘中证证券保险指数型发起式证券投资基金、天弘中证银行交易型开放式指数证券投资基金联接基金、天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金、天弘上证50指数型发起式证券投资基金、天弘中证800指数型发起式证券投资基金、天弘中证电子交易型开放式指数证券投资基金联接基金、天弘中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金联接基金、天弘中证食品饮料指数型发起式证券投资基金、天弘弘运宝货币市场基金、天弘裕利灵活配置混合型证券投资基金、天弘价值精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、天弘信利债券型证券投资基金、天弘策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、天弘优选债券型证券投资基金、天弘尊享定期开放债券型发起式证券投资基金、天弘悦享定期开放债券型发起式证券投资基金、天弘荣享定期开放债券型发起式证券投资基金、天弘弘丰增强回报债券型证券投资基金、天弘港股通精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、天弘增强回报债券型证券投资基金、天弘安益债券型证券投资基金、天弘华享三个月定期开放债券型发起式

证券投资基金、天弘弘择短债债券型证券投资基金、天弘信益债券型证券投资基金、天弘养老目标日期2035三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、天弘弘新混合型发起式证券投资基金、天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金、天弘标普500发起式证券投资基金（QDII-FOF）、天弘优质成长企业精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、天弘鑫利三年定期开放债券型证券投资基金、天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金、天弘中证红利低波动100指数型发起式证券投资基金、天弘季季兴三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、天弘中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金、天弘沪深300指数增强型发起式证券投资基金、天弘越南市场股票型发起式证券投资基金（QDII）、天弘中证电子交易型开放式指数证券投资基金、天弘中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金、天弘增利短债债券型发起式证券投资基金、天弘恒享一年定期开放债券型发起式证券投资基金、天弘纯享一年定期开放债券型发起式证券投资基金、天弘中债1-3年国开行债券指数发起式证券投资基金、天弘永裕稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、天弘鑫意39个月定期开放债券型证券投资基金、天弘兴享一年定期开放债券型发起式证券投资基金、天弘中证中美互联网指数型发起式证券投资基金（QDII）、天弘中债3-5年政策性金融债指数发起式证券投资基金、天弘成享一年定期开放债券型证券投资基金、天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金、天弘永裕平衡养老目标三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、天弘甄选食品饮料股票型发起式证券投资基金、天弘创新领航混合型证券投资基金、天弘聚新三个月定期开放混合型证券投资基金、天弘荣创一年持有期混合型证券投资基金、天弘智荟6个月持有期债券型证券投资基金、天弘中证科技100指数增强型发起式证券投资基金、天弘多元收益债券型证券投资基金、天弘多利一年定期开放混合型证券投资基金、天弘安利短债债券型证券投资基金、天弘安康颐和混合型证券投资基金、天弘合益债券型发起式证券投资基金、天弘中证银行交易型开放式指数证券投资基金、天弘国证消费100指数增强型发起式证券投资基金、天弘医药创新混合型证券投资基金、天弘睿新三个月定期开放混合型证券投资基金、天弘庆享债券型发起式证券投资基金、天弘中证智能汽车主题指数型发起式证券投资基金、天弘中证农业主题指数型发起式证券投资基金、天弘国证生物医药指数型发起式证券投资基金、天弘中证全指证券公司交易型开放式指数证券投资基金、天弘中证光伏产业指数型发起式证券投资基金、天弘中证光伏产业交易型开放式指数证券投资基金、天弘创新成长混合型发起式证券投资基金、天弘国证A50指数型发起式证券投资基金、天弘中证全指医疗保健设备与服务交易型开放式指数证券投资基金、天弘益新混合型证券投资基金、天弘招添利混合型发起式证券投资基金、天弘消费股票型发起式证券投资基金、天弘中证新能源汽车指数型发起式证券投资基金、天弘中债1-5年政策性金融债指数发起式证券投资基金、天弘先进制造混合型证券投资基金、天弘创业板300指数型发起式证券投资基金、天弘创业板300交易型开放式指数证券投资基金、天弘安怡30天滚动持有短债债券型发起式证券投资基金、天弘安盈

一年持有期债券型发起式证券投资基金、天弘京津冀主题债券型发起式证券投资基金、天弘中证新材料主题交易型开放式指数证券投资基金、天弘兴益一年定期开放债券型发起式证券投资基金、天弘安康颐享12个月持有期混合型证券投资基金、天弘国证生物医药交易型开放式指数证券投资基金、天弘中证全指医疗保健设备与服务指数型发起式证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈瑶	基金经理	2019年12月	-	10年	女，金融学硕士。2011年7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。
杨超	指数与数量投资部副总经理、基金经理	2019年12月	-	11年	男，金融数学与计算硕士。历任建信基金管理有限责任公司基金经理助理、泰达宏利基金管理有限公司基金经理。2019年1月加盟本公司。
张子法	基金经理	2019年12月	-	14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、在本报告截止日至报告批准送出日之间，张子法先生、杨超先生不再担任本基金基金经理。

3、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 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的方式跟踪指数，完全复制标的指数，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。

出于基金充分投资、减少交易成本、降低跟踪误差的需要，基于谨慎原则报告期内本基金运用股指期货工具对基金投资组合进行管理。根据风险管理的原则，本基金在报告期内运用股指期货工具旨在提高投资效率，控制基金投资组合风险水平，力求更好地实现本基金的投资目标。

报告期内，本基金跟踪误差的来源主要是申购赎回、打新、成分股调整导致的权重偏离因素。当由于申赎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组合优化相结合的方式跟踪指数，同时紧密跟踪成分股的权息事件，及时有效处理，避免权重偏离造成跟踪误差的扩大。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2021年06月30日，本基金份额净值为1.3577元，本报告期份额净值增长率1.06%，同期业绩比较基准增长率0.24%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

今天上半年经济仍然处于不断修复的趋势，但下半年宏观经济仍存在不确定性，制造业PMI虽然仍处于荣枯线上，但已经连续4个月回落，洪涝灾害和疫情反复对非制造业的修复可能产生影响。政策上，7月初降准是为了给中小企业减负，下半年仍有再次降准的可能性，传递宏观经济政策不会收紧的信号，但也不会过于放松，从中长期的角度，仍然需要控制宏观杠杆率的过快上涨，对利率环境保持警惕。

由于经济的不确定性，市场风险偏好有所收敛，股票市场行情可能仍以风格分化的形式进行演绎。但对于估值过高的板块需要保持警惕，关注其业绩对其股价的兑现能力；对于前期调整幅度较大，回落到配置价值的板块可以予以关注，逐步配置。

#### 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。估值委员会由公司分管固定收益投资的高级管理人员、督察长、分管估值业务的IT运维总监、投资研究部负责人组成。

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

基金经理作为估值工作小组的成员之一，在基金估值定价过程中，充分表达对相关问题及定价方案的意见或建议，参与估值方案提议的制定。但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

报告期内，本基金管理人未与任何第三方签订与估值相关的定价服务协议。

#### 4.7 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

本报告期内本基金管理人无应说明预警信息。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，招商证券股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了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遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支及利润分配等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。

#### 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

本托管人复核审查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。

### § 6 中期财务会计报告(未经审计)

#### 6.1 资产负债表

会计主体：天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2021年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
<b>资 产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	44,805,438.05	33,863,114.40
结算备付金		8,056,466.22	8,970,917.87
存出保证金		6,463,892.86	6,483,383.03
交易性金融资产	6.4.7.2	6,802,328,633.38	5,893,966,469.45
其中：股票投资		6,797,193,344.58	5,889,799,469.45
基金投资		-	-
债券投资		5,135,288.80	4,167,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		13,662,019.11	49,163,094.69
应收利息	6.4.7.5	362,999.94	352,784.03
应收股利		742,799.18	239.80
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	75,616.24	-
资产总计		6,876,497,864.98	5,992,800,003.27
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2021年06月30日</b>	<b>上年度末 2020年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-



应付证券清算款		21,058,578.63	48,638,429.70
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		2,764,227.07	2,429,212.62
应付托管费		552,845.42	485,842.54
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	677,785.41	634,733.51
应交税费		26,198.74	37,422.46
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	656,811.77	647,168.02
负债合计		25,736,447.04	52,872,808.85
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	5,045,709,496.00	4,421,709,496.00
未分配利润	6.4.7.10	1,805,051,921.94	1,518,217,698.42
所有者权益合计		6,850,761,417.94	5,939,927,194.42
负债和所有者权益总计		6,876,497,864.98	5,992,800,003.27

注：报告截止日2021年06月30日，基金份额净值1.3577元，基金份额总额5,045,709,496.00份。

## 6.2 利润表

会计主体：天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021年01月01日至 2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至202 0年06月30日
一、收入		120,189,700.88	339,256,639.00
1. 利息收入		6,909,995.36	395,160.15
其中：存款利息收入	6.4.7.11	352,264.22	300,676.77
债券利息收入		1,988.43	-

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		6,555,742.71	94,483.38
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		356,153,112.81	96,612,421.17
其中：股票投资收益	6.4.7.12	303,178,974.95	31,828,580.31
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	1,930,727.02	-
资产支持证券投资 收益	6.4.7.13. 3	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	1,616,419.81	-293,123.88
股利收益	6.4.7.16	49,426,991.03	65,076,964.74
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-246,927,718.40	241,205,250.46
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	4,054,311.11	1,043,807.22
<b>减：二、费用</b>		22,534,224.81	20,856,506.31
1. 管理人报酬		15,599,385.71	14,103,466.25
2. 托管费		3,119,877.08	2,820,693.31
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	6.4.7.19	2,595,160.08	2,852,965.19
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 税金及附加		40,851.70	3,352.62
7. 其他费用	6.4.7.20	1,178,950.24	1,076,028.94

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		97,655,476.07	318,400,132.69
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		97,655,476.07	318,400,132.69

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	4,421,709,496.00	1,518,217,698.42	5,939,927,194.42
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	97,655,476.07	97,655,476.07
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	624,000,000.00	189,178,747.45	813,178,747.45
其中：1. 基金申购款	1,485,000,000.00	527,809,449.75	2,012,809,449.75
2. 基金赎回款	-861,000,000.00	-338,630,702.30	-1,199,630,702.30
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	-	-	-
五、期末所有者权益（基金净值）	5,045,709,496.00	1,805,051,921.94	6,850,761,417.94
项 目	上年度可比期间		

	2020年01月01日至2020年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	4,238,709,496.00	121,369,248.72	4,360,078,744.72
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	318,400,132.69	318,400,132.69
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	1,314,000,000.00	-137,791,312.92	1,176,208,687.08
其中:1.基金申购款	3,150,000,000.00	-113,870,022.74	3,036,129,977.26
2.基金赎回款	-1,836,000,000.00	-23,921,290.18	-1,859,921,290.18
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益 (基金净值)	5,552,709,496.00	301,978,068.49	5,854,687,564.49

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

天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金(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[2019]1044号《关于准予天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》准予注册,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《天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金

基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币236,708,830.00元(含募集股票市值)，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(2019)第0653号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于2019年12月5日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为236,709,496.00份基金份额，其中认购资金利息折合666.00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，基金托管人为招商证券股份有限公司。

根据《天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2019]293号文审核同意，本基金236,709,496.00份基金份额于2019年12月26日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。此外，为更好地实现基金的投资目标，本基金还可以投资于国内依法发行上市的非成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、存托凭证、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、货币市场工具、同业存单、债券回购、资产支持证券、银行存款、股指期货以及法律法规或中国证监会允许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)。本基金可根据相关法律法规和基金合同的约定，参与融资和转融通证券出借业务。基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数的成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%，且不低于非现金基金资产的80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率。

本基金的基金管理人天弘基金管理有限公司以本基金为目标ETF，将原天弘沪深300指数型发起式证券投资基金转型为天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“天弘沪深300ETF联接基金”)。天弘沪深300ETF联接基金为契约型开放式基金，投资目标与本基金类似，将绝大多数基金资产投资于本基金。

#### 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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、

《天弘沪深300交易型开放式指数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2021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2021年06月30日的财务状况以及2021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

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。

#### 6.4.5 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 2021年06月30日	
	活期存款	44,805,438.05
定期存款	-	
其中：存款期限1个月以内	-	
存款期限1-3个月	-	
存款期限3个月以上	-	
其他存款	-	
合计	44,805,438.05	

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	5,936,097,216.02	6,797,193,344.58	861,096,128.56

贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-	
债券	交易所市场	5,038,600.00	5,135,288.80	96,688.80
	银行间市场	-	-	-
	合计	5,038,600.00	5,135,288.80	96,688.80
资产支持证券	-	-	-	
基金	-	-	-	
其他	-	-	-	
合计	5,941,135,816.02	6,802,328,633.38	861,192,817.36	

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	41,180,460.00	-	-	-
股指期货	41,180,460.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	41,180,460.00	-	-	-

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为0。本报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细为：IF2107买入持仓量23手，合约市值人民币35,819,280.00元，公允价值变动人民币858,840.00元，IF2108买入持仓量4手，合约市值人民币6,212,400.00元，公允价值变动人民币-7,620.00元。

#### 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 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应收活期存款利息	18,612.72
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	2,570.86
应收债券利息	382.69
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	340,794.57
其他	639.10
合计	362,999.94

#### 6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
其他应收款	-
待摊费用	75,616.24
合计	75,616.24

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末	
	2021年06月30日	
交易所市场应付交易费用	677,785.41	
银行间市场应付交易费用	-	
合计	677,785.41	

## 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	
	2021年06月30日	
应付券商交易单元保证金	-	
应付赎回费	-	
应付证券出借违约金	-	
预提费用	168,603.31	
其他应付	488,208.46	
合计	656,811.77	

## 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期	
	2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,421,709,496.00	4,421,709,496.00
本期申购	1,485,000,000.00	1,485,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-861,000,000.00	-861,000,000.00
本期末	5,045,709,496.00	5,045,709,496.00

## 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	625,209,205.98	893,008,492.44	1,518,217,698.42
本期利润	344,583,194.47	-246,927,718.40	97,655,476.07

本期基金份额交易产生的变动数	134,163,011.24	55,015,736.21	189,178,747.45
其中：基金申购款	284,163,485.69	243,645,964.06	527,809,449.75
基金赎回款	-150,000,474.45	-188,630,227.85	-338,630,702.30
本期已分配利润	-	-	-
本期末	1,103,955,411.69	701,096,510.25	1,805,051,921.94

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	
	2021年01月01日至2021年06月30日	
活期存款利息收入	280,703.49	
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	58,179.64	
其他	13,381.09	
合计	352,264.22	

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期	
	2021年01月01日至2021年06月30日	
股票投资收益——买卖股票差价收入	180,076,233.13	
股票投资收益——赎回差价收入	123,102,741.82	
股票投资收益——申购差价收入	-	
股票投资收益——证券出借差价收入	-	
合计	303,178,974.95	

##### 6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2021年01月01日至2021年06月30日
卖出股票成交总额	1,161,627,353.16
减：卖出股票成本总额	981,551,120.03
买卖股票差价收入	180,076,233.13

#### 6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
赎回基金份额对价总额	1,199,630,702.30
减：现金支付赎回款总额	475,350,507.30
减：赎回股票成本总额	601,177,453.18
赎回差价收入	123,102,741.82

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	1,930,727.02
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	1,930,727.02

##### 6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	18,539,969.39

减：卖出债券（、 债转股及债券到期 兑付）成本总额	16,607,300.00
减：应收利息总额	1,942.37
买卖债券差价收入	1,930,727.02

#### 6.4.7.13.3 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。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期未取得贵金属投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

##### 6.4.7.15.1 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。

##### 6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2021年01月01日至2021年06月30日
期货投资	1,616,419.81

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
股票投资产生的股利收益	49,426,991.03
其中：证券出借权益补偿收入	3,174,551.35
基金投资产生的股利收益	-
合计	49,426,991.03

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
1. 交易性金融资产	-245,936,278.40
——股票投资	-246,032,967.20
——债券投资	96,688.80
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-991,440.00
——权证投资	-
——期货投资	-991,440.00
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	-246,927,718.40

## 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
基金赎回费收入	-
ETF基金替代损益	4,054,311.11
合计	4,054,311.11

## 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
交易所市场交易费用	2,595,160.08
银行间市场交易费用	-
合计	2,595,160.08

## 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
审计费用	59,507.37
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	-
指数使用费	935,963.17
IOPV计算发布费	49,588.57
ETF登记结算费	74,383.76
合计	1,178,950.24

## 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
招商证券股份有限公司	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
天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金	本基金的联接基金

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 2021年01月01日至2021年06月30日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020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
招商证券股份有限公司	1,047,081,581.09	39.16%	2,343,155,869.55	76.75%

## 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 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
招商证券股份有限公司	449,778.42	39.06%	46,274.76	6.83%
关联方名称	上年度可比期间 2020年01月01日至2020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



招商证券 股份有限 公司	891,982.37	74.45%	446,476.61	64.90%
--------------------	------------	--------	------------	--------

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 2021年01月01日至2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	15,599,385.71	14,103,466.25
其中：支付销售机构的客户维护费	1,419.37	-

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 2021年01月01日至2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	3,119,877.08	2,820,693.31

注：支付基金托管人招商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。

**6.4.10.3 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**

份额单位：份

关联方名称	本期末 2021年06月30日		上年度末 2020年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金	4,958,908,800.00	98.28%	4,352,783,800.00	98.44%
招商证券股份有限	2,978,497.00	0.06%	6,999,397.00	0.16%

公司				
----	--	--	--	--

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

#### 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 2021年01月01日至2021年06月30日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020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
招商证券股份有限公司	44,805,438.05	280,703.49	29,215,243.01	218,798.47

注：本基金由基金托管人招商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

金额单位：人民币元

本期 2021年01月01日至2021年06月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张/股）	总金额
招商证券股份有限公司	605368	蓝天燃气	网下申购	1,204	18,011.84
招商证券股份有限公司	601963	重庆银行	网下申购	7,472	80,921.76
招商	003037	三和管桩	网下申购	1,274	8,128.12

证券 股份 有限 公司					
招商 证券 股份 有限 公司	688059	华锐精密	网下申购	1,023	37,943.07
招商 证券 股份 有限 公司	300960	通业科技	网下申购	2,332	28,170.56
招商 证券 股份 有限 公司	001201	东瑞股份	网下申购	477	30,232.26
招商 证券 股份 有限 公司	300991	创益通	网下申购	2,535	33,107.10
招商 证券 股份 有限 公司	688517	金冠电气	网下申购	2,892	22,297.32
上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日					
关联 方名 称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张 /股）	总金额

招商 证券 股份 有限 公司	688106	金宏气体	网下申购	26,075	403,641.00
----------------------------	--------	------	------	--------	------------

#### 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）持有君正集团的股票，估值总额为人民币5,464,624.00元（上年度末：5,023,260.00元），占基金资产净值的比例为0.08%（上年度末：0.08%）；持有招商证券的股票，估值总额为人民币22,461,307.62元（上年度末：25,917,459.54元），占基金资产净值的比例为0.33%（上年度末：0.44%）。

#### 6.4.11 利润分配情况——按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

本基金本报告期无利润分配事项。

#### 6.4.12 期末（2021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：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688317	之江生物	2021-01-08	2021-07-19	科创板打新限售	43.22	63.82	5,740	248,082.80	366,326.80	-
300957	贝泰妮	2021-03-18	2021-09-27	创业板打新限售	47.33	251.96	853	40,372.49	214,921.88	-
688677	海泰新光	2021-02-18	2021-08-26	科创板打新限售	35.76	103.23	1,768	63,223.68	182,510.64	-

688687	凯因科技	2021-01-29	2021-08-09	科创板打新限售	18.98	27.98	5,354	101,618.92	149,804.92	-
300919	中伟股份	2020-12-15	2021-07-02	创业板打新限售	24.60	163.00	610	15,006.00	99,430.00	-
300979	华利集团	2021-04-15	2021-10-26	创业板打新限售	33.22	87.50	925	30,728.50	80,937.50	-
688662	富信科技	2021-03-25	2021-10-08	科创板打新限售	15.61	29.51	2,556	39,899.16	75,427.56	-
688663	新风光	2021-04-06	2021-10-13	科创板打新限售	14.48	19.21	3,279	47,479.92	62,989.59	-
688350	富淼科技	2021-01-21	2021-07-28	科创板打新限售	13.58	22.44	2,552	34,656.16	57,266.88	-
688191	智洋创新	2021-03-30	2021-10-08	科创板打新限售	11.38	17.74	3,203	36,450.14	56,821.22	-
688239	航宇科技	2021-06-25	2021-07-05	新股未上市	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48	-
300981	中红医疗	2021-04-19	2021-10-27	创业板打新限售	48.59	90.39	601	29,202.59	54,324.39	-

				售						
688087	英科再生	2021-06-30	2021-07-09	新股未上市	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
301017	漱玉平民	2021-06-23	2021-07-05	新股未上市	8.86	8.86	5,550	49,173.00	49,173.00	-
301020	密封科技	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	10.64	10.64	4,210	44,794.40	44,794.40	-
300973	立高食品	2021-04-08	2021-10-15	创业板打新限售	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60	-
688597	煜邦电力	2021-06-09	2021-12-17	科创板打新限售	5.88	10.16	3,907	22,973.16	39,695.12	-
688067	爱威科技	2021-06-07	2021-12-16	科创板打新限售	14.71	24.83	1,259	18,519.89	31,260.97	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	9.46	9.46	2,899	27,424.54	27,424.54	-
300953	震裕科技	2021-03-11	2021-09-22	创业板打新限售	28.77	99.85	240	6,904.80	23,964.00	-
301009	可靠股份	2021-06-08	2021-12-17	创业板打新限售	12.54	27.89	801	10,044.54	22,339.89	-

300941	创识科技	2021-02-02	2021-08-09	创业板打新限售	21.31	49.94	399	8,502.69	19,926.06	-
301015	N百洋	2021-06-22	2021-12-30	创业板打新限售	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
688226	威腾电气	2021-06-28	2021-07-07	新股未上市	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
300932	三友联众	2021-01-15	2021-07-22	创业板打新限售	24.69	31.71	492	12,147.48	15,601.32	-
300982	苏文电能	2021-04-19	2021-10-27	创业板打新限售	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300614	百川畅银	2021-05-18	2021-11-25	创业板打新限售	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300937	药易购	2021-01-20	2021-07-27	创业板打新限售	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-
300942	易瑞生物	2021-02-02	2021-08-09	创业板打新限售	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-
300997	欢乐家	2021-05-26	2021-12-02	创业板打新限售	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-



				售						
300933	中辰股份	2021-01-15	2021-07-22	创业板打新限售	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
301002	崧盛股份	2021-05-27	2021-12-07	创业板打新限售	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
605287	德才股份	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
300955	嘉亨家化	2021-03-16	2021-09-24	创业板打新限售	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300996	普联软件	2021-05-26	2021-12-03	创业板打新限售	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	-
300956	英力股份	2021-03-16	2021-09-27	创业板打新限售	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	-
300952	恒辉安防	2021-03-03	2021-09-13	创业板打新限售	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-
301016	N雷尔伟	2021-06-23	2021-12-30	创业板打新限售	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
300966	共同药业	2021-03-	2021-10-	创业板打	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-

		31	11	新限售						
300945	曼卡龙	2021-02-03	2021-08-10	创业板打新限售	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中生态	2021-02-18	2021-08-25	创业板打新限售	13.00	27.42	324	2,808.00	8,884.08	-
300931	通用电梯	2021-01-13	2021-07-21	创业板打新限售	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
300961	深水海纳	2021-03-23	2021-09-30	创业板打新限售	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300950	德固特	2021-02-24	2021-09-03	创业板打新限售	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
605162	新中港	2021-06-29	2021-07-07	新股未上市	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
300958	建工修复	2021-03-18	2021-09-29	创业板打新限售	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-
300986	志特新材	2021-04-21	2021-11-01	创业板打新限售	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
3009	川网	2021	2021	创业	6.79	26.8	301	2,04	8,06	-

87	传媒	-04- 28	-11- 11	板打 新限 售		1		3.79	9.81	
3009 78	东箭 科技	2021 -04- 15	2021 -10- 26	创业 板打 新限 售	8.42	13.6 0	593	4,99 3.06	8,06 4.80	-
3009 26	博俊 科技	2020 -12- 29	2021 -07- 12	创业 板打 新限 售	10.7 6	22.2 0	359	3,86 2.84	7,96 9.80	-
3009 93	玉马 遮阳	2021 -05- 17	2021 -11- 24	创业 板打 新限 售	12.1 0	19.2 9	410	4,96 1.00	7,90 8.90	-
3009 30	屹通 新材	2021 -01- 13	2021 -07- 21	创业 板打 新限 售	13.1 1	24.4 8	322	4,22 1.42	7,88 2.56	-
3009 85	致远 新能	2021 -04- 21	2021 -10- 29	创业 板打 新限 售	24.9 0	24.8 1	295	7,34 5.50	7,31 8.95	-
3010 04	C嘉 益	2021 -06- 18	2021 -12- 27	创业 板打 新限 售	7.81	21.9 4	312	2,43 6.72	6,84 5.28	-
3009 91	创益 通	2021 -05- 12	2021 -11- 22	创业 板打 新限 售	13.0 6	26.5 1	254	3,31 7.24	6,73 3.54	-
3009 27	江天 化学	2020 -12- 29	2021 -07- 07	创业 板打 新限	13.3 9	30.1 0	217	2,90 5.63	6,53 1.70	-

				售						
300975	商络电子	2021-04-14	2021-10-21	创业板打新限售	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300963	中洲特材	2021-03-30	2021-10-11	创业板打新限售	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-
301011	华立科技	2021-06-09	2021-12-17	创业板打新限售	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
300943	春晖智控	2021-02-03	2021-08-10	创业板打新限售	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300967	晓鸣股份	2021-04-02	2021-10-13	创业板打新限售	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-
300972	万辰生物	2021-04-08	2021-10-19	创业板打新限售	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-
300929	华骐环保	2021-01-12	2021-07-21	创业板打新限售	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-
300960	通业科技	2021-03-22	2021-09-29	创业板打新限售	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
3009	奇德	2021	2021	创业	14.7	23.3	191	2,81	4,45	-

95	新材	-05-17	-11-26	板打 新限售	2	2		1.52	4.12	
301007	德迈仕	2021-06-04	2021-12-16	创业板打 新限售	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
300998	宁波方正	2021-05-25	2021-12-02	创业板打 新限售	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301012	扬电科技	2021-06-15	2021-12-22	创业板打 新限售	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
300992	泰福泵业	2021-05-17	2021-11-25	创业板打 新限售	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
301010	晶雪节能	2021-06-09	2021-12-20	创业板打 新限售	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-

## 6.4.12.1.2 受限证券类别：债券

证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量 (单位:张)	期末成本总额	期末估值总额	备注
113050	南银转债	2021-06-15	2021-07-01	新债未上市	100.00	100.00	39,740	3,974.00	3,974.00	-
127038	国微转债	2021-06-10	2021-07-14	新债未上市	100.00	100.00	3,560	356,000.00	356,000.00	-

1130 49	长汽 转债	2021 -06- 10	2021 -07- 08	新债 未上 市	100. 00	100. 00	2,360	236, 000. 00	236, 000. 00	-
1231 17	健帆 转债	2021 -06- 23	2021 -07- 12	新债 未上 市	100. 00	100. 00	1,606	160, 600. 00	160, 600. 00	-

注：1、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起6个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后6个月内不得转让。

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

3、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

4、创业板新股漱玉平民（证券代码：301017）于2021年07月05日起上市流通，本基金获配的股数中555股根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》于上市后进入限售期，可流通日为2022年01月05日。

5、创业板新股密封科技（证券代码：301020）于2021年07月06日起上市流通，本基金获配的股数中421股根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》于上市后进入限售期，可流通日为2022年01月06日。

6、创业板新股英诺激光（证券代码：301021）于2021年07月06日起上市流通，本基金获配的股数中290股根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》于上市后进入限售期，可流通日为2022年01月06日。

7、以上“可流通日”的日期，最终以上市公司公告为准。

#### 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	股票名	停牌日	停牌原因	期末估	复牌日	复牌开	数量 (股)	期末成本 总额	期末估值 总额	备注
-----	-----	-----	------	-----	-----	-----	-----------	------------	------------	----

码	称	期		值 单 价	期	盘 单 价				
002 024	苏 宁 易 购	202 1-0 6-1 6	未刊 登重 要事 项 (未 如期 刊登 临时 公告)	5.5 9	202 1-0 7-0 6	6.1 5	1,145, 200	10,265,78 9.70	6,401,66 8.00	-

注:本基金截至2021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2021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2021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

金额单位:人民币元

序号	证券代 码	证券名 称	出借到期日	期末 估值 单价	数量(股)	期末估值总额
1	000001	平安银 行	2021年07月14 日-2021年07月 23日	22.62	712,700	16,121,274.0 0
2	000002	万 科 A	2021年07月06	23.81	521,800	12,424,058.0

			日-2021年07月 14日			0
3	000063	中兴通 讯	2021年07月09 日-2021年07月 14日	33.23	236,800	7,868,864.00
4	000066	中国长 城	2021年07月01 日-2021年07月 14日	14.60	125,200	1,827,920.00
5	000069	华侨城 A	2021年07月01 日-2021年07月 01日	7.44	292,700	2,177,688.00
6	000100	TCL科技	2021年07月06 日-2021年07月 14日	7.65	93,200	712,980.00
7	000157	中联重 科	2021年07月14 日-2021年07月 21日	9.24	321,900	2,974,356.00
8	000166	申万宏 源	2021年07月01 日-2021年07月 16日	4.68	251,900	1,178,892.00
9	000333	美的集 团	2021年07月14 日-2021年07月 22日	71.37	378,200	26,992,134.0 0
10	000338	潍柴动 力	2021年07月14 日-2021年07月 21日	17.87	364,000	6,504,680.00
11	000538	云南白 药	2021年07月14 日-2021年07月 14日	115.7 2	36,600	4,235,352.00
12	000568	泸州老 窖	2021年07月19 日-2021年07月 19日	235.9 4	16,700	3,940,198.00
13	000625	长安汽	2021年07月06	26.28	173,600	4,562,208.00



		车	日-2021年07月 14日			
14	000651	格力电 器	2021年07月14 日-2021年07月 20日	52.10	308,600	16,078,060.0 0
15	000703	恒逸石 化	2021年07月02 日-2021年07月 15日	11.95	158,800	1,897,660.00
16	000708	中信特 钢	2021年07月15 日-2021年07月 16日	20.84	72,400	1,508,816.00
17	000725	京东方 A	2021年07月05 日-2021年07月 14日	6.24	2,595,200	16,194,048.0 0
18	000728	国元证 券	2021年07月01 日-2021年07月 01日	7.97	39,200	312,424.00
19	000768	中航西 飞	2021年07月01 日-2021年07月 14日	26.28	99,400	2,612,232.00
20	000783	长江证 券	2021年07月01 日-2021年07月 16日	7.32	119,700	876,204.00
21	000800	一汽解 放	2021年07月01 日-2021年07月 14日	10.82	66,400	718,448.00
22	000858	五粮 液	2021年07月19 日-2021年07月 21日	297.8 9	38,700	11,528,343.0 0
23	000860	顺鑫农 业	2021年07月07 日-2021年07月 07日	42.18	30,400	1,282,272.00
24	000876	新希	2021年07月09	14.67	77,500	1,136,925.00

		望	日-2021年07月 14日			
25	000895	双汇发 展	2021年07月14 日-2021年07月 26日	31.80	106,600	3,389,880.00
26	000938	紫光股 份	2021年07月23 日-2021年07月 23日	21.88	45,000	984,600.00
27	000963	华东医 药	2021年07月14 日-2021年07月 14日	46.01	62,800	2,889,428.00
28	000977	浪潮信 息	2021年07月01 日-2021年07月 14日	28.13	77,500	2,180,075.00
29	001979	招商蛇 口	2021年07月02 日-2021年07月 05日	10.95	31,200	341,640.00
30	002001	新 和 成	2021年07月14 日-2021年07月 14日	28.68	111,100	3,186,348.00
31	002007	华兰生 物	2021年07月01 日-2021年07月 14日	36.68	77,900	2,857,372.00
32	002008	大族激 光	2021年07月01 日-2021年07月 01日	40.39	55,700	2,249,723.00
33	002032	苏 泊 尔	2021年07月01 日-2021年07月 01日	63.79	11,600	739,964.00
34	002044	美年健 康	2021年07月01 日-2021年07月 14日	9.11	208,200	1,896,702.00
35	002049	紫光国	2021年07月09	154.1	20,000	3,083,800.00

		微	日-2021年07月 15日	9		
36	002050	三花智 控	2021年07月01 日-2021年07月 01日	23.98	10,000	239,800.00
37	002120	韵达股 份	2021年07月15 日-2021年07月 16日	13.53	26,800	362,604.00
38	002129	中环股 份	2021年07月06 日-2021年07月 06日	38.60	10,400	401,440.00
39	002142	宁波银 行	2021年07月14 日-2021年07月 14日	38.97	258,700	10,081,539.0 0
40	002153	石基信 息	2021年07月01 日-2021年07月 01日	23.51	32,100	754,671.00
41	002157	正邦科 技	2021年07月01 日-2021年07月 14日	11.95	112,000	1,338,400.00
42	002179	中航光 电	2021年07月07 日-2021年07月 07日	79.02	19,400	1,532,988.00
43	002202	金风科 技	2021年07月01 日-2021年07月 01日	12.16	65,600	797,696.00
44	002230	科大讯 飞	2021年07月09 日-2021年07月 23日	67.58	136,100	9,197,638.00
45	002236	大华股 份	2021年07月01 日-2021年07月 08日	21.10	117,700	2,483,470.00
46	002241	歌尔股	2021年07月06	42.74	119,900	5,124,526.00

		份	日-2021年07月 14日			
47	002252	上海莱 士	2021年07月01 日-2021年07月 01日	7.49	45,900	343,791.00
48	002271	东方雨 虹	2021年07月02 日-2021年07月 27日	55.32	67,900	3,756,228.00
49	002304	洋河股 份	2021年07月01 日-2021年07月 14日	207.2 0	43,300	8,971,760.00
50	002311	海大集 团	2021年07月14 日-2021年07月 14日	81.60	59,600	4,863,360.00
51	002352	顺丰控 股	2021年07月14 日-2021年07月 14日	67.70	130,600	8,841,620.00
52	002371	北方华 创	2021年07月14 日-2021年07月 14日	277.3 8	10,000	2,773,800.00
53	002384	东山精 密	2021年07月15 日-2021年07月 22日	20.84	69,700	1,452,548.00
54	002410	广联达	2021年07月13 日-2021年07月 22日	68.20	34,600	2,359,720.00
55	002414	高德红 外	2021年07月01 日-2021年07月 14日	27.58	66,800	1,842,344.00
56	002415	海康威 视	2021年07月01 日-2021年07月 27日	64.50	358,300	23,110,350.0 0
57	002456	欧菲光	2021年07月01	8.88	163,900	1,455,432.00

			日-2021年07月07日			
58	002460	赣锋锂业	2021年07月01日-2021年07月14日	121.09	50,000	6,054,500.00
59	002463	沪电股份	2021年07月01日-2021年07月01日	15.47	85,400	1,321,138.00
60	002475	立讯精密	2021年07月06日-2021年07月14日	46.00	374,600	17,231,600.00
61	002493	荣盛石化	2021年07月06日-2021年07月23日	17.27	86,300	1,490,401.00
62	002508	老板电器	2021年07月08日-2021年07月19日	46.50	33,500	1,557,750.00
63	002555	三七互娱	2021年07月01日-2021年07月14日	24.02	100,400	2,411,608.00
64	002558	巨人网络	2021年07月01日-2021年07月14日	13.30	87,300	1,161,090.00
65	002594	比亚迪	2021年07月14日-2021年07月14日	251.00	45,000	11,295,000.00
66	002600	领益智造	2021年07月02日-2021年07月06日	9.19	213,900	1,965,741.00
67	002601	龙佰集团	2021年07月01日-2021年07月01日	34.58	73,800	2,552,004.00
68	002607	中公教	2021年07月07	20.89	86,800	1,813,252.00

		育	日-2021年07月 26日			
69	002624	完美世 界	2021年07月01 日-2021年07月 01日	23.91	82,800	1,979,748.00
70	002673	西部证 券	2021年07月14 日-2021年07月 21日	8.25	134,000	1,105,500.00
71	002714	牧原股 份	2021年07月02 日-2021年07月 28日	60.82	199,500	12,133,590.0 0
72	002736	国信证 券	2021年07月06 日-2021年07月 14日	10.75	55,900	600,925.00
73	002773	康弘药 业	2021年07月14 日-2021年07月 14日	23.13	14,900	344,637.00
74	002812	恩捷股 份	2021年07月08 日-2021年07月 22日	234.1 0	40,000	9,364,000.00
75	002821	凯莱英	2021年07月15 日-2021年07月 15日	372.6 0	10,000	3,726,000.00
76	002916	深南电 路	2021年07月01 日-2021年07月 01日	111.1 3	14,000	1,555,820.00
77	300003	乐普医 疗	2021年07月05 日-2021年07月 27日	32.12	27,300	876,876.00
78	300014	亿纬锂 能	2021年07月02 日-2021年07月 27日	103.9 3	50,900	5,290,037.00
79	300015	爱尔眼	2021年07月09	70.98	150,728	10,698,673.4

		科	日-2021年07月 22日			4
80	300033	同花顺	2021年07月13 日-2021年07月 27日	112.7 8	16,500	1,860,870.00
81	300059	东方财 富	2021年07月07 日-2021年07月 27日	32.79	66,100	2,167,419.00
82	300122	智飞生 物	2021年07月02 日-2021年07月 26日	186.7 3	12,900	2,408,817.00
83	300124	汇川技 术	2021年07月26 日-2021年07月 26日	74.26	7,600	564,376.00
84	300136	信维通 信	2021年07月05 日-2021年07月 09日	30.88	74,200	2,291,296.00
85	300142	沃森生 物	2021年07月06 日-2021年07月 06日	61.70	1,300	80,210.00
86	300144	宋城演 艺	2021年07月22 日-2021年07月 23日	16.80	6,800	114,240.00
87	300274	阳光电 源	2021年07月02 日-2021年07月 26日	115.0 6	59,700	6,869,082.00
88	300347	泰格医 药	2021年07月02 日-2021年07月 26日	193.3 0	7,200	1,391,760.00
89	300408	三环集 团	2021年07月02 日-2021年07月 13日	42.42	7,500	318,150.00
90	300413	芒果超	2021年07月07	68.60	7,300	500,780.00

		媒	日-2021年07月 23日			
91	300433	蓝思科技	2021年07月05 日-2021年07月 07日	29.41	19,500	573,495.00
92	300450	先导智能	2021年07月06 日-2021年07月 22日	60.14	19,300	1,160,702.00
93	300498	温氏股份	2021年07月06 日-2021年07月 27日	14.37	341,900	4,913,103.00
94	300529	健帆生物	2021年07月23 日-2021年07月 23日	86.36	1,000	86,360.00
95	300558	贝达药业	2021年07月02 日-2021年07月 20日	108.2 4	9,600	1,039,104.00
96	300595	欧普康视	2021年07月01 日-2021年07月 19日	103.5 5	39,000	4,038,450.00
97	300601	康泰生物	2021年07月01 日-2021年07月 14日	149.0 0	27,900	4,157,100.00
98	300676	华大基因	2021年07月01 日-2021年07月 13日	118.6 0	7,200	853,920.00
99	300677	英科医疗	2021年07月08 日-2021年07月 14日	124.8 0	16,600	2,071,680.00
100	600009	上海机场	2021年07月12 日-2021年07月 23日	48.13	73,800	3,551,994.00
101	600010	包钢股	2021年07月06	1.55	1,740,200	2,697,310.00



		份	日-2021年07月 14日			
102	600011	华能国际	2021年07月01 日-2021年07月 13日	4.22	333,800	1,408,636.00
103	600018	上港集团	2021年07月15 日-2021年07月 15日	4.77	25,800	123,066.00
104	600025	华能水电	2021年07月05 日-2021年07月 16日	5.79	128,200	742,278.00
105	600029	南方航空	2021年07月07 日-2021年07月 07日	6.02	14,500	87,290.00
106	600030	中信证券	2021年07月22 日-2021年07月 22日	24.94	46,700	1,164,698.00
107	600031	三一重工	2021年07月01 日-2021年07月 26日	29.07	455,300	13,235,571.0 0
108	600048	保利地产	2021年07月15 日-2021年07月 16日	12.04	61,000	734,440.00
109	600050	中国联通	2021年07月05 日-2021年07月 16日	4.32	1,341,000	5,793,120.00
110	600079	人福医药	2021年07月14 日-2021年07月 15日	28.27	63,000	1,781,010.00
111	600085	同仁堂	2021年07月01 日-2021年07月 07日	40.85	52,400	2,140,540.00
112	600109	国金证	2021年07月01	12.69	99,000	1,256,310.00

		券	日-2021年07月 16日			
113	600111	北方稀 土	2021年07月07 日-2021年07月 14日	20.70	167,400	3,465,180.00
114	600115	中国东 航	2021年07月01 日-2021年07月 06日	5.08	338,100	1,717,548.00
115	600118	中国卫 星	2021年07月01 日-2021年07月 01日	29.26	31,900	933,394.00
116	600143	金发科 技	2021年07月01 日-2021年07月 15日	20.86	67,800	1,414,308.00
117	600150	中国船 舶	2021年07月01 日-2021年07月 22日	16.51	137,000	2,261,870.00
118	600161	天坛生 物	2021年07月01 日-2021年07月 01日	34.25	45,800	1,568,650.00
119	600183	生益科 技	2021年07月01 日-2021年07月 01日	23.41	71,000	1,662,110.00
120	600196	复星医 药	2021年07月08 日-2021年07月 15日	72.13	87,800	6,333,014.00
121	600233	圆通速 递	2021年07月02 日-2021年07月 15日	10.01	89,100	891,891.00
122	600276	恒瑞医 药	2021年07月14 日-2021年07月 21日	67.97	112,100	7,619,437.00
123	600299	安迪苏	2021年07月01	11.96	27,200	325,312.00

			日-2021年07月01日			
124	600309	万华化学	2021年07月15日-2021年07月15日	108.82	112,700	12,264,014.00
125	600332	白云山	2021年07月01日-2021年07月01日	33.85	50,200	1,699,270.00
126	600346	恒力石化	2021年07月02日-2021年07月14日	26.24	152,300	3,996,352.00
127	600352	浙江龙盛	2021年07月01日-2021年07月14日	13.74	186,800	2,566,632.00
128	600362	江西铜业	2021年07月01日-2021年07月14日	22.38	73,700	1,649,406.00
129	600383	金地集团	2021年07月01日-2021年07月14日	10.24	170,800	1,748,992.00
130	600406	国电南瑞	2021年07月14日-2021年07月14日	23.24	10,000	232,400.00
131	600426	华鲁恒升	2021年07月01日-2021年07月23日	30.95	109,600	3,392,120.00
132	600438	通威股份	2021年07月02日-2021年07月06日	43.27	205,900	8,909,293.00
133	600482	中国动力	2021年07月01日-2021年07月14日	17.42	45,400	790,868.00
134	600489	中金黄	2021年07月01	8.62	139,400	1,201,628.00

		金	日-2021年07月 14日			
135	600519	贵州茅 台	2021年07月14 日-2021年07月 14日	2,05 6.70	20,000	41,134,000.0 0
136	600521	华海药 业	2021年07月14 日-2021年07月 14日	20.88	62,200	1,298,736.00
137	600522	中天科 技	2021年07月01 日-2021年07月 22日	10.00	183,800	1,838,000.00
138	600547	山东黄 金	2021年07月02 日-2021年07月 16日	19.22	138,500	2,661,970.00
139	600584	长电科 技	2021年07月01 日-2021年07月 15日	37.68	89,000	3,353,520.00
140	600585	海螺水 泥	2021年07月16 日-2021年07月 16日	41.05	10,000	410,500.00
141	600606	绿地控 股	2021年07月02 日-2021年07月 27日	5.45	182,400	994,080.00
142	600655	豫园股 份	2021年07月14 日-2021年07月 14日	11.59	56,200	651,358.00
143	600660	福耀玻 璃	2021年07月01 日-2021年07月 21日	55.85	107,700	6,015,045.00
144	600703	三安光 电	2021年07月01 日-2021年07月 22日	32.05	205,800	6,595,890.00
145	600705	中航产	2021年07月01	3.87	411,800	1,593,666.00

		融	日-2021年07月 14日			
146	600741	华域汽 车	2021年07月08 日-2021年07月 08日	26.27	16,400	430,828.00
147	600760	中航沈 飞	2021年07月02 日-2021年07月 22日	60.30	43,600	2,629,080.00
148	600763	通策医 疗	2021年07月15 日-2021年07月 15日	411.0 0	10,000	4,110,000.00
149	600795	国电电 力	2021年07月01 日-2021年07月 01日	2.43	638,400	1,551,312.00
150	600845	宝信软 件	2021年07月01 日-2021年07月 01日	50.90	31,900	1,623,710.00
151	600848	上海临 港	2021年07月01 日-2021年07月 14日	17.90	58,800	1,052,520.00
152	600886	国投电 力	2021年07月01 日-2021年07月 01日	9.61	173,100	1,663,491.00
153	600887	伊利股 份	2021年07月14 日-2021年07月 22日	36.83	134,800	4,964,684.00
154	600893	航发动 力	2021年07月01 日-2021年07月 15日	53.19	79,600	4,233,924.00
155	600900	长江电 力	2021年07月13 日-2021年07月 27日	20.64	230,300	4,753,392.00
156	600918	中泰证	2021年07月07	10.82	53,500	578,870.00

		券	日-2021年07月 12日			
157	600926	杭州银行	2021年07月15 日-2021年07月 15日	14.75	59,200	873,200.00
158	600958	东方证券	2021年07月02 日-2021年07月 20日	9.99	318,700	3,183,813.00
159	601006	大秦铁路	2021年07月02 日-2021年07月 05日	6.58	429,400	2,825,452.00
160	601012	隆基股份	2021年07月07 日-2021年07月 26日	88.84	203,720	18,098,484.80
161	601021	春秋航空	2021年07月01 日-2021年07月 01日	56.90	14,800	842,120.00
162	601066	中信建投	2021年07月14 日-2021年07月 14日	31.43	69,400	2,181,242.00
163	601100	恒立液压	2021年07月23 日-2021年07月 23日	85.92	10,000	859,200.00
164	601111	中国国航	2021年07月02 日-2021年07月 16日	7.78	124,100	965,498.00
165	601155	新城控股	2021年07月23 日-2021年07月 23日	41.60	10,000	416,000.00
166	601162	天风证券	2021年07月01 日-2021年07月 14日	4.86	309,900	1,506,114.00
167	601186	中国铁	2021年07月06	7.43	297,600	2,211,168.00

		建	日-2021年07月 15日			
168	601216	君正集 团	2021年07月06 日-2021年07月 14日	5.09	201,500	1,025,635.00
169	601231	环旭电 子	2021年07月15 日-2021年07月 15日	16.81	46,500	781,665.00
170	601236	红塔证 券	2021年07月05 日-2021年07月 05日	13.56	51,600	699,696.00
171	601238	广汽集 团	2021年07月01 日-2021年07月 14日	12.95	165,900	2,148,405.00
172	601318	中国平 安	2021年07月16 日-2021年07月 23日	64.28	334,500	21,501,660.0 0
173	601328	交通银 行	2021年07月14 日-2021年07月 14日	4.90	1,971,800	9,661,820.00
174	601360	三六零	2021年07月08 日-2021年07月 14日	12.21	162,700	1,986,567.00
175	601377	兴业证 券	2021年07月16 日-2021年07月 19日	9.66	105,800	1,022,028.00
176	601555	东吴证 券	2021年07月01 日-2021年07月 16日	8.34	92,700	773,118.00
177	601600	中国铝 业	2021年07月01 日-2021年07月 20日	5.30	421,900	2,236,070.00
178	601607	上海医	2021年07月07	21.13	32,900	695,177.00

		药	日-2021年07月 19日			
179	601618	中国中 冶	2021年07月01 日-2021年07月 09日	2.98	541,800	1,614,564.00
180	601633	长城汽 车	2021年07月14 日-2021年07月 14日	43.59	85,000	3,705,150.00
181	601669	中国电 建	2021年07月01 日-2021年07月 01日	3.87	522,200	2,020,914.00
182	601696	中银证 券	2021年07月01 日-2021年07月 16日	20.59	59,500	1,225,105.00
183	601698	中国卫 通	2021年07月14 日-2021年07月 14日	16.19	30,900	500,271.00
184	601727	上海电 气	2021年07月01 日-2021年07月 14日	4.24	394,000	1,670,560.00
185	601766	中国中 车	2021年07月16 日-2021年07月 16日	6.08	217,900	1,324,832.00
186	601788	光大证 券	2021年07月14 日-2021年07月 14日	17.89	138,700	2,481,343.00
187	601799	星宇股 份	2021年07月06 日-2021年07月 06日	225.7 2	10,300	2,324,916.00
188	601800	中国交 建	2021年07月01 日-2021年07月 16日	6.48	155,100	1,005,048.00
189	601808	中海油	2021年07月01	14.36	41,900	601,684.00



		服	日-2021年07月 14日			
190	601816	京沪高 铁	2021年07月07 日-2021年07月 22日	5.29	731,500	3,869,635.00
191	601838	成都银 行	2021年07月01 日-2021年07月 01日	12.64	14,000	176,960.00
192	601857	中国石 油	2021年07月07 日-2021年07月 26日	5.29	342,200	1,810,238.00
193	601872	招商轮 船	2021年07月06 日-2021年07月 15日	4.62	279,080	1,289,349.60
194	601877	正泰电 器	2021年07月02 日-2021年07月 09日	33.38	82,200	2,743,836.00
195	601878	浙商证 券	2021年07月01 日-2021年07月 14日	13.08	111,800	1,462,344.00
196	601888	中国中 免	2021年07月05 日-2021年07月 19日	300.1 0	41,000	12,304,100.0 0
197	601899	紫金矿 业	2021年07月01 日-2021年07月 01日	9.69	889,200	8,616,348.00
198	601901	方正证 券	2021年07月07 日-2021年07月 12日	9.36	45,800	428,688.00
199	601919	中远海 控	2021年07月06 日-2021年07月 14日	30.54	368,800	11,263,152.0 0
200	601933	永辉超	2021年07月06	4.73	268,600	1,270,478.00

		市	日-2021年07月 14日			
201	601985	中国核 电	2021年07月01 日-2021年07月 06日	5.06	397,000	2,008,820.00
202	601990	南京证 券	2021年07月01 日-2021年07月 01日	10.52	131,400	1,382,328.00
203	601995	中金公 司	2021年07月14 日-2021年07月 14日	61.50	18,700	1,150,050.00
204	603019	中科曙 光	2021年07月01 日-2021年07月 22日	27.61	67,400	1,860,914.00
205	603160	汇顶科 技	2021年07月16 日-2021年07月 16日	129.6 3	10,000	1,296,300.00
206	603259	药明康 德	2021年07月16 日-2021年07月 16日	156.5 9	10,000	1,565,900.00
207	603338	浙江鼎 力	2021年07月15 日-2021年07月 15日	58.69	10,000	586,900.00
208	603501	韦尔股 份	2021年07月22 日-2021年07月 22日	322.0 0	39,900	12,847,800.0 0
209	603658	安图生 物	2021年07月01 日-2021年07月 01日	75.77	10,000	757,700.00
210	603659	璞泰来	2021年07月19 日-2021年07月 19日	136.6 0	14,900	2,035,340.00
211	603799	华友钴	2021年07月07	114.2	41,800	4,773,560.00

		业	日-2021年07月 19日	0		
212	603806	福斯特	2021年07月14 日-2021年07月 14日	105.1 3	16,200	1,703,106.00
213	603833	欧派家 居	2021年07月01 日-2021年07月 01日	141.9 6	10,000	1,419,600.00
214	603899	晨光文 具	2021年07月01 日-2021年07月 01日	84.56	16,900	1,429,064.00
215	603986	兆易创 新	2021年07月02 日-2021年07月 23日	187.9 0	40,800	7,666,320.00
216	688009	中国通 号	2021年07月16 日-2021年07月 19日	5.69	47,200	268,568.00
217	688036	传音控 股	2021年07月14 日-2021年07月 19日	209.5 0	15,300	3,205,350.00
218	688111	金山办 公	2021年07月14 日-2021年07月 15日	394.8 0	13,200	5,211,360.00
219	688169	石头科 技	2021年07月16 日-2021年07月 16日	1,26 1.00	1,000	1,261,000.00
220	688363	华熙生 物	2021年07月01 日-2021年07月 01日	277.8 6	5,100	1,417,086.00
221	688396	华润微	2021年07月07 日-2021年07月 14日	91.02	20,200	1,838,604.00
合计					34,212,22 8	786,929,943. 84

### 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

本基金是被动式投资的股票型指数基金，紧密跟踪沪深300指数收益率，其风险收益特征与标的指数所表征的市场组合的风险收益特征相似，本基金预期收益及预期风险水平高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。本基金采用完全复制法，跟踪沪深300指数收益率，以完全按照标的指数成份股组成及其权重构建基金股票投资组合为原则，进行被动式指数化投资。股票在投资组合中的权重原则上根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整。但因特殊情况(比如流动性不足等)导致本基金无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可使用其他合理方法进行适当的替代，力求与标的指数的跟踪偏离度与跟踪误差的最小化。

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，

确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 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存放在本基金的托管人招商证券股份有限公司开立于具有基金托管人资格的交通银行股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，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 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	4,210,000.00	3,824,000.00
AAA以下	925,288.80	343,000.00

未评级	-	-
合计	5,135,288.80	4,167,000.00

#### 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来自调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

于2021年06月30日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 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%。

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。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021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	44,805,438.05	-	-	-	44,805,438.05
结算备付金	8,056,466.22	-	-	-	8,056,466.22
存出保证金	1,420,091.26	-	-	5,043,801.60	6,463,892.86
交易性金融资产	-	-	5,135,288.80	6,797,193,344.58	6,802,328,633.38
应收证券清算款	-	-	-	13,662,019.11	13,662,019.11
应收利息	-	-	-	362,999.94	362,999.94
应收股利	-	-	-	742,799.18	742,799.18
其他资产	-	-	-	75,616.24	75,616.24
资产总计	54,281,995.53	-	5,135,288.80	6,817,080,580.65	6,876,497,864.98
负债					
应付证券清算款	-	-	-	21,058,578.63	21,058,578.63
应付管理人报酬	-	-	-	2,764,227.07	2,764,227.07
应付托管费	-	-	-	552,845.42	552,845.42

应付交易费用	-	-	-	677,785.41	677,785.41
应交税费	-	-	-	26,198.74	26,198.74
其他负债	-	-	-	656,811.77	656,811.77
负债总计	-	-	-	25,736,447.04	25,736,447.04
利率敏感度缺口	54,281,995.53	-	5,135,288.80	6,791,344.13 3.61	6,850,761.41 7.94
上年度末 2020年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	33,863,114.40	-	-	-	33,863,114.40
结算备付金	8,970,917.87	-	-	-	8,970,917.87
存出保证金	2,164,369.43	-	-	4,319,013.60	6,483,383.03
交易性金融资产	-	-	4,167,000.00	5,889,799.46 9.45	5,893,966.46 9.45
应收证券清算款	-	-	-	49,163,094.69	49,163,094.69
应收利息	-	-	-	352,784.03	352,784.03
应收股利	-	-	-	239.80	239.80
资产总计	44,998,401.70	0.00	4,167,000.00	5,943,634.60 1.57	5,992,800.00 3.27
负债					
应付证券清算款	-	-	-	48,638,429.70	48,638,429.70
应付管理人报酬	-	-	-	2,429,212.62	2,429,212.62
应付托管费	-	-	-	485,842.54	485,842.54
应付交易费用	-	-	-	634,733.51	634,733.51
应交税费	-	-	-	37,422.46	37,422.46
其他负债	-	-	-	647,168.02	647,168.02
负债总计	-	-	-	52,872,808.85	52,872,808.85
利率敏感度缺口	44,998,401.70	0.00	4,167,000.00	5,890,761.79 2.72	5,939,927.19 4.42

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2021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0.07%（2020年12月31日：0.07%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2020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的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金原则上采用完全复制法，跟踪沪深300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。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中，沪深300指数成份股和备选成份股股票投资比例不低于基金资产净值的90%，且不低于非现金基金资产的80%。每个交易日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 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 2021年06月30日		上年度末 2020年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	6,797,193,344.58	99.22	5,889,799,469.45	99.16
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	6,797,193,344.58	99.22	5,889,799,469.45	99.16

#### 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 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
	业绩比较基准上升5%	448,724,872.88	314,816,141.30
	业绩比较基准下降5%	-448,724,872.88	-314,816,141.30

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于2021年06月30日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为6,788,972,709.69元，属于第二层次的余额为13,355,923.69元，无属于第三层次的余额(2020年12月31日：第一层次5,880,065,404.02元，第二层次13,901,065.43元，无属于第三层次的余额)。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2021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(2020年12月31日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 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	6,797,193,344.58	98.85
	其中：股票	6,797,193,344.58	98.85
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	5,135,288.80	0.07
	其中：债券	5,135,288.80	0.07
	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	52,861,904.27	0.77

8	其他各项资产	21,307,327.33	0.31
9	合计	6,876,497,864.98	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 786,929,943.84 元，占基金资产净值的比例为 11.49%。

## 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	71,294,483.96	1.04
B	采矿业	143,715,587.85	2.10
C	制造业	3,761,505,730.85	54.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	119,936,073.00	1.75
E	建筑业	82,243,434.00	1.20
F	批发和零售业	48,711,730.88	0.71
G	交通运输、仓储和邮政业	198,934,579.73	2.90
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	223,070,530.45	3.26
J	金融业	1,604,507,138.27	23.42
K	房地产业	136,795,110.46	2.00
L	租赁和商务服务业	123,865,382.00	1.81
M	科学研究和技术服务业	97,228,936.41	1.42
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	12,314,655.00	0.18
Q	卫生和社会工作	144,762,082.79	2.11
R	文化、体育和娱乐业	26,004,710.70	0.38
S	综合	-	-

	合计	6,794,890,166.35	99.18
--	----	------------------	-------

### 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	11,290.28	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,983,764.66	0.03
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	95,577.58	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	94,994.52	0.00
J	金融业	34,721.10	0.00
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	44,438.33	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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,303,178.23	0.03

### 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	贵州茅台	199,949	411,235,108.30	6.00
2	601318	中国平安	3,445,486	221,475,840.08	3.23
3	600036	招商银行	3,936,106	213,297,584.14	3.11
4	000858	五粮液	616,952	183,783,831.28	2.68
5	601012	隆基股份	1,377,660	122,391,314.40	1.79
6	000333	美的集团	1,568,974	111,977,674.38	1.63
7	600276	恒瑞医药	1,423,499	96,755,227.03	1.41
8	002415	海康威视	1,485,200	95,795,400.00	1.40
9	601166	兴业银行	4,625,418	95,052,339.90	1.39
10	601888	中国中免	310,300	93,121,030.00	1.36
11	603259	药明康德	570,699	89,365,756.41	1.30
12	300059	东方财富	2,628,684	86,194,548.36	1.26
13	000651	格力电器	1,531,122	79,771,456.20	1.16
14	600900	长江电力	3,616,800	74,650,752.00	1.09
15	002594	比亚迪	287,900	72,262,900.00	1.05
16	002475	立讯精密	1,554,977	71,528,942.00	1.04
17	600887	伊利股份	1,935,000	71,266,050.00	1.04
18	000001	平安银行	3,086,940	69,826,582.80	1.02
19	600030	中信证券	2,710,500	67,599,870.00	0.99
20	000725	京东方 A	10,764,700	67,171,728.00	0.98
21	300015	爱尔眼科	860,152	61,053,588.96	0.89
22	601398	工商银行	11,141,900	57,603,623.00	0.84
23	000568	泸州老窖	233,300	55,044,802.00	0.80

24	600031	三一重工	1,890,400	54,953,928.00	0.80
25	600309	万华化学	499,394	54,344,055.08	0.79
26	603501	XD韦尔股	165,600	53,323,200.00	0.78
27	603288	海天味业	402,473	51,898,893.35	0.76
28	000002	万科A	2,165,021	51,549,150.01	0.75
29	002714	牧原股份	837,005	50,906,644.10	0.74
30	600809	山西汾酒	110,629	49,561,792.00	0.72
31	300122	智飞生物	254,098	47,447,719.54	0.69
32	601919	中远海控	1,538,800	46,994,952.00	0.69
33	002142	宁波银行	1,145,811	44,652,254.67	0.65
34	600436	片仔癀	95,600	42,857,480.00	0.63
35	601328	交通银行	8,732,500	42,789,250.00	0.62
36	601899	紫金矿业	4,395,200	42,589,488.00	0.62
37	002304	洋河股份	191,745	39,729,564.00	0.58
38	002812	恩捷股份	169,500	39,679,950.00	0.58
39	002352	顺丰控股	580,300	39,286,310.00	0.57
40	002230	科大讯飞	566,500	38,284,070.00	0.56
41	300014	亿纬锂能	360,352	37,451,383.36	0.55
42	600000	浦发银行	3,735,595	37,355,950.00	0.55
43	300274	阳光电源	324,400	37,325,464.00	0.54
44	600438	通威股份	858,900	37,164,603.00	0.54
45	300124	汇川技术	492,662	36,585,080.12	0.53
46	600837	海通证券	3,068,400	35,286,600.00	0.52
47	000661	长春高新	89,583	34,668,621.00	0.51
48	000100	TCL科技	4,460,600	34,123,590.00	0.50
49	601816	京沪高铁	6,243,000	33,025,470.00	0.48
50	000063	中兴通讯	981,500	32,615,245.00	0.48
51	002241	歌尔股份	760,800	32,516,592.00	0.47
52	300347	泰格医药	166,622	32,208,032.60	0.47
53	603986	兆易创新	169,024	31,759,609.60	0.46
54	601601	XD中国太	1,088,700	31,539,639.00	0.46

55	600585	海螺水泥	763,100	31,325,255.00	0.46
56	600690	海尔智家	1,204,100	31,198,231.00	0.46
57	002271	东方雨虹	561,950	31,087,074.00	0.45
58	601668	XD中国建	6,666,700	31,000,155.00	0.45
59	002460	赣锋锂业	255,550	30,944,549.50	0.45
60	603799	华友钴业	269,400	30,765,480.00	0.45
61	002027	分众传媒	3,267,200	30,744,352.00	0.45
62	300142	沃森生物	498,000	30,726,600.00	0.45
63	600016	民生银行	6,768,100	29,847,321.00	0.44
64	600763	通策医疗	71,700	29,468,700.00	0.43
65	600196	复星医药	384,400	27,726,772.00	0.40
66	601288	农业银行	9,137,800	27,687,534.00	0.40
67	600048	保利地产	2,284,500	27,505,380.00	0.40
68	600703	三安光电	854,800	27,396,340.00	0.40
69	000338	潍柴动力	1,510,000	26,983,700.00	0.39
70	600919	江苏银行	3,756,610	26,671,931.00	0.39
71	002129	中环股份	675,200	26,062,720.00	0.38
72	601229	上海银行	3,165,800	25,959,560.00	0.38
73	601688	华泰证券	1,637,700	25,875,660.00	0.38
74	600050	XD中国联	5,917,300	25,562,736.00	0.37
75	600660	福耀玻璃	445,100	24,858,835.00	0.36
76	600570	恒生电子	265,083	24,718,989.75	0.36
77	601211	国泰君安	1,432,799	24,558,174.86	0.36
78	600104	上汽集团	1,114,400	24,483,368.00	0.36
79	601766	中国中车	3,868,600	23,521,088.00	0.34
80	688111	金山办公	59,000	23,293,200.00	0.34
81	601169	北京银行	4,713,700	22,955,719.00	0.34
82	600999	招商证券	1,180,931	22,461,307.62	0.33
83	002371	北方华创	79,400	22,023,972.00	0.32
84	600019	宝钢股份	2,836,932	21,674,160.48	0.32
85	002311	海大集团	264,043	21,545,908.80	0.31



86	002049	紫光国微	134,600	20,753,974.00	0.30
87	601988	中国银行	6,709,600	20,665,568.00	0.30
88	002410	广联达	301,900	20,589,580.00	0.30
89	600406	国电南瑞	881,600	20,488,384.00	0.30
90	601088	中国神华	1,048,800	20,472,576.00	0.30
91	300498	温氏股份	1,418,778	20,387,839.86	0.30
92	601818	光大银行	5,266,000	19,905,480.00	0.29
93	300601	康泰生物	130,900	19,504,100.00	0.28
94	600745	闻泰科技	198,200	19,205,580.00	0.28
95	000625	长安汽车	722,600	18,989,928.00	0.28
96	000538	云南白药	162,428	18,796,168.16	0.27
97	600028	中国石化	4,254,040	18,547,614.40	0.27
98	600893	航发动力	339,100	18,036,729.00	0.26
99	601628	中国人寿	530,704	17,985,558.56	0.26
10 0	300450	先导智能	298,600	17,957,804.00	0.26
10 1	600346	恒力石化	671,200	17,612,288.00	0.26
10 2	601658	邮储银行	3,464,000	17,389,280.00	0.25
10 3	002821	凯莱英	46,658	17,384,770.80	0.25
10 4	600588	用友网络	518,820	17,255,953.20	0.25
10 5	601390	中国中铁	3,235,200	16,952,448.00	0.25
10 6	601633	长城汽车	388,729	16,944,697.11	0.25
10 7	300595	欧普康视	162,200	16,795,810.00	0.25
10 8	601009	南京银行	1,594,800	16,777,296.00	0.24

109	002493	荣盛石化	966,350	16,688,864.50	0.24
110	601377	兴业证券	1,705,900	16,478,994.00	0.24
111	601857	中国石油	3,092,585	16,359,774.65	0.24
112	688036	传音控股	76,800	16,089,600.00	0.23
113	300413	芒果超媒	227,322	15,594,289.20	0.23
114	600132	重庆啤酒	77,300	15,301,535.00	0.22
115	601225	陕西煤业	1,271,200	15,063,720.00	0.22
116	600584	长电科技	396,700	14,947,656.00	0.22
117	300408	三环集团	347,300	14,732,466.00	0.22
118	002601	龙鳞佰利	426,000	14,731,080.00	0.22
119	600009	上海机场	305,500	14,703,715.00	0.21
120	600426	华鲁恒升	471,400	14,589,830.00	0.21
121	600111	北方稀土	693,900	14,363,730.00	0.21
122	601100	恒立液压	166,436	14,300,181.12	0.21
123	000776	广发证券	941,300	14,251,282.00	0.21
124	688012	中微公司	85,622	14,206,402.24	0.21
12	601939	建设银行	2,130,600	14,168,490.00	0.21

5					
12 6	002001	新 和 成	492,040	14,111,707.20	0.21
12 7	603882	金域医学	87,999	14,059,600.23	0.21
12 8	000895	双汇发展	439,800	13,985,640.00	0.20
12 9	300433	蓝思科技	475,400	13,981,514.00	0.20
13 0	600926	杭州银行	943,240	13,912,790.00	0.20
13 1	002179	中航光电	174,600	13,796,892.00	0.20
13 2	002050	三花智控	571,400	13,702,172.00	0.20
13 3	000166	申万宏源	2,862,100	13,394,628.00	0.20
13 4	600958	东方证券	1,328,300	13,269,717.00	0.19
13 5	600741	华域汽车	501,500	13,174,405.00	0.19
13 6	002841	视源股份	105,949	13,168,401.21	0.19
13 7	600600	青岛啤酒	112,100	12,964,365.00	0.19
13 8	300003	乐普医疗	402,284	12,921,362.08	0.19
13 9	002007	华兰生物	348,540	12,784,447.20	0.19
14 0	000963	华东医药	277,700	12,776,977.00	0.19
14 1	000786	北新建材	322,000	12,638,500.00	0.18

14 2	000157	中联重科	1,347,500	12,450,900.00	0.18
14 3	601006	大秦铁路	1,891,300	12,444,754.00	0.18
14 4	603806	福斯特	117,304	12,332,169.52	0.18
14 5	002607	中公教育	589,500	12,314,655.00	0.18
14 6	601901	方正证券	1,310,000	12,261,600.00	0.18
14 7	601336	新华保险	265,116	12,171,475.56	0.18
14 8	600029	南方航空	2,020,500	12,163,410.00	0.18
14 9	600015	华夏银行	1,955,800	12,106,402.00	0.18
15 0	002236	大华股份	571,600	12,060,760.00	0.18
15 1	600143	金发科技	573,100	11,954,866.00	0.17
15 2	601155	新城控股	287,100	11,943,360.00	0.17
15 3	601989	中国重工	2,897,000	11,935,640.00	0.17
15 4	600176	中国巨石	764,329	11,854,742.79	0.17
15 5	601138	工业富联	945,300	11,731,173.00	0.17
15 6	603993	洛阳钼业	2,247,200	11,595,552.00	0.17
15 7	000768	中航西飞	440,900	11,586,852.00	0.17
15	601877	正泰电器	342,700	11,439,326.00	0.17

8					
159	600352	浙江龙盛	826,900	11,361,606.00	0.17
160	600760	中航沈飞	187,540	11,308,662.00	0.17
161	600010	包钢股份	7,232,800	11,210,840.00	0.16
162	601788	光大证券	620,600	11,102,534.00	0.16
163	600547	山东黄金	576,340	11,077,254.80	0.16
164	300529	健帆生物	127,800	11,036,808.00	0.16
165	001979	招商蛇口	1,006,311	11,019,105.45	0.16
166	601600	中国铝业	2,074,400	10,994,320.00	0.16
167	002008	大族激光	270,600	10,929,534.00	0.16
168	601186	中国铁建	1,463,100	10,870,833.00	0.16
169	603369	今世缘	199,297	10,793,925.52	0.16
170	688169	石头科技	8,488	10,703,368.00	0.16
171	002202	金风科技	878,200	10,678,912.00	0.16
172	601916	浙商银行	2,663,900	10,575,683.00	0.15
173	000876	新希望	716,200	10,506,654.00	0.15
174	002555	三七互娱	421,639	10,127,768.78	0.15

17 5	003816	中国广核	3,743,800	9,995,946.00	0.15
17 6	000938	紫光股份	455,640	9,969,403.20	0.15
17 7	601799	星宇股份	44,100	9,954,252.00	0.15
17 8	603899	晨光文具	117,300	9,918,888.00	0.14
17 9	002736	国信证券	918,400	9,872,800.00	0.14
18 0	601066	中信建投	310,700	9,765,301.00	0.14
18 1	600109	国金证券	767,300	9,737,037.00	0.14
18 2	000069	华侨城 A	1,304,300	9,703,992.00	0.14
18 3	600989	宝丰能源	699,900	9,574,632.00	0.14
18 4	300136	信维通信	308,200	9,517,216.00	0.14
18 5	000425	徐工机械	1,491,200	9,498,944.00	0.14
18 6	603160	汇顶科技	73,258	9,496,434.54	0.14
18 7	600150	中国船舶	571,200	9,430,512.00	0.14
18 8	601669	中国电建	2,428,600	9,398,682.00	0.14
18 9	600795	国电电力	3,739,800	9,087,714.00	0.13
19 0	603659	璞泰来	66,500	9,083,900.00	0.13
19	000977	浪潮信息	322,847	9,081,686.11	0.13

1					
19 2	002384	东山精密	433,900	9,042,476.00	0.13
19 3	000783	长江证券	1,232,300	9,020,436.00	0.13
19 4	601238	广汽集团	693,600	8,982,120.00	0.13
19 5	603019	中科曙光	322,074	8,892,463.14	0.13
19 6	600085	同仁堂	217,338	8,878,257.30	0.13
19 7	688008	澜起科技	142,304	8,876,923.52	0.13
19 8	002624	完美世界	369,586	8,836,801.26	0.13
19 9	000596	古井贡酒	36,878	8,832,281.00	0.13
20 0	600079	人福医药	311,900	8,817,413.00	0.13
20 1	601838	成都银行	687,700	8,692,528.00	0.13
20 2	300677	英科医疗	69,600	8,686,080.00	0.13
20 3	300558	贝达药业	79,057	8,557,129.68	0.12
20 4	600886	国投电力	889,000	8,543,290.00	0.12
20 5	600183	生益科技	364,400	8,530,604.00	0.12
20 6	601985	中国核电	1,665,000	8,424,900.00	0.12
20 7	000703	恒逸石化	704,620	8,420,209.00	0.12

20 8	300144	宋城演艺	500,820	8,413,776.00	0.12
20 9	601108	财通证券	795,100	8,340,599.00	0.12
21 0	601360	三六零	681,400	8,319,894.00	0.12
21 1	002600	领益智造	901,000	8,280,190.00	0.12
21 2	603517	绝味食品	97,700	8,235,133.00	0.12
21 3	603833	欧派家居	58,000	8,233,680.00	0.12
21 4	601555	东吴证券	983,180	8,199,721.20	0.12
21 5	002414	高德红外	297,140	8,195,121.20	0.12
21 6	000066	中国长城	560,200	8,178,920.00	0.12
21 7	002252	上海莱士	1,071,000	8,021,790.00	0.12
21 8	002044	美年健康	875,100	7,972,161.00	0.12
21 9	002938	鹏鼎控股	220,100	7,897,188.00	0.12
22 0	601077	渝农商行	1,975,200	7,881,048.00	0.12
22 1	300676	华大基因	66,300	7,863,180.00	0.11
22 2	600522	中天科技	782,100	7,821,000.00	0.11
22 3	300033	同花顺	68,982	7,779,789.96	0.11
22	601607	上海医药	367,656	7,768,571.28	0.11



4					
22 5	000728	国元证券	967,460	7,710,656.20	0.11
22 6	688396	华润微	84,600	7,700,292.00	0.11
22 7	002602	世纪华通	1,188,728	7,631,633.76	0.11
22 8	600332	白云山	223,400	7,562,090.00	0.11
22 9	600161	XD天坛生	218,500	7,483,625.00	0.11
23 0	600872	中炬高新	178,003	7,479,686.06	0.11
23 1	601111	中国国航	954,500	7,426,010.00	0.11
23 2	600362	江西铜业	331,100	7,410,018.00	0.11
23 3	600383	金地集团	719,200	7,364,608.00	0.11
23 4	601800	中国交建	1,118,300	7,246,584.00	0.11
23 5	600115	中国东航	1,422,000	7,223,760.00	0.11
23 6	600845	宝信软件	141,753	7,215,227.70	0.11
23 7	300628	亿联网络	85,882	7,196,911.60	0.11
23 8	002508	老板电器	151,300	7,035,450.00	0.10
23 9	002916	深南电路	62,548	6,950,959.24	0.10
24 0	000860	顺鑫农业	164,600	6,942,828.00	0.10

24 1	600061	国投资本	816,788	6,934,530.12	0.10
24 2	601727	上海电气	1,631,700	6,918,408.00	0.10
24 3	601618	中国中冶	2,273,400	6,774,732.00	0.10
24 4	000708	中信特钢	322,100	6,712,564.00	0.10
24 5	601162	天风证券	1,373,980	6,677,542.80	0.10
24 6	601021	春秋航空	116,915	6,652,463.50	0.10
24 7	600705	中航资本	1,705,900	6,601,833.00	0.10
24 8	601878	浙商证券	494,818	6,472,219.44	0.09
24 9	688363	华熙生物	23,100	6,418,566.00	0.09
25 0	002024	苏宁易购	1,145,200	6,401,668.00	0.09
25 1	603939	益丰药房	114,100	6,399,869.00	0.09
25 2	600606	绿地控股	1,166,900	6,359,605.00	0.09
25 3	601990	南京证券	588,200	6,187,864.00	0.09
25 4	002456	欧菲光	683,800	6,072,144.00	0.09
25 5	002157	正邦科技	499,800	5,972,610.00	0.09
25 6	002463	沪电股份	385,410	5,962,292.70	0.09
25	600011	华能国际	1,395,400	5,888,588.00	0.09

7					
25 8	000656	金科股份	1,016,600	5,886,114.00	0.09
25 9	600521	华海药业	277,700	5,798,376.00	0.08
26 0	601933	永辉超市	1,216,420	5,753,666.60	0.08
26 1	600655	豫园股份	494,100	5,726,619.00	0.08
26 2	603392	万泰生物	21,420	5,551,635.60	0.08
26 3	600118	中国卫星	188,200	5,506,732.00	0.08
26 4	601216	君正集团	1,073,600	5,464,624.00	0.08
26 5	600848	上海临港	305,240	5,463,796.00	0.08
26 6	601696	中银证券	263,200	5,419,288.00	0.08
26 7	600489	中金黄金	618,000	5,327,160.00	0.08
26 8	600018	上港集团	1,099,300	5,243,661.00	0.08
26 9	601995	中金公司	83,700	5,147,550.00	0.08
27 0	002558	巨人网络	386,600	5,141,780.00	0.08
27 1	603195	公牛集团	25,000	5,050,000.00	0.07
27 2	002120	韵达股份	369,471	4,998,942.63	0.07
27 3	601998	中信银行	970,300	4,948,530.00	0.07

27 4	601872	招商轮船	1,027,080	4,745,109.60	0.07
27 5	002673	西部证券	569,200	4,695,900.00	0.07
27 6	601319	中国人保	790,900	4,690,037.00	0.07
27 7	688009	中国通号	821,709	4,675,524.21	0.07
27 8	688126	沪硅产业	156,700	4,572,506.00	0.07
27 9	603338	浙江鼎力	77,900	4,571,951.00	0.07
28 0	601881	中国银河	409,600	4,415,488.00	0.06
28 1	603658	安图生物	56,450	4,277,216.50	0.06
28 2	600233	圆通速递	402,200	4,026,022.00	0.06
28 3	603233	大参林	76,000	3,884,360.00	0.06
28 4	600482	中国动力	207,570	3,615,869.40	0.05
28 5	601231	环旭电子	212,200	3,567,082.00	0.05
28 6	002153	石基信息	143,700	3,378,387.00	0.05
28 7	600025	华能水电	577,700	3,344,883.00	0.05
28 8	002032	苏泊尔	52,000	3,317,080.00	0.05
28 9	002939	长城证券	292,800	3,258,864.00	0.05
29	000800	一汽解放	294,100	3,182,162.00	0.05

0					
29 1	601236	红塔证券	229,100	3,106,596.00	0.05
29 2	601808	中海油服	186,800	2,682,448.00	0.04
29 3	600918	中泰证券	246,600	2,668,212.00	0.04
29 4	002773	康弘药业	115,350	2,668,045.50	0.04
29 5	601698	中国卫通	137,500	2,226,125.00	0.03
29 6	603087	甘李药业	19,406	2,068,291.48	0.03
29 7	002739	万达电影	126,450	1,996,645.50	0.03
29 8	600299	安迪苏	129,300	1,546,428.00	0.02
29 9	002945	华林证券	85,000	1,174,700.00	0.02

### 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	688317	之江生物	5,740	366,326.80	0.01
2	300957	贝泰妮	853	214,921.88	0.00
3	688677	海泰新光	1,768	182,510.64	0.00
4	688687	凯因科技	5,354	149,804.92	0.00
5	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.00
6	300979	华利集团	925	80,937.50	0.00
7	688662	富信科技	2,556	75,427.56	0.00
8	688663	新风光	3,279	62,989.59	0.00

9	688350	富淼科技	2,552	57,266.88	0.00
10	688191	智洋创新	3,203	56,821.22	0.00
11	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.00
12	300981	中红医疗	601	54,324.39	0.00
13	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
14	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.00
15	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.00
16	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
17	688597	煜邦电力	3,907	39,695.12	0.00
18	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
19	688067	爱威科技	1,259	31,260.97	0.00
20	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
21	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
22	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
23	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.00
24	300941	创识科技	399	19,926.06	0.00
25	301015	N百洋	462	17,939.46	0.00
26	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
27	300932	三友联众	492	15,601.32	0.00
28	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
29	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
30	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
31	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
32	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
33	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
34	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
35	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00
36	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
37	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
38	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
39	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00

40	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
41	301016	N雷尔伟	275	9,069.50	0.00
42	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
43	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
44	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
45	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
46	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
47	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
48	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
49	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
50	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
51	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
52	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
53	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
54	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
55	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
56	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
57	301004	C嘉益	312	6,845.28	0.00
58	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
59	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
60	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
61	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
62	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
63	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
64	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
65	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
66	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00
67	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
68	605011	N杭热	525	4,662.00	0.00
69	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
70	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00

71	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
72	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
73	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
74	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00

## 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	69,923,832.32	1.18
2	000858	五粮液	56,664,743.98	0.95
3	000333	美的集团	44,150,906.74	0.74
4	002415	海康威视	37,154,843.89	0.63
5	300274	阳光电源	32,573,805.00	0.55
6	000651	格力电器	29,506,112.35	0.50
7	601816	京沪高铁	28,457,451.00	0.48
8	000725	京东方A	28,419,116.00	0.48
9	002475	立讯精密	26,274,443.59	0.44
10	000661	长春高新	26,205,415.82	0.44
11	000568	泸州老窖	25,629,003.97	0.43
12	688111	金山办公	25,040,261.45	0.42
13	300059	东方财富	23,219,052.97	0.39
14	000001	平安银行	22,285,766.51	0.38
15	300450	先导智能	21,667,049.13	0.36
16	002594	比亚迪	20,894,589.00	0.35
17	300015	爱尔眼科	20,865,801.49	0.35
18	000002	万科A	20,555,999.15	0.35
19	002714	牧原股份	20,147,297.24	0.34
20	300122	智飞生物	18,077,072.90	0.30

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	000858	五 粮 液	51,274,832.71	0.86
2	000333	美的集团	36,571,991.41	0.62
3	000651	格力电器	24,358,132.77	0.41
4	000661	长春高新	24,091,624.08	0.41
5	000568	泸州老窖	23,459,686.00	0.39
6	300059	东方财富	20,384,510.80	0.34
7	601318	中国平安	19,657,614.35	0.33
8	002594	比亚迪	18,779,320.00	0.32
9	600036	招商银行	18,220,345.00	0.31
10	000001	平安银行	17,863,645.13	0.30
11	002714	牧原股份	15,762,711.26	0.27
12	000002	万 科 A	15,664,585.00	0.26
13	002415	海康威视	15,455,868.18	0.26
14	002475	立讯精密	14,926,131.51	0.25
15	002352	顺丰控股	14,581,364.32	0.25
16	000725	京东方 A	11,395,072.00	0.19
17	002304	洋河股份	10,957,461.54	0.18
18	002460	赣锋锂业	10,896,304.37	0.18
19	600276	恒瑞医药	9,562,124.40	0.16
20	002371	北方华创	9,484,381.26	0.16

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	1,523,696,753.70
卖出股票收入（成交）总额	1,161,627,353.16

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)	5,135,288.80	0.07
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	5,135,288.80	0.07

### 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	113050	南银转债	39,740	3,974,000.00	0.06
2	127036	三花转债	3,120	408,688.80	0.01
3	127038	国微转债	3,560	356,000.00	0.01
4	113049	长汽转债	2,360	236,000.00	0.00
5	123117	健帆转债	1,606	160,600.00	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 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动	风险说明
IF2107	IF2107	23	35,819,280.00	858,840.00	-
IF2108	IF2108	4	6,212,400.00	-7,620.00	-
公允价值变动总额合计(元)					851,220.00
股指期货投资本期收益(元)					1,616,419.81
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-991,440.00

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

在实际进行投资运作时，由于ETF基金一般需要满仓操作，同时基金需要备出一定的现金头存应对申赎及费用等支付，因此仓位无法达到100%，这时基金仓位就存在裸露风险，通过套期保值方式买入期货合约，可以使基金仓位达到100%，避免仓位暴露的风险。股指期货在买入时总持仓量采用双限制策略，一是限制基金组合中总的股指期货持仓量不能超过向中金所申请并获批的套保总量；二是限制基金组合持有的股指期货合约价值加上基金组合中其他有价证券市值占基金净资产的比例不能超过法规规定的上限，并在股指期货的交易过程中严格遵守基金合同的约束和中金所的规定。根据本基金的基金合同、投资范围、投资目标、投资策略以及对市场走势研判的基础上，结合基金日常的申购赎回情况，制定套期保值交易的合理期限。套期保值的期限一般不超过股指期货当前的最远到期日合约，即次季合约。按照交易月份相近的原则，综合考虑并动态跟踪不同到期日的期货合约的流动性、价差状况和展期风险等因素，选择合适月份的期货合约进行开仓和展期交易来实现远期套保的目的。另外对于交割月的股指期货，通常情况下，最晚在合约交割日进行平仓，尽量避免进行交割。在未来的股指期货交易过程中，本基金将严格遵守《证券投资基金参与股指期货交易指引》，以及中国金融期货交易所颁布的《中国金融期货交易所交易规则》、《中国金融期货交易所套期保值与套利交易管理办法》等相关规定，以套期保值为主要目的参与股指期货，严格控制交易中的各种风险。

### 7.11 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。

### 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2020年08月31日收到中国银行保险监督管理委员会福建监管局出具公开处罚的通报，于2020年09月04日收到中国人民银行福州中心支行出具公开处罚、公开批评的通报；【招商银行股份有限公司】于2021年05月17日收到中国银行保险监督管理委员会出具罚款处罚的通报。

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	6,463,892.86
2	应收证券清算款	13,662,019.11
3	应收股利	742,799.18
4	应收利息	362,999.94
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	75,616.24
8	其他	-
9	合计	21,307,327.33

### 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

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	600519	贵州茅台	41,134,000.00	0.60	转融通证券出借
2	000333	美的集团	26,992,134.00	0.39	转融通证券出借
3	002415	海康威视	23,110,350.00	0.34	转融通证券出借
4	601318	中国平安	21,501,660.00	0.31	转融通证券出借
5	601012	隆基股份	18,098,484.80	0.26	转融通证券出借
6	601888	中国中免	12,304,100.00	0.18	转融通证券出借
7	000858	五粮液	11,528,343.00	0.17	转融通证券出借
8	600276	恒瑞医药	7,619,437.00	0.11	转融通证券出借

#### 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

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	688317	之江生物	366,326.80	0.01	科创板打新限售
2	300957	贝泰妮	214,921.88	0.00	创业板打新限售
3	688677	海泰新光	182,510.64	0.00	科创板打新限售
4	688687	凯因科技	149,804.92	0.00	科创板打新限售
5	300919	中伟股份	99,430.00	0.00	创业板打新限售

#### 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

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		联接基金	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
5,323	947,907.10	42,044,916.00	0.83%	44,755,780.00	0.89%	4,958,908,800.00	98.28%

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总 份额比例
1	招商证券股份有限公司一天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金	4,958,908,800.00	98.28%
2	国泰君安证券股份有限公司	25,700,300.00	0.51%
3	方正证券股份有限公司	7,028,096.00	0.14%
4	招商证券股份有限公司	2,978,497.00	0.06%
5	蔡永超	2,350,800.00	0.05%
6	科银投资控股集团有限公司	1,853,500.00	0.04%

		0	
7	华泰证券股份有限公司	1,742,300.00	0.03%
8	中信证券股份有限公司	1,717,623.00	0.03%
9	时思聪	964,800.00	0.02%
10	张皓	752,600.00	0.01%

注：持有人为场内持有人。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

### 8.4 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	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2019年12月05日)基金份额总额	236,709,496.00
本报告期期初基金份额总额	4,421,709,496.00
本报告期基金总申购份额	1,485,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	861,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	5,045,709,496.00

## § 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，经天弘基金管理有限公司股东会2021年第2次会议审议通过，胡晓明先生、屠剑威先生、黄浩先生和卢信群先生不再担任公司董事。韩歆毅先生、周志峰先生、祖国明先生和张杰先生担任公司董事。

2021年5月4日，本基金托管人招商证券股份有限公司聘牛中强、张志斌任托管部副总经理。

### 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，无涉及公募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	
安信证券	1	7,636,979.91	0.29%	3,293.97	0.29%	-
渤海证券	1	13,184.80	0.00%	3.04	0.00%	-
长江证券	1	8,054,388.23	0.30%	3,473.85	0.30%	-
东方	2	17,765,155.51	0.66%	7,662.07	0.67%	-



财富证券						
方正证券	3	3,432,384.98	0.13%	1,480.42	0.13%	-
光大证券	3	1,061,085,947.98	39.68%	457,608.94	39.74%	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	3,749,299.74	0.14%	1,617.05	0.14%	-
开源证券	2	465,385,815.59	17.40%	200,721.94	17.43%	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	15,780,885.75	0.59%	6,806.45	0.59%	-
银河证券	1	44,032,251.61	1.65%	18,991.47	1.65%	-
招商证券	5	1,047,081,581.09	39.16%	449,778.42	39.06%	-
中金财富	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-

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等。

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：渤海证券深圳交易单元、方正证券深圳交易单元、光大证券深圳交易单元、广发证券上海交易单元、开源证券上海交易单元、银河证券上海交易单元、中金财富上海交易单元。

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
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	18,288,360.30	50.77%	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	6,813,425.69	18.92%	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	248,300.00	0.69%	-	-	-	-	-	-
银河证券	4,032,883.40	11.20%	-	-	-	-	-	-
招商证券	6,635,900.00	18.42%	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-

## 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终止深圳盈信基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定媒介	2021-01-01
2	天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金2020年第四季度报告	中国证监会指定媒介	2021-01-22
3	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会指定媒介	2021-01-25
4	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会指定媒介	2021-01-27
5	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会指定媒介	2021-01-30
6	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会指定媒介	2021-02-03

7	关于注意防范冒用天弘创新相关名义进行诈骗活动的风险提示	中国证监会指定媒介	2021-02-24
8	天弘基金管理有限公司关于防范不法分子冒用公司名义进行诈骗活动的风险提示	中国证监会指定媒介	2021-03-04
9	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会指定媒介	2021-03-24
10	天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金2020年年度报告	中国证监会指定媒介	2021-03-31
11	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金修订基金合同等法律文件的公告	中国证监会指定媒介	2021-03-31
12	天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金合同	中国证监会指定媒介	2021-03-31
13	天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金招募说明书(更新)	中国证监会指定媒介	2021-03-31
14	天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金托管协议	中国证监会指定媒介	2021-03-31
15	天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金产品资料概要(更新)	中国证监会指定媒介	2021-04-06
16	天弘创新资产管理有限公司关于防范不法分子冒用公司名义进行诈骗活动的风险提示	中国证监会指定媒介	2021-04-07
17	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会指定媒介	2021-04-19
18	天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金2021年第一季度报告	中国证监会指定媒介	2021-04-22
19	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会指定媒介	2021-05-14
20	天弘基金管理有限公司关于	中国证监会指定媒介	2021-05-20

	旗下部分基金新增中国中金财富证券有限公司为申购赎回代办证券公司的公告		
21	天弘基金管理有限公司关于董事长离任及总经理代行董事长职务的公告	中国证监会指定媒介	2021-06-02
22	天弘基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会指定媒介	2021-06-02
23	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会指定媒介	2021-06-12
24	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金新增国信证券股份有限公司为申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会指定媒介	2021-06-16

## § 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
联接基金	1	20210101-20210630	4,352,783,800.00	7,847,592,800.00	7,241,467,800.00	4,958,908,800.00	98.28%

#### 产品特有风险

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：

(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；

(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；

(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；

(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；

(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，可能出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元而面临的转换基金运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等风险。

注：申购份额包括申购或者买入基金份额，赎回份额包括赎回或者卖出基金份额。

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

在本报告期内，根据《公开募集证券投资基金运作指引第3号——指数基金指引》、《公开募集证券投资基金侧袋机制指引（试行）》及相关配套规则、《存托凭证发行与交易管理办法（试行）》等法律法规及各基金基金合同等法律文件的规定，本基金已于3月31日相应修订基金合同等法律文件，具体信息请参见基金管理人3月31日在规定媒介披露的《天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金修订基金合同等法律文件的公告》及更新的法律文件。

## § 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沪深300交易型开放式指数证券投资基金募集的文件
- 2、天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金合同
- 3、天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金托管协议
- 4、天弘沪深300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

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

天弘基金管理有限公司  
二〇二一年八月三十一日