

天弘中证 800 指数型发起式证券投资基金

2021 年年度报告

2021 年 12 月 31 日

基金管理人:天弘基金管理有限公司

基金托管人:广发证券股份有限公司

送出日期:2022 年 03 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。本年度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03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。

本报告期自2021年01月01日起至2021年12月31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、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	11
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	15
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	16
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	17
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	19
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	19
4.9 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	19
§5 托管人报告	19
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	20
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	20
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	20
§6 审计报告	20
6.1 审计报告基本信息	20
6.2 审计报告的基本内容	20
§7 年度财务报表	23
7.1 资产负债表	23
7.2 利润表	25
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	26
7.4 报表附注	28
§8 投资组合报告	58
8.1 期末基金资产组合情况	58
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	59
8.3 期末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	61
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	106
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	108
8.6 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	109
8.7 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	109
8.8 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	109
8.9 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	109
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	109

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	109
8.12 投资组合报告附注.....	109
§9 基金份额持有人信息.....	111
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	111
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	111
9.3 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.....	111
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	112
§10 开放式基金份额变动.....	112
§11 重大事件揭示.....	112
11.1 基金份额持有人大会决议.....	112
11.2 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.....	112
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	113
11.4 基金投资策略的改变.....	113
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	113
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	113
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	113
11.8 其他重大事件.....	114
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	118
12.1 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.....	119
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	119
§13 备查文件目录.....	120
13.1 备查文件目录.....	120
13.2 存放地点.....	120
13.3 查阅方式.....	120

§ 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	37,017,372.81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	13,894,373.82份	23,122,998.99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	020-87555129
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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.thfund.com.cn
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	中国上海市浦东新区东育路588号前滩中心42楼
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、基金净值表现及利润分配情况

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	2021年		2020年		2019年	
	天弘中证8 00A	天弘中证8 00C	天弘中证8 00A	天弘中证8 00C	天弘中证8 00A	天弘中证8 00C
本期已 实现收 益	2,118,14 4.07	3,012,90 3.40	13,689,20 0.87	4,706,96 5.18	2,630,02 0.76	470,010.3 2
本期利 润	546,805.4 6	907,231.0 8	10,196,24 9.25	5,457,30 8.60	20,117,47 1.36	8,896,00 5.97
加权平 均基金 份额本 期利润	0.0353	0.0391	0.1608	0.2523	0.2659	0.1995
本期加 权平均 净值利 润率	2.57%	2.87%	15.55%	22.64%	29.17%	22.18%
本期基 金份额 净值增 长率	1.92%	1.72%	36.12%	35.86%	39.64%	39.34%
3.1.2 期末数 据和指 标	2021年末		2020年末		2019年末	
期末可 供分配 利润	5,375,63 6.52	8,485,02 2.74	6,040,15 5.06	8,317,05 3.58	-40,505.5 1	-296,025. 05
期末可	0.3869	0.3670	0.3534	0.3380	-0.0003	-0.0108

可供分配基金份额利润						
期末基金资产净值	19,270,010.34	31,608,021.73	23,257,198.96	33,068,621.74	116,567,743.19	26,994,083.84
期末基金份额净值	1.3869	1.3670	1.3608	1.3439	0.9997	0.9892
3.1.3 累计期末指标	2021年末		2020年末		2019年末	
基金份额累计净值增长率	38.69%	36.70%	36.08%	34.39%	-0.03%	-1.08%

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

天弘中证800A

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
过去三个月	1.75%	0.69%	1.92%	0.69%	-0.17%	0.00%
过去六个月	-1.75%	0.89%	-2.28%	0.89%	0.53%	0.00%
过去一年	1.92%	1.02%	-0.63%	1.02%	2.55%	0.00%

过去三年	93.73%	1.20%	63.25%	1.21%	30.48%	-0.01%
过去五年	74.39%	1.12%	37.97%	1.13%	36.42%	-0.01%
自基金合同 生效日起至 今	38.69%	1.30%	16.96%	1.31%	21.73%	-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
过去三个月	1.70%	0.69%	1.92%	0.69%	-0.22%	0.00%
过去六个月	-1.85%	0.89%	-2.28%	0.89%	0.43%	0.00%
过去一年	1.72%	1.02%	-0.63%	1.02%	2.35%	0.00%
过去三年	92.56%	1.20%	63.25%	1.21%	29.31%	-0.01%
过去五年	72.54%	1.12%	37.97%	1.13%	34.57%	-0.01%
自基金合同 生效日起至 今	36.70%	1.30%	16.96%	1.31%	19.74%	-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-2021年12月31日)



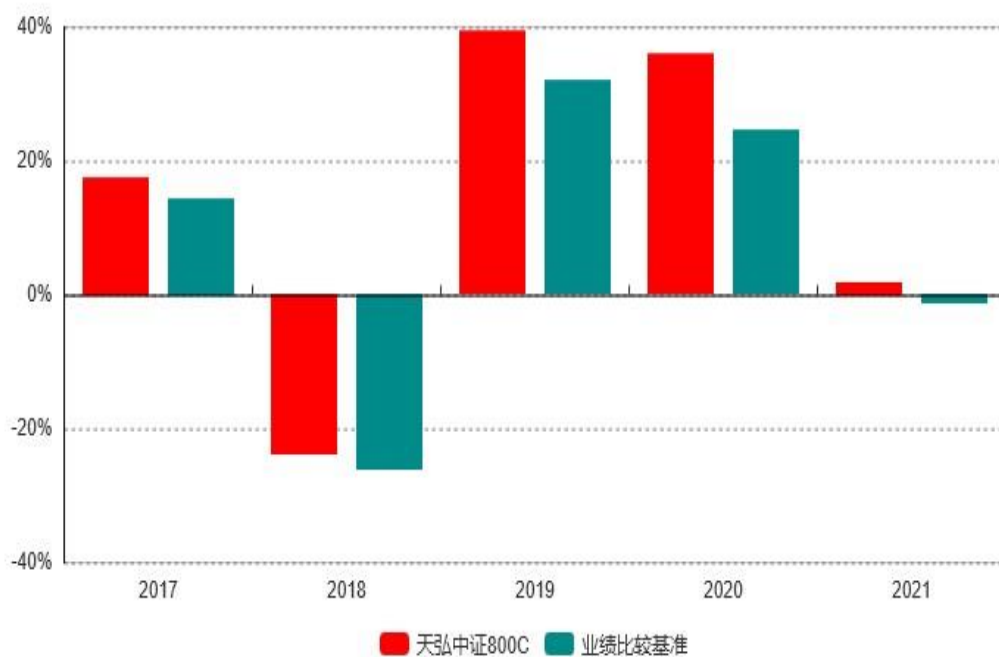
天弘中证800C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2015年07月16日-2021年12月31日)



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。

3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

§ 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12月31日，本基金管理人共管理144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、天弘中证食品饮料交易型开放式指数证券投资基金联接基金、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交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、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基金中基金（FOF）、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、天弘国证生物医药交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、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交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、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交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、天弘恒生科技指数型发起式证券投资基金（QDII）、天弘上海金交易型开放式证券投资基金、天弘恒新混合型证券投资基金、天弘高端制造混合型证券投资基金、天弘中证科创创业50指数证券投资基金、天弘中证芯片产业指数型发起式证券投资基金、天弘恒生沪深港创新药精选50交易型开放式指数证券投资基金、天弘安悦90天滚动持有短债债券型发起式证券投资基金、天弘宁弘六个月持有期混合型证券投资基金、天弘齐享债券型发起式证券投资基金、天弘睿选利率债债券型发起式证券投资基金、天弘永利优佳混合型证券投资基金、天弘裕新混合型证券投资基金、天弘中证沪港深科技龙头指数型发起式证券投资基金、天弘中证沪港深物联网主题交易型开放式指数证券投资基金、天弘中证机器人交易型开放式指数证券投资基金、天弘中证人工智能主题指数型发起式证券投资基金、天弘中证食品饮料交易型开放式指数证券投资基金、天弘中证医药主题指数增强型证券投资基金、天弘国证建筑材料指数型发起式证券投资基金、天弘旗舰精选3个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、天弘新享一年定期开放债券型发起式证券投资基金、天弘鑫悦成长混合型证券投资基金、天弘永丰稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、天弘中证高端装备制造指数增强型证券投资基金、天弘中证沪港深线上消费主题交易型开放式指数证券投资基金、天弘中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金、天弘中证新材料主题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	说明
		任职	离任		

		日期	日期	年限	
张子法	本基金基金经理	2017年04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、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 公平交易制度和控制方法

基金管理人一直坚持公平对待旗下所有基金的原则，严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，在研究分析、投资决策和交易执行等各个环节落实公平交易原则。公平交易范围包括各类投资组合、所有投资交易品种、以及一级市场申购、二级市场交易等所有投资交易管理活动及授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

针对公司旗下所有投资组合的交易所公开竞价交易，通过交易系统内的公平交易程序，对于不同投资组合同日同向买卖同一证券的指令自动进行比例分配。针对场外网下交易业务，依照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部场外、网下交易业务的相关规定，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。对于以公司名义进行的交易严格按照发行分配的原则或价格优先、比例分配的原则在各投资组合间进行分配。

4.3.2 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。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易次数为10次，投资组合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易，未导致不公平交易和利益输送。

4.4 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，本基金跟踪误差的来源主要是申购赎回、标的指数样本股调整、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2021年12月31日，天弘中证800A基金份额净值为1.3869元，天弘中证800C基金份额净值为1.3670元。报告期内份额净值增长率天弘中证800A为1.92%，同期业绩比较基准增长率为-0.63%；天弘中证800C为1.72%，同期业绩比较基准增长率为-0.63%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

我国经济持续恢复，2021年GDP总量再度突破100万亿，实现同比增长8.1%，完成了2021年两会设定GDP同比增长6%的目标，2021年四季度GDP同比增长4%，全年城镇固定资产投资同比增长4.90%，规模以上工业企业利润两年平均增速18.2%，仍在较高增速区间，且盈利景气面扩大。行业间利润格局正式启动改善进程，上游利润增速的增幅放缓、利润占比下降，下游利润增速开启回升、占比提高。分行业看，新技术、装备、消费品等制造业利润增速较快。工业企业经济效益向好，资产负债率、周转期指标在同比、环比层面均有改善，未来行业间利润格局料还将进一步优化，市场主体发展环境持续向好。月度来看，2021年12月国内工业生产保持稳中有进的态势，继续保持小幅回升，发展韧性凸显，工业增加值同比增长4.3%，高于预期值，国民经济已经形成稳中加固的恢复态势。

展望2022年经济，全球疫情仍在反复，地缘政治风险加剧，全球供应链尤其是能源和粮食受到冲击，欧美经济增长趋缓，高通胀持续下货币紧缩预期强烈，世界银行下调2022年全球经济增长预期至4.1%，外部环境趋向复杂严峻和不确定。国内经济也面临需求收缩、供给冲击、预期转弱的压力，但我们也看到，国内经济韧性较强，跨周期和逆周期政策适当前置，稳经济稳增长措施密集发布，继央行全面降准、下调1年期LPR利率之后，近期央行又下调MLF操作利率和公开市场逆回购操作10个基点，促进实体经济融资成本稳中有降，有效提振了市场信心，后续或有更多的稳增长措施出台，以助力2022年经济发展起好步，根据央行测算，2022年我国GDP潜在增速大约为5.5%左右，在科技创新和能源革命的两大浪潮推动下，中国经济的高质量发展、绿色发展的长期动力非常充沛。

当前，从A股整体估值水平来看，估值中位数大幅下降。截止至2022年1月底，全部A股市盈率（TTM）中位数为33.6倍，当前估值水平处于自2000年以来的25%历史分位数附近，整体估值水平偏低，低于2000年至2022年1月底整体历史中枢43倍的位置。基本面方面，节前稳增长政策密集部署，节后有望加速落地；流动性方面，当前无风险利率处历史低位，货币宽松仍将持续。风险偏好方面，海外加息预期对市场风险偏好造成压制，但这一因素也在逐渐被市场消化。经过近期的大幅调整后，市场负面情绪已获得较为充分的释放，A股权益资产优势较为明显，目前市场属于“黎明前的黑暗”，市场已进入磨底后期。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人的监察稽核工作一切从合规运作、防范和控制风险、保障基金份额持有人利益出发，由独立的内控合规部门按照规定的权限和程序，认真履行职责，对公司、基金运作及员工行为的合法性、合规性进行定期和不定期监督和检查。发现问题及时提出建议并督促相关部门改进完善，及时与有关人员沟通，并定期制作监察稽核报告报公司董事会。公司经理层面成立了风险管理委员会，根据公司总体风险控

制目标，分配各业务和各环节风险控制目标和要求；落实公司重大风险管理的决定或决议；听取并讨论会议成员的报告；对会议成员提出的或发现的已经存在的风险点，在充分讨论、协调基础上形成具体的风险控制措施；对潜在风险点分析讨论，拟定应对措施；对发生的风险事件和重大差错，分析原因、总结经验教训、风险定级、划分责任，向总经理办公会报告。

同时，本基金管理人根据全面性原则、独立性原则、相互制约原则、定性和定量相结合原则、重要性原则建立了一套比较完整的内部控制体系，该内部控制体系由一系列业务管理制度及相应的业务处理、控制程序组成，具体包括控制环境、风险评估、控制活动、信息和沟通、监控等要素。本基金管理人已通过了 ISAE3402（《国际鉴证业务准则第 3402 号》）认证，获得无保留意见的控制设计适当性报告。

本报告期，本基金管理人全面开展基金运作监察稽核工作，确保基金投资、营销及后台运作等各环节的合法合规。通过定期检查、不定期抽查等工作方法，完善内部控制，基金运作没有出现违规行为。本报告期内，本基金管理人有关本基金的监察稽核主要工作如下：

1、在研究环节，加强研究业务独立性，注重程序合规和质量控制；在关注研究报告形式与内容的合法性基础上，跟踪检查投资备选库的入选、维护依据；进一步规范新股、新债询价、申购流程；定期检查关联方关系以及关联交易的日常维护；定期评估研究对投资的支持程度，对投资业绩的贡献度；

2、在投资交易环节，对投资运作过程中的风险点进行识别和监控，预防和控制由内部或外部流程、人员和系统失控而造成的损失；根据法律法规要求、基金合同约定、投资决策委员会的决定，适时提出增加或优化交易系统风控指标的建议，通过投资交易系统控制投资风险；跟踪每日的交易行为和交易结果，发现预警信息通过电话、邮件及合规提示及时提醒，保障投资环节的合规运作；监督检查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合规执行情况，保证各投资组合场外交易的事中合规控制；

3、投资管理人员管理环节，加强对投资管理人员即时聊天工具、办公电话、移动电话、终端设备网上交易的合规监控，监督投资管理人员直系亲属账户及股票交易申报制度、交易时间移动电话集中保管制度的有效执行，采取各种有效方式杜绝老鼠仓、非公平交易及各种形式的利益输送行为；

4、基金募集与营销环节，对基金宣传推介材料及定投、费率优惠等基金销售业务活动进行事前合规检查，做到事前防范风险，保障基金营销合法合规。在基金利用互联网平台营销方面，对各类新兴业务的活动方案进行事前合规评估，保证业务开展的同时注重事前风险防范；

5、基金运营环节，加强对注册登记、会计核算、基金清算、估值业务的稽核力度，保证基金运营安全、准确；

6、信息披露环节，严格按照信息披露管理办法的规定，认真做好本基金的信息披露工作，保证信息披露的真实、准确、完整、及时。

报告期内，本基金整体运作合法合规，内部控制和风险防范措施逐步完善，保障了基金份额持有人的利益。本基金管理人将继续以合规运作、防范和控制风险、保障基金份额持有人利益出发，提高内部控制和风险管理的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

4.7 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。

4.8 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。

4.9 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遵规守信、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 托管人对本年度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2021年年度报告中财务指标、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 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2022)第22410号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	天弘中证800指数型发起式证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	(一)我们审计的内容 我们审计了天弘中证800指数型发起式证券投资基金(以下简称“天弘中证800指数基金”)的财务报表,包括2021年12月31日的资产负债表,2021年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。(二)我们的意见 我们认为,后附的财务报表在所有

	重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了天弘中证800指数基金2021年12月31日的财务状况以及2021年度的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于天弘中证800指数基金,并履行了职业道德方面的其他责任。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	无
管理层和治理层对财务报表的责任	天弘中证800指数基金的基金管理人天弘基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估天弘中证800指数基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算天弘中证800指数基金、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督天弘中证800指数基金的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出

具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：（一）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。（二）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。（三）评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。（四）对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对天弘中证800指数基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致天弘中证800指数基金不能持续经营。（五）评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内

	部控制缺陷。
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	张振波、林佳璐
会计师事务所的地址	中国上海市浦东新区东育路588号前滩中心42楼
审计报告日期	2022-03-28

§ 7 年度财务报表

7.1 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：2021年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	2,824,212.19	3,711,103.09
结算备付金		46,832.82	4,621.92
存出保证金		13,339.09	97,770.07
交易性金融资产	7.4.7.2	48,203,138.83	53,459,725.91
其中：股票投资		48,142,842.73	53,430,525.91
基金投资		-	-
债券投资		60,296.10	29,200.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		54,326.58	-
应收利息	7.4.7.5	652.11	826.10
应收股利		-	-
应收申购款		86,397.05	128,766.38
递延所得税资产		-	-

其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		51,228,898.67	57,402,813.47
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		4,794.43	137,048.17
应付赎回款		168,811.64	712,303.48
应付管理人报酬		21,933.04	23,409.38
应付托管费		4,386.61	4,681.87
应付销售服务费		5,397.23	5,435.24
应付交易费用	7.4.7.7	7,501.10	6,001.14
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	138,042.55	188,113.49
负债合计		350,866.60	1,076,992.77
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	37,017,372.81	41,698,216.55
未分配利润	7.4.7.10	13,860,659.26	14,627,604.15
所有者权益合计		50,878,032.07	56,325,820.70
负债和所有者权益总计		51,228,898.67	57,402,813.47

注：报告截止日2021年12月31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1.3869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1.3670元；基金份额总额37,017,372.81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13,894,373.82份，天弘中证800指数型发起式证券投资基金C类基金份额23,122,998.99份。

7.2 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：2021年01月01日至2021年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021年01月01日至 2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至202 0年12月31日
一、收入		2,045,293.06	16,753,060.65
1. 利息收入		23,935.61	47,180.34
其中：存款利息收入	7.4.7.11	23,908.04	47,165.07
债券利息收入		27.57	15.27
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）		5,587,101.63	19,404,026.92
其中：股票投资收益	7.4.7.12	4,715,388.41	18,300,370.64
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	28,965.96	20,950.30
资产支持证券投资 收益	7.4.7.13. 3	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	842,747.26	1,082,705.98
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-3,677,010.93	-2,742,608.20
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-

5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	111,266.75	44,461.59
减：二、费用		591,256.52	1,099,502.80
1. 管理人报酬		264,549.52	452,399.59
2. 托管费		52,909.92	90,479.93
3. 销售服务费		63,106.68	48,361.11
4. 交易费用	7.4.7.19	48,330.40	295,902.17
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	7.4.7.20	162,360.00	212,360.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		1,454,036.54	15,653,557.85
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		1,454,036.54	15,653,557.85

7.3 所有者权益（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：2021年01月01日至2021年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2021年01月01日至2021年12月31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)	41,698,216.55	14,627,604.15	56,325,820.70
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,454,036.54	1,454,036.54
三、本期基金份额	-4,680,843.74	-2,220,981.43	-6,901,825.17

交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)			
其中: 1. 基金申购款	48,434,781.37	17,735,676.91	66,170,458.28
2. 基金赎回款	-53,115,625.11	-19,956,658.34	-73,072,283.45
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)	37,017,372.81	13,860,659.26	50,878,032.07
项 目	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31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)	143,898,357.59	-336,530.56	143,561,827.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	15,653,557.85	15,653,557.85
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)	-102,200,141.04	-689,423.14	-102,889,564.18
其中: 1. 基金申购款	132,607,027.91	14,367,256.83	146,974,284.74
2. 基金赎回款	-234,807,168.95	-15,056,679.97	-249,863,848.92

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）	41,698,216.55	14,627,604.15	56,325,820.70

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4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

7.4 报表附注

7.4.1 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×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。

本财务报表由本基金的基金管理人天弘基金管理有限公司于2022年3月28日批准报出。

7.4.2 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7.4.4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。

7.4.3 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12月31日的财务状况以及2021年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(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。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认

列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

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。

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。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产

生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和可交换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和可交换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的

银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 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14号-收入》，本基金于2021年1月1日起执行。本基金在编制2021年度财务报表时已采用该准则，该准则的采用未对本基金财务报表产生重大影响。

7.4.5.2 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。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
活期存款	2,824,212.19	3,711,103.09
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	2,824,212.19	3,711,103.09

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	43,873,891.90	48,142,842.73	4,268,950.83
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-

债券	交易所市场	60,000.00	60,296.10	296.10
	银行间市场	-	-	-
	合计	60,000.00	60,296.10	296.10
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		43,933,891.90	48,203,138.83	4,269,246.93
项目	上年度末 2020年12月31日			
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		45,484,268.05	53,430,525.91	7,946,257.86
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	29,200.00	29,200.00	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	29,200.00	29,200.00	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		45,513,468.05	53,459,725.91	7,946,257.86

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应收活期存款利息	620.66	773.14
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	23.21	2.31
应收债券利息	1.64	2.25
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	-	-
其他	6.60	48.40
合计	652.11	826.10

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
交易所市场应付交易费用	7,501.10	6,001.14
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	7,501.10	6,001.14

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	42.55	113.49

应付证券出借违约金	-	-
预提费用	130,000.00	180,000.00
其他应付	8,000.00	8,000.00
合计	138,042.55	188,113.49

7.4.7.9 实收基金

7.4.7.9.1 天弘中证800A

金额单位：人民币元

项目 (天弘中证800A)	本期 2021年01月01日至2021年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	17,091,316.79	17,091,316.79
本期申购	15,162,570.91	15,162,570.91
本期赎回(以“-”号填列)	-18,359,513.88	-18,359,513.88
本期末	13,894,373.82	13,894,373.82

7.4.7.9.2 天弘中证800C

金额单位：人民币元

项目 (天弘中证800C)	本期 2021年01月01日至2021年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	24,606,899.76	24,606,899.76
本期申购	33,272,210.46	33,272,210.46
本期赎回(以“-”号填列)	-34,756,111.23	-34,756,111.23
本期末	23,122,998.99	23,122,998.99

注：申购含转换转入份额；赎回含转换转出份额。

7.4.7.10 未分配利润

7.4.7.10.1 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

上年度末	6,040,155.06	125,727.11	6,165,882.17
本期利润	2,118,144.07	-1,571,338.61	546,805.46
本期基金份额交易产生的变动数	-1,365,129.14	28,078.03	-1,337,051.11
其中：基金申购款	6,295,948.42	-471,023.48	5,824,924.94
基金赎回款	-7,661,077.56	499,101.51	-7,161,976.05
本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,793,169.99	-1,417,533.47	5,375,636.52

7.4.7.10.2 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
上年度末	8,317,053.58	144,668.40	8,461,721.98
本期利润	3,012,903.40	-2,105,672.32	907,231.08
本期基金份额交易产生的变动数	-485,446.88	-398,483.44	-883,930.32
其中：基金申购款	13,608,101.87	-1,697,349.90	11,910,751.97
基金赎回款	-14,093,548.75	1,298,866.46	-12,794,682.29
本期已分配利润	-	-	-
本期末	10,844,510.10	-2,359,487.36	8,485,022.74

7.4.7.11 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 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
活期存款利息收入	23,318.87	44,061.27
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	287.48	996.73
其他	301.69	2,107.07

合计	23,908.04	47,165.07
----	-----------	-----------

7.4.7.12 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 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
卖出股票成交总额	27,962,050.53	182,332,617.75
减：卖出股票成本总额	23,246,662.12	164,032,247.11
买卖股票差价收入	4,715,388.41	18,300,370.64

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 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 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31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	28,965.96	20,950.30
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	28,965.96	20,950.30

7.4.7.13.2 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12月 31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月 31日
卖出债券(、债转 股及债券到期兑	213,094.14	113,963.32

付) 成交总额		
减: 卖出债券 (、 债转股及债券到期 兑付) 成本总额	184,100.00	92,999.59
减: 应收利息总额	28.18	13.43
买卖债券差价收入	28,965.96	20,950.30

7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间未取得资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间未取得贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间未取得买卖权证差价收入。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间未取得其他衍生工具投资收益。

7.4.7.16 股利收益

单位: 人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021 年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020 年12月31日
股票投资产生的股利收益	842,747.26	1,082,705.98
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	842,747.26	1,082,705.98

7.4.7.17 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12	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12

	月31日	月31日
1. 交易性金融资产	-3,677,010.93	-2,742,608.20
——股票投资	-3,677,307.03	-2,742,608.20
——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	-3,677,010.93	-2,742,608.20

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
基金赎回费收入	14,522.16	43,864.93
基金转换费收入	6,186.80	596.66
其他	90,557.79	-
合计	111,266.75	44,461.59

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
交易所市场交易费用	48,330.40	295,902.17
银行间市场交易费用	-	-

合计	48,330.40	295,902.17
----	-----------	------------

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
审计费用	50,000.00	60,000.00
信息披露费	80,000.00	120,000.00
证券出借违约金	-	-
托管户账户管理费	360.00	360.00
指数使用费	32,000.00	32,000.00
合计	162,360.00	212,360.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

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
蚂蚁科技集团股份有限公司	基金管理人的股东
天津信托有限责任公司	基金管理人的股东
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
芜湖高新投资有限公司	基金管理人的股东
新疆天瑞博丰股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
新疆天惠新盟股权投资合伙企业（有限	基金管理人的股东

合伙)	
新疆天阜恒基股权投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
新疆天聚宸兴股权投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
天弘创新资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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12月31日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31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
广发证券股份有限公司	23,330,453.82	48.38%	209,860,922.68	79.80%

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 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12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总量的比例

广发证券股份有限公司	5,396.49	33.45%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31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	54,793.49	70.51%	3,838.63	63.97%

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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	264,549.52	452,399.59
其中：支付销售机构的客户维护费	70,938.55	66,900.15

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2021年01月01日至2021年12月31日	2020年01月01日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	52,909.92	90,479.93

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。

7.4.10.2.3 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		
	2021年01月01日至2021年12月31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	-	35,785.15	35,785.15
广发证券股份有限公司	-	622.90	622.90
合计	-	36,408.05	36,408.05
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2020年01月01日至2020年12月31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	-	20,999.44	20,999.44
广发证券股份有限公司	-	592.52	592.52
合计	-	21,591.96	21,591.96

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。

7.4.10.3 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。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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。

7.4.10.4.2 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。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

天弘中证800A

份额单位：份

项目	本期 2021年01月01日至 2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至 2020年12月31日
报告期初持有的基金份额	-	5,000,000.00
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	5,000,000.00
报告期末持有的基金份额	-	-

报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	0.00%
---------------------	---	-------

天弘中证800C

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2021年01月01日至 2021年12月31日	2020年01月01日至 2020年12月31日
报告期初持有的基金份额	-	17,236,632.82
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	17,236,632.82
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	0.00%

注：1、基金管理人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。

2、报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例，比例的分母分别采用各自级别的份额总额计算。

7.4.10.5.2 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。

7.4.10.6 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		上年度可比期间	
	2021年01月01日至2021年12月31日		2020年01月01日至2020年12月31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	2,824,212.19	23,318.87	3,711,103.09	44,061.27

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。

7.4.10.7 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。

7.4.10.8 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，估值总额为人民币120,491.00元（上年度末：102,564.00元），占基金资产净值的比例为0.24%（上年度末：0.18%）；持有君正集团的股票，估值总额为人民币29,288.00元（上年度末：35,640.00元），占基金资产净值的比例为0.06%（上年度末：0.06%）。

7.4.11 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。

7.4.12 期末（2021年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
001234	泰慕士	2021-12-31	2022-01-11	新股未上市	16.53	16.53	259	4,281.27	4,281.27	-
7.4.12.1.2 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
113052	兴业转债	2021-12-27	2022-01-14	新债未上市	100.00	100.00	580	58,000.00	58,000.00	-
113634	珀莱转债	2021-12-08	2022-01-04	新债未上市	100.00	100.00	10	1,000.00	1,000.00	-

注：1、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。

2、以上“可流通日”的日期，最终以上市公司公告为准。

7.4.12.2 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
002683	宏大爆破	2021-1-1 2021-2-2 2021-2-20	拟筹划重大资产重组	30.12	2022-01-04	31.00	700	25,113.79	21,084.00	-

注：本基金截至2021年12月31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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2021年12月31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。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2021年12月31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。

7.4.12.4 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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广发证券股份有限公司开立于具有基金托管人资格的银行的托管账户，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，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。

7.4.13.2.1 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。

7.4.13.2.2 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。

7.4.13.2.3 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。

7.4.13.2.4 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12月31日	上年度末 2020年12月31日
AAA	58,000.00	28,000.00
AAA以下	2,296.10	1,200.00
未评级	-	-
合计	60,296.10	29,200.00

7.4.13.2.5 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。

7.4.13.2.6 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。

7.4.13.3 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2021年12月31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。

7.4.13.3.1 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该比例限制)。

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7.4.12。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%。于2021年12月31日，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。于2021年12月31日，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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021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	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
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	3,711,103.09	-	-	-	3,711,103.09
结算备付金	4,621.92	-	-	-	4,621.92
存出保证金	97,770.07	-	-	-	97,770.07
交易性金融资产	-	-	29,200.00	53,430,525.91	53,459,725.91
应收利息	-	-	-	826.10	826.10
应收申购款	-	-	-	128,766.38	128,766.38
资产总计	3,813,495.08	-	29,200.00	53,560,118.39	57,402,813.47
负债					
应付证券清算款	-	-	-	137,048.17	137,048.17
应付赎回款	-	-	-	712,303.48	712,303.48
应付管理人报酬	-	-	-	23,409.38	23,409.38
应付托管费	-	-	-	4,681.87	4,681.87
应付销售服务费	-	-	-	5,435.24	5,435.24
应付交易费用	-	-	-	6,001.14	6,001.14
其他负债	-	-	-	188,113.49	188,113.49
负债总计	-	-	-	1,076,992.77	1,076,992.77
利率敏感度缺口	3,813,495.08	-	29,200.00	52,483,125.62	56,325,820.70

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2021年12月31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0.12%(2020年12月31日：0.05%)，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)。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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。

本基金采用完全复制法进行指数化投资，股票资产跟踪的标的指数为中证800指数，通过指数化分散投资降低其他价格风险。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，包括VaR(Value at Risk)指标等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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31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	48,142,842.73	94.62	53,430,525.91	94.86
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	-	-	-	-

一权证投资				
其他	-	-	-	-
合计	48,142,842.73	94.62	53,430,525.91	94.86

7.4.13.4.3.2 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12月31日	上年度末 2020年12月31日
	业绩比较基准上升5%	2,519,262.17	2,816,291.04
	业绩比较基准下降5%	-2,519,262.17	-2,816,291.04

7.4.14 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12月31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48,118,773.56元，属于第二层次的余额为84,365.27元，无属于第三层次的余额(2020年12月31日：第一层次53,249,947.83元，第二层次209,778.08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12月31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) 根据财政部发布的《企业会计准则第22号—金融工具确认计量》、《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》和《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”)相关衔接规定，以及财政部、银保监会于2020年12月30日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金应当自2022年1月1日起执行新金融工具准则。截至2021年12月31日，本基金已完成了执行新金融工具准则对财务报表潜在影响的评估。鉴于本基金业务的性质，新金融工具准则预期不会对本基金的财务状况和经营成果产生重大影响。

本基金将自2022年1月1日起追溯执行相关新规定，并采用准则允许的实务简便方法，调整期初所有者权益，2021年的比较数据将不作重述。

(3) 除公允价值和执行新金融工具准则外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	48,142,842.73	93.98
	其中：股票	48,142,842.73	93.98
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	60,296.10	0.12
	其中：债券	60,296.10	0.12
	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	2,871,045.01	5.60
8	其他各项资产	154,714.83	0.30
9	合计	51,228,898.67	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	531,060.40	1.04
B	采矿业	1,250,868.42	2.46
C	制造业	28,444,230.21	55.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,318,046.90	2.59
E	建筑业	835,512.15	1.64
F	批发和零售业	581,929.60	1.14
G	交通运输、仓储和邮政业	1,248,206.57	2.45
H	住宿和餐饮业	70,397.00	0.14
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,189,991.69	4.30
J	金融业	8,566,048.05	16.84
K	房地产业	946,133.10	1.86
L	租赁和商务服务业	630,543.90	1.24
M	科学研究和技术服务业	658,546.24	1.29
N	水利、环境和公共设施管理业	99,087.27	0.19
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	24,366.00	0.05
Q	卫生和社会工作	383,745.80	0.75

R	文化、体育和娱乐业	260,964.80	0.51
S	综合	84,537.60	0.17
	合计	48,124,215.70	94.59

8.2.2 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	18,627.03	0.04
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	18,627.03	0.04

8.3 期末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

8.3.1 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	1,000	2,050,000.00	4.03
2	300750	宁德时代	2,300	1,352,400.00	2.66
3	600036	招商银行	20,400	993,684.00	1.95
4	601318	中国平安	17,745	894,525.45	1.76
5	000858	五粮液	3,197	711,844.02	1.40
6	601012	隆基股份	7,112	613,054.40	1.20
7	000333	美的集团	8,086	596,827.66	1.17
8	300059	东方财富	13,726	509,371.86	1.00
9	601166	兴业银行	24,000	456,960.00	0.90
10	600900	长江电力	18,700	424,490.00	0.83
11	002415	海康威视	7,775	406,788.00	0.80
12	603259	药明康德	3,428	406,492.24	0.80
13	002594	比亚迪	1,500	402,180.00	0.79
14	002475	立讯精密	8,082	397,634.40	0.78
15	600276	恒瑞医药	7,415	376,014.65	0.74
16	600030	中信证券	14,000	369,740.00	0.73
17	601888	中国中免	1,600	351,056.00	0.69
18	600887	伊利股份	8,400	348,264.00	0.68
19	000568	泸州老窖	1,200	304,644.00	0.60
20	000651	格力电器	7,800	288,834.00	0.57
21	603501	韦尔股份	900	279,693.00	0.55
22	601398	工商银行	57,600	266,688.00	0.52
23	300760	迈瑞医疗	700	266,560.00	0.52
24	000001	平安银行	16,000	263,680.00	0.52
25	600309	万华化学	2,580	260,580.00	0.51
26	300274	阳光电源	1,740	253,692.00	0.50

27	002142	宁波银行	6,625	253,605.00	0.50
28	000725	京东方 A	49,500	249,975.00	0.49
29	600809	山西汾酒	780	246,308.40	0.48
30	002714	牧原股份	4,420	235,851.20	0.46
31	601899	紫金矿业	23,700	229,890.00	0.45
32	002352	顺丰控股	3,300	227,436.00	0.45
33	600031	三一重工	9,900	225,720.00	0.44
34	002812	恩捷股份	900	225,360.00	0.44
35	000002	万科 A	11,301	223,307.76	0.44
36	603288	海天味业	2,122	223,043.42	0.44
37	600436	片仔癀	500	218,575.00	0.43
38	300014	亿纬锂能	1,845	218,042.10	0.43
39	002241	歌尔股份	4,002	216,508.20	0.43
40	300124	汇川技术	3,100	212,660.00	0.42
41	601328	交通银行	45,100	207,911.00	0.41
42	600438	通威股份	4,500	202,320.00	0.40
43	600837	海通证券	16,000	196,160.00	0.39
44	601919	中远海控	10,490	196,058.10	0.39
45	300015	爱尔眼科	4,490	189,837.20	0.37
46	600690	海尔智家	6,300	188,307.00	0.37
47	600048	保利发展	11,900	185,997.00	0.37
48	002460	赣锋锂业	1,301	185,847.85	0.37
49	600406	国电南瑞	4,600	184,138.00	0.36
50	002466	天齐锂业	1,700	181,900.00	0.36
51	603799	华友钴业	1,616	178,260.96	0.35
52	000063	中兴通讯	5,300	177,550.00	0.35
53	601668	中国建筑	34,780	173,900.00	0.34
54	601288	农业银行	58,300	171,402.00	0.34
55	688981	中芯国际	3,200	169,568.00	0.33
56	600000	浦发银行	19,500	166,335.00	0.33
57	600111	北方稀土	3,600	164,880.00	0.32

58	002304	洋河股份	1,000	164,730.00	0.32
59	002230	科大讯飞	3,100	162,781.00	0.32
60	300122	智飞生物	1,300	161,980.00	0.32
61	600585	海螺水泥	4,001	161,240.30	0.32
62	600104	上汽集团	7,802	160,955.26	0.32
63	600016	民生银行	41,140	160,446.00	0.32
64	002129	中环股份	3,800	158,650.00	0.31
65	002049	紫光国微	700	157,500.00	0.31
66	601816	京沪高铁	32,600	157,458.00	0.31
67	002271	东方雨虹	2,950	155,406.00	0.31
68	600745	闻泰科技	1,200	155,160.00	0.30
69	601601	中国太保	5,650	153,228.00	0.30
70	601688	华泰证券	8,501	150,977.76	0.30
71	603986	兆易创新	852	149,824.20	0.29
72	300142	沃森生物	2,600	146,120.00	0.29
73	000100	TCL科技	23,300	143,761.00	0.28
74	300498	温氏股份	7,380	142,138.80	0.28
75	000338	潍柴动力	7,900	141,331.00	0.28
76	600893	航发动力	2,200	139,612.00	0.27
77	002371	北方华创	400	138,808.00	0.27
78	002027	分众传媒	16,760	137,264.40	0.27
79	000661	长春高新	500	135,700.00	0.27
80	300450	先导智能	1,820	135,353.40	0.27
81	601211	国泰君安	7,500	134,175.00	0.26
82	300782	卓胜微	400	130,720.00	0.26
83	601088	中国神华	5,500	123,860.00	0.24
84	601766	中国中车	20,200	123,018.00	0.24
85	600570	恒生电子	1,951	121,254.65	0.24
86	600050	中国联通	30,800	121,044.00	0.24
87	000776	广发证券	4,900	120,491.00	0.24
88	601229	上海银行	16,470	117,431.10	0.23

89	300347	泰格医药	900	115,020.00	0.23
90	600919	江苏银行	19,650	114,559.50	0.23
91	688599	天合光能	1,400	110,460.00	0.22
92	002709	天赐材料	954	109,376.10	0.21
93	601169	北京银行	24,600	109,224.00	0.21
94	600660	福耀玻璃	2,300	108,422.00	0.21
95	600999	招商证券	6,140	108,371.00	0.21
96	601988	中国银行	35,000	106,750.00	0.21
97	600905	三峡能源	14,200	106,642.00	0.21
98	688111	金山办公	402	106,530.00	0.21
99	600019	宝钢股份	14,792	105,910.72	0.21
10 0	600010	包钢股份	37,800	105,462.00	0.21
10 1	002311	海大集团	1,400	102,620.00	0.20
10 2	601669	中国电建	12,700	102,616.00	0.20
10 3	002410	广联达	1,600	102,368.00	0.20
10 4	002459	晶澳科技	1,100	101,970.00	0.20
10 5	600958	东方证券	6,900	101,706.00	0.20
10 6	600196	复星医药	2,000	97,880.00	0.19
10 7	601390	中国中铁	16,900	97,851.00	0.19
10 8	601633	长城汽车	2,000	97,080.00	0.19
10 9	601877	正泰电器	1,800	97,002.00	0.19
11	000625	长安汽车	6,360	96,608.40	0.19

0					
11 1	603659	璞泰来	600	96,366.00	0.19
11 2	601985	中国核电	11,600	96,280.00	0.19
11 3	000166	申万宏源	18,720	95,846.40	0.19
11 4	600588	用友网络	2,661	95,476.68	0.19
11 5	600028	中国石化	22,200	93,906.00	0.18
11 6	601658	邮储银行	18,000	91,800.00	0.18
11 7	000895	双汇发展	2,900	91,495.00	0.18
11 8	601818	光大银行	27,400	90,968.00	0.18
11 9	002493	荣盛石化	5,000	90,800.00	0.18
12 0	002179	中航光电	888	89,297.28	0.18
12 1	601377	兴业证券	8,900	87,932.00	0.17
12 2	002821	凯莱英	200	87,000.00	0.17
12 3	300408	三环集团	1,900	84,740.00	0.17
12 4	601628	中国人寿	2,800	84,252.00	0.17
12 5	000768	中航西飞	2,300	83,950.00	0.17
12 6	000538	云南白药	802	83,929.30	0.16

12 7	002340	格林美	7,950	82,282.50	0.16
12 8	600346	恒力石化	3,520	80,854.40	0.16
12 9	601989	中国重工	18,900	79,758.00	0.16
13 0	600763	通策医疗	400	79,600.00	0.16
13 1	601600	中国铝业	13,000	79,170.00	0.16
13 2	601857	中国石油	16,100	79,051.00	0.16
13 3	601138	工业富联	6,600	78,672.00	0.15
13 4	002001	新 和 成	2,520	78,422.40	0.15
13 5	601225	陕西煤业	6,400	78,080.00	0.15
13 6	600426	华鲁恒升	2,490	77,937.00	0.15
13 7	300316	晶盛机电	1,100	76,450.00	0.15
13 8	603806	福斯特	585	76,371.75	0.15
13 9	002050	三花智控	3,013	76,228.90	0.15
14 0	300433	蓝思科技	3,300	75,834.00	0.15
14 1	002008	大族激光	1,400	75,600.00	0.15
14 2	002202	金风科技	4,551	74,954.97	0.15
14	000733	振华科技	600	74,568.00	0.15

3					
14 4	600150	中国船舶	3,000	74,370.00	0.15
14 5	601009	南京银行	8,300	74,368.00	0.15
14 6	600009	上海机场	1,586	74,050.34	0.15
14 7	600741	华域汽车	2,600	73,580.00	0.14
14 8	600522	中天科技	4,300	72,928.00	0.14
14 9	600176	中国巨石	4,001	72,818.20	0.14
15 0	300413	芒果超媒	1,270	72,669.40	0.14
15 1	600011	华能国际	7,300	70,737.00	0.14
15 2	001979	招商蛇口	5,300	70,702.00	0.14
15 3	000723	美锦能源	4,300	69,789.00	0.14
15 4	002236	大华股份	2,950	69,266.00	0.14
15 5	601100	恒立液压	844	69,039.20	0.14
15 6	300601	康泰生物	700	68,978.00	0.14
15 7	601615	明阳智能	2,600	67,860.00	0.13
15 8	600157	永泰能源	36,900	67,158.00	0.13
15 9	600760	中航沈飞	960	65,318.40	0.13

16 0	603993	洛阳钼业	11,700	65,286.00	0.13
16 1	600584	长电科技	2,100	65,142.00	0.13
16 2	601939	建设银行	11,100	65,046.00	0.13
16 3	600399	抚顺特钢	2,600	64,402.00	0.13
16 4	601066	中信建投	2,200	64,350.00	0.13
16 5	600989	宝丰能源	3,700	64,232.00	0.13
16 6	300751	迈为股份	100	64,230.00	0.13
16 7	601006	大秦铁路	9,900	63,360.00	0.12
16 8	600926	杭州银行	4,920	63,074.40	0.12
16 9	688036	传音控股	400	62,760.00	0.12
17 0	600885	宏发股份	840	62,697.60	0.12
17 1	000009	中国宝安	4,320	62,337.60	0.12
17 2	002384	东山精密	2,300	62,330.00	0.12
17 3	600884	杉杉股份	1,900	62,263.00	0.12
17 4	002602	世纪华通	7,395	62,044.05	0.12
17 5	003816	中国广核	19,600	61,348.00	0.12
17	601117	中国化学	5,100	61,200.00	0.12

6					
17 7	601360	三六零	4,800	61,056.00	0.12
17 8	000977	浪潮信息	1,700	60,911.00	0.12
17 8	000786	北新建材	1,700	60,911.00	0.12
18 0	600132	重庆啤酒	400	60,528.00	0.12
18 1	605358	立昂微	500	60,005.00	0.12
18 2	601555	东吴证券	6,747	59,778.42	0.12
18 3	002555	三七互娱	2,200	59,444.00	0.12
18 4	600600	青岛啤酒	600	59,400.00	0.12
18 5	601186	中国铁建	7,600	59,280.00	0.12
18 6	000157	中联重科	8,200	58,794.00	0.12
18 7	601868	中国能建	21,499	58,692.27	0.12
18 8	688008	澜起科技	696	58,373.52	0.11
18 9	002013	中航机电	3,200	58,176.00	0.11
19 0	000963	华东医药	1,447	58,169.40	0.11
19 1	300033	同花顺	400	57,832.00	0.11
19 2	000876	新希望	3,801	57,813.21	0.11

19 3	688005	容百科技	500	57,790.00	0.11
19 4	002385	大北农	5,500	57,695.00	0.11
19 5	603486	科沃斯	380	57,361.00	0.11
19 6	600029	南方航空	8,400	57,204.00	0.11
19 7	002601	龙佰集团	2,000	57,180.00	0.11
19 8	600015	华夏银行	10,200	57,120.00	0.11
19 9	600547	山东黄金	3,016	56,761.12	0.11
20 0	300759	康龙化成	400	56,508.00	0.11
20 1	300037	新宙邦	500	56,500.00	0.11
20 2	600886	国投电力	4,900	56,203.00	0.11
20 3	603882	金域医学	500	55,685.00	0.11
20 4	300285	国瓷材料	1,300	55,341.00	0.11
20 5	002736	国信证券	4,800	55,104.00	0.11
20 6	601238	广汽集团	3,600	54,684.00	0.11
20 7	000425	徐工机械	9,100	54,509.00	0.11
20 8	601336	新华保险	1,401	54,470.88	0.11
20	300088	长信科技	4,100	54,448.00	0.11

9					
21 0	603369	今世缘	1,000	54,400.00	0.11
21 1	600352	浙江龙盛	4,300	54,309.00	0.11
21 2	002268	卫 士 通	970	54,261.80	0.11
21 3	002007	华兰生物	1,855	54,054.70	0.11
21 4	300896	爱美客	100	53,611.00	0.11
21 5	601901	方正证券	6,800	53,312.00	0.10
21 6	603392	万泰生物	240	53,160.00	0.10
21 7	000938	紫光股份	2,323	53,080.55	0.10
21 8	002180	纳思达	1,100	52,536.00	0.10
21 9	603019	中科曙光	1,900	52,383.00	0.10
22 0	688099	晶晨股份	400	52,080.00	0.10
22 1	600765	中航重机	1,000	50,490.00	0.10
22 2	688012	中微公司	396	50,133.60	0.10
22 3	600862	中航高科	1,400	50,064.00	0.10
22 4	601800	中国交建	5,800	49,764.00	0.10
22 5	600256	广汇能源	7,600	49,704.00	0.10

22 6	600085	同仁堂	1,100	49,478.00	0.10
22 7	600383	金地集团	3,800	49,286.00	0.10
22 8	002028	思源电气	1,000	49,210.00	0.10
22 9	000596	古井贡酒	201	49,044.00	0.10
23 0	300628	亿联网络	600	48,870.00	0.10
23 1	002841	视源股份	600	48,840.00	0.10
23 2	601916	浙商银行	13,900	48,650.00	0.10
23 3	600141	兴发集团	1,280	48,486.40	0.10
23 4	600298	安琪酵母	800	48,288.00	0.09
23 5	000783	长江证券	6,400	48,256.00	0.09
23 6	300595	欧普康视	840	48,190.80	0.09
23 7	000069	华侨城 A	6,800	47,872.00	0.09
23 8	600487	亨通光电	3,160	47,779.20	0.09
23 9	601788	光大证券	3,200	47,776.00	0.09
24 0	300003	乐普医疗	2,100	47,523.00	0.09
24 1	000988	华工科技	1,700	47,362.00	0.09
24	002185	华天科技	3,700	47,027.00	0.09

2					
24 3	600115	中国东航	9,100	46,956.00	0.09
24 4	300253	卫宁健康	2,800	46,928.00	0.09
24 5	600795	国电电力	14,800	46,916.00	0.09
24 6	600754	锦江酒店	800	46,880.00	0.09
24 7	601108	财通证券	4,200	46,704.00	0.09
24 8	002938	鹏鼎控股	1,100	46,673.00	0.09
24 9	600563	法拉电子	200	46,480.00	0.09
25 0	000301	东方盛虹	2,400	46,416.00	0.09
25 1	601865	福莱特	800	46,352.00	0.09
25 2	300763	锦浪科技	200	46,310.00	0.09
25 3	600183	生益科技	1,965	46,275.75	0.09
25 4	601636	旗滨集团	2,700	46,170.00	0.09
25 5	600918	中泰证券	4,600	45,862.00	0.09
25 6	002252	上海莱士	6,700	45,694.00	0.09
25 7	300474	景嘉微	300	45,660.00	0.09
25 8	601111	中国国航	5,000	45,650.00	0.09

25 9	600392	盛和资源	2,310	45,322.20	0.09
26 0	600109	国金证券	4,000	45,320.00	0.09
26 1	601618	中国中冶	11,800	45,194.00	0.09
26 2	603456	九洲药业	800	45,008.00	0.09
26 3	300363	博腾股份	500	44,725.00	0.09
26 4	300999	金龙鱼	700	44,051.00	0.09
26 5	300058	蓝色光标	4,100	43,993.00	0.09
26 6	688561	奇安信	500	43,960.00	0.09
26 7	601155	新城控股	1,500	43,695.00	0.09
26 8	601168	西部矿业	3,200	43,552.00	0.09
26 9	600418	江淮汽车	2,500	43,500.00	0.09
27 0	601838	成都银行	3,600	43,200.00	0.08
27 1	603160	汇顶科技	400	43,108.00	0.08
27 2	603613	国联股份	400	43,000.00	0.08
27 3	002916	深南电路	352	42,880.64	0.08
27 4	300529	健帆生物	800	42,640.00	0.08
27	603589	口子窖	600	42,522.00	0.08

5					
27 6	000630	铜陵有色	12,200	42,456.00	0.08
27 7	300699	光威复材	500	42,240.00	0.08
27 8	603444	吉比特	100	42,185.00	0.08
27 9	002138	顺络电子	1,100	41,998.00	0.08
28 0	603605	珀莱雅	200	41,662.00	0.08
28 1	000066	中国长城	2,937	41,587.92	0.08
28 2	600516	方大炭素	3,833	41,473.06	0.08
28 3	603833	欧派家居	280	41,300.00	0.08
28 4	603893	瑞芯微	300	41,070.00	0.08
28 5	600332	白云山	1,200	41,040.00	0.08
28 6	603517	绝味食品	600	40,998.00	0.08
28 7	002797	第一创业	5,600	40,992.00	0.08
28 8	601799	星宇股份	200	40,850.00	0.08
28 9	600875	东方电气	1,900	40,698.00	0.08
29 0	002409	雅克科技	500	40,585.00	0.08
29 1	300136	信维通信	1,600	40,512.00	0.08

29 2	601966	玲珑轮胎	1,100	40,205.00	0.08
29 3	300223	北京君正	300	40,200.00	0.08
29 4	002120	韵达股份	1,964	40,183.44	0.08
29 5	600038	中直股份	500	40,150.00	0.08
29 6	601077	渝农商行	10,300	39,655.00	0.08
29 7	002624	完美世界	1,950	39,604.50	0.08
29 8	603260	合盛硅业	300	39,591.00	0.08
29 9	000998	隆平高科	1,700	39,542.00	0.08
30 0	600489	中金黄金	4,800	39,504.00	0.08
30 1	600486	扬农化工	300	39,360.00	0.08
30 2	601689	拓普集团	740	39,220.00	0.08
30 3	000728	国元证券	5,040	38,808.00	0.08
30 4	603899	晨光文具	600	38,706.00	0.08
30 5	000703	恒逸石化	3,638	38,635.56	0.08
30 6	600233	圆通速递	2,300	38,364.00	0.08
30 7	002212	天融信	2,000	38,340.00	0.08
30	300308	中际旭创	900	38,250.00	0.08

8					
30 9	603290	斯达半导	100	38,100.00	0.07
31 0	600362	江西铜业	1,700	37,961.00	0.07
31 1	300146	汤臣倍健	1,400	37,744.00	0.07
31 2	600143	金发科技	3,000	37,740.00	0.07
31 3	601607	上海医药	1,890	37,554.30	0.07
31 4	002080	中材科技	1,100	37,422.00	0.07
31 5	002414	高德红外	1,543	37,356.03	0.07
31 6	000519	中兵红箭	1,400	37,338.00	0.07
31 7	300418	昆仑万维	1,600	37,040.00	0.07
31 8	300144	宋城演艺	2,580	36,945.60	0.07
31 9	688065	凯赛生物	200	36,856.00	0.07
32 0	601990	南京证券	3,700	36,667.00	0.07
32 1	002791	坚朗五金	200	36,318.00	0.07
32 2	002673	西部证券	4,500	36,315.00	0.07
32 3	600079	人福医药	1,602	36,077.04	0.07
32 4	600733	北汽蓝谷	3,600	36,072.00	0.07

32 5	002353	杰瑞股份	900	36,000.00	0.07
32 6	002223	鱼跃医疗	950	35,910.00	0.07
32 7	002568	百润股份	600	35,898.00	0.07
32 8	603267	鸿远电子	200	35,888.00	0.07
32 9	600845	宝信软件	589	35,828.87	0.07
33 0	002044	美年健康	4,560	35,796.00	0.07
33 1	000636	风华高科	1,200	35,760.00	0.07
33 2	000039	中集集团	2,080	35,692.80	0.07
33 3	600061	国投资本	4,316	35,477.52	0.07
33 4	600482	中国动力	1,800	35,460.00	0.07
33 5	600705	中航产融	8,900	35,333.00	0.07
33 6	600188	兖矿能源	1,500	35,295.00	0.07
33 7	000932	华菱钢铁	6,880	35,156.80	0.07
33 8	600699	均胜电子	1,600	35,152.00	0.07
33 9	600739	辽宁成大	1,800	35,136.00	0.07
34 0	603077	和邦生物	10,300	35,123.00	0.07
34	600529	山东药玻	800	35,120.00	0.07

1					
34 1	300676	华大基因	400	35,120.00	0.07
34 3	000739	普洛药业	1,000	35,090.00	0.07
34 4	000547	航天发展	2,097	35,019.90	0.07
34 5	300296	利亚德	3,400	34,850.00	0.07
34 6	000708	中信特钢	1,700	34,816.00	0.07
34 7	300677	英科医疗	600	34,704.00	0.07
34 8	603127	昭衍新药	300	34,629.00	0.07
34 9	000807	云铝股份	3,100	34,627.00	0.07
35 0	002600	领益智造	4,700	34,592.00	0.07
35 1	300724	捷佳伟创	300	34,290.00	0.07
35 2	601878	浙商证券	2,600	34,268.00	0.07
35 3	002439	启明星辰	1,200	34,236.00	0.07
35 4	600872	中炬高新	900	34,173.00	0.07
35 5	603939	益丰药房	620	34,168.20	0.07
35 6	601021	春秋航空	600	34,080.00	0.07
35 7	002507	涪陵榨菜	900	34,020.00	0.07

358	002465	海格通信	3,100	33,852.00	0.07
359	603338	浙江鼎力	420	33,709.20	0.07
360	688126	沪硅产业	1,301	33,591.82	0.07
361	002444	巨星科技	1,100	33,561.00	0.07
362	601728	中国电信	7,700	33,341.00	0.07
363	000738	航发控制	1,100	33,308.00	0.07
364	002030	达安基因	1,658	33,259.48	0.07
365	000960	锡业股份	1,700	33,201.00	0.07
366	600988	赤峰黄金	2,200	32,780.00	0.06
367	600732	爱旭股份	1,400	32,704.00	0.06
368	601016	节能风电	5,000	32,550.00	0.06
369	002985	北摩高科	270	32,524.20	0.06
370	600521	华海药业	1,500	32,490.00	0.06
371	600549	厦门钨业	1,430	32,360.90	0.06
372	300618	寒锐钴业	400	32,072.00	0.06
373	600637	东方明珠	3,390	32,035.50	0.06
37	300558	贝达药业	400	31,932.00	0.06

4					
37 5	688208	道通科技	401	31,839.40	0.06
37 6	600018	上港集团	5,800	31,784.00	0.06
37 7	600177	雅戈尔	4,600	31,694.00	0.06
37 8	600161	天坛生物	1,093	31,653.28	0.06
37 9	002273	水晶光电	1,818	31,615.02	0.06
38 0	601198	东兴证券	2,700	31,401.00	0.06
38 1	688002	睿创微纳	396	31,113.72	0.06
38 2	002078	太阳纸业	2,700	31,023.00	0.06
38 3	688521	芯原股份	400	30,944.00	0.06
38 4	601696	中银证券	2,300	30,935.00	0.06
38 5	600704	物产中大	5,200	30,784.00	0.06
38 6	300866	安克创新	300	30,750.00	0.06
38 7	002557	洽洽食品	500	30,680.00	0.06
38 8	601128	常熟银行	4,600	30,406.00	0.06
38 9	600642	申能股份	4,100	30,217.00	0.06
39 0	600201	生物股份	1,847	30,198.45	0.06

39 1	300383	光环新网	2,000	29,680.00	0.06
39 2	600879	航天电子	3,600	29,664.00	0.06
39 3	600497	驰宏锌锗	5,900	29,441.00	0.06
39 4	002739	万达电影	1,900	29,412.00	0.06
39 5	601216	君正集团	5,600	29,288.00	0.06
39 6	601162	天风证券	7,230	29,281.50	0.06
39 7	002156	通富微电	1,500	29,145.00	0.06
39 8	600372	中航电子	1,300	29,107.00	0.06
39 9	600369	西南证券	5,500	29,095.00	0.06
40 0	600160	巨化股份	2,250	29,047.50	0.06
40 1	002299	圣农发展	1,200	29,004.00	0.06
40 2	000830	鲁西化工	1,900	28,994.00	0.06
40 3	600039	四川路桥	2,400	28,896.00	0.06
40 4	600027	华电国际	5,400	28,890.00	0.06
40 5	300357	我武生物	500	28,650.00	0.06
40 6	002092	中泰化学	3,000	28,620.00	0.06
40	300115	长盈精密	1,440	28,569.60	0.06

7					
40 8	000623	吉林敖东	1,543	28,499.21	0.06
40 9	000983	山西焦煤	3,370	27,869.90	0.05
41 0	603198	迎驾贡酒	400	27,780.00	0.05
41 1	002508	老板电器	770	27,735.40	0.05
41 2	601997	贵阳银行	4,260	27,732.60	0.05
41 3	000629	攀钢钒钛	7,100	27,619.00	0.05
41 4	002131	利欧股份	11,200	27,552.00	0.05
41 5	600606	绿地控股	6,340	27,515.60	0.05
41 6	300017	网宿科技	4,100	27,429.00	0.05
41 7	600580	卧龙电驱	1,499	27,416.71	0.05
41 8	600316	洪都航空	700	27,342.00	0.05
41 9	002249	大洋电机	3,100	27,249.00	0.05
42 0	600118	中国卫星	1,000	27,150.00	0.05
42 1	002373	千方科技	1,800	26,910.00	0.05
42 2	002936	郑州银行	8,503	26,869.48	0.05
42 3	300070	碧水源	3,732	26,833.08	0.05

42 4	600655	豫园股份	2,600	26,780.00	0.05
42 5	000825	太钢不锈	3,800	26,752.00	0.05
42 6	600170	上海建工	7,400	26,640.00	0.05
42 7	000513	丽珠集团	661	26,578.81	0.05
42 8	002422	科伦药业	1,400	26,502.00	0.05
42 9	603218	日月股份	800	26,360.00	0.05
43 0	600867	通化东宝	2,400	26,304.00	0.05
43 1	002372	伟星新材	1,080	26,265.60	0.05
43 2	002603	以岭药业	1,340	26,264.00	0.05
43 3	000887	中鼎股份	1,200	26,172.00	0.05
43 4	600166	福田汽车	7,600	26,144.00	0.05
43 5	000750	国海证券	6,360	26,139.60	0.05
43 6	000400	许继电气	1,000	26,100.00	0.05
43 7	300168	万达信息	2,000	26,040.00	0.05
43 7	000050	深天马 A	2,000	26,040.00	0.05
43 9	002506	协鑫集成	6,800	25,840.00	0.05
44	002191	劲嘉股份	1,700	25,721.00	0.05

0					
44 1	600803	新奥股份	1,400	25,704.00	0.05
44 2	002266	浙富控股	3,600	25,632.00	0.05
44 3	002926	华西证券	2,600	25,610.00	0.05
44 4	002024	苏宁易购	6,200	25,544.00	0.05
44 5	600271	航天信息	1,900	25,441.00	0.05
44 6	000027	深圳能源	3,140	25,434.00	0.05
44 7	600153	建发股份	2,800	25,396.00	0.05
44 8	600909	华安证券	4,690	25,372.90	0.05
44 9	000997	新大陆	1,400	25,368.00	0.05
45 0	000021	深科技	1,600	25,344.00	0.05
45 1	002002	鸿达兴业	4,156	25,185.36	0.05
45 2	688396	华润微	389	25,129.40	0.05
45 3	002157	正邦科技	2,600	25,116.00	0.05
45 4	300009	安科生物	1,916	25,080.44	0.05
45 5	600236	桂冠电力	3,900	25,038.00	0.05
45 6	002152	广电运通	2,100	24,990.00	0.05

45 7	600536	中国软件	500	24,965.00	0.05
45 8	002065	东华软件	3,200	24,960.00	0.05
45 9	002408	齐翔腾达	2,376	24,948.00	0.05
46 0	600008	首创环保	7,300	24,893.00	0.05
46 1	300001	特锐德	1,000	24,870.00	0.05
46 2	002203	海亮股份	2,000	24,860.00	0.05
46 3	300212	易华录	700	24,745.00	0.05
46 4	603156	养元饮品	864	24,546.24	0.05
46 5	002056	横店东磁	1,300	24,531.00	0.05
46 6	601995	中金公司	500	24,515.00	0.05
46 7	300251	光线传媒	1,900	24,415.00	0.05
46 8	000975	银泰黄金	2,780	24,408.40	0.05
46 9	002607	中公教育	3,100	24,366.00	0.05
47 0	601933	永辉超市	6,000	24,300.00	0.05
47 0	600859	王府井	900	24,300.00	0.05
47 2	600315	上海家化	600	24,246.00	0.05
47	600066	宇通客车	2,200	24,244.00	0.05

3					
47 4	002064	华峰化学	2,300	24,012.00	0.05
47 5	000999	华润三九	700	23,968.00	0.05
47 6	002500	山西证券	3,630	23,958.00	0.05
47 7	002221	东华能源	1,900	23,921.00	0.05
47 8	600535	天士力	1,500	23,775.00	0.05
47 9	000656	金科股份	5,300	23,744.00	0.05
48 0	600348	华阳股份	2,000	23,700.00	0.05
48 1	601998	中信银行	5,100	23,562.00	0.05
48 2	600998	九州通	1,600	23,552.00	0.05
48 3	600258	首旅酒店	900	23,517.00	0.05
48 4	601881	中国银河	2,100	23,499.00	0.05
48 5	300026	红日药业	3,000	23,490.00	0.05
48 6	300024	机器人	2,080	23,233.60	0.05
48 7	601005	重庆钢铁	11,100	23,199.00	0.05
48 8	600848	上海临港	1,556	23,137.72	0.05
48 9	603707	健友股份	550	23,100.00	0.05

49 0	600171	上海贝岭	900	23,094.00	0.05
49 1	300244	迪安诊断	680	22,827.60	0.04
49 2	002127	南极电商	3,300	22,770.00	0.04
49 3	000012	南玻 A	2,290	22,739.70	0.04
49 4	000878	云南铜业	1,700	22,729.00	0.04
49 5	002745	木林森	1,500	22,695.00	0.04
49 6	601699	潞安环能	2,000	22,620.00	0.04
49 7	000970	中科三环	1,400	22,470.00	0.04
49 8	002153	石基信息	780	22,417.20	0.04
49 9	300315	掌趣科技	4,600	22,356.00	0.04
50 0	300630	普利制药	406	22,346.24	0.04
50 1	600415	小商品城	4,600	22,310.00	0.04
50 2	600673	东阳光	2,500	22,200.00	0.04
50 2	002572	索菲亚	1,000	22,200.00	0.04
50 4	002195	二三四五	9,479	22,180.86	0.04
50 5	601872	招商轮船	5,400	22,140.00	0.04
50	601319	中国人保	4,700	22,090.00	0.04

6					
50 7	002511	中顺洁柔	1,300	21,723.00	0.04
50 8	000537	广宇发展	900	21,690.00	0.04
50 9	603712	七一二	500	21,650.00	0.04
51 0	600801	华新水泥	1,120	21,616.00	0.04
51 1	002250	联化科技	1,200	21,564.00	0.04
51 2	002831	裕同科技	640	21,561.60	0.04
51 3	300182	捷成股份	3,400	21,522.00	0.04
51 4	688006	杭可科技	200	21,516.00	0.04
51 5	603658	安图生物	390	21,473.40	0.04
51 6	688009	中国通号	4,299	21,409.02	0.04
51 7	000690	宝新能源	3,600	21,312.00	0.04
51 8	603568	伟明环保	583	21,296.99	0.04
51 9	600863	内蒙华电	5,400	21,276.00	0.04
52 0	002019	亿帆医药	1,201	21,161.62	0.04
52 1	600208	新湖中宝	7,100	21,158.00	0.04
52 2	000060	中金岭南	4,300	21,113.00	0.04

52 3	603087	甘李药业	300	21,102.00	0.04
52 4	002683	宏大爆破	700	21,084.00	0.04
52 5	601866	中远海发	6,400	20,800.00	0.04
52 6	000930	中粮科技	1,912	20,783.44	0.04
52 7	600380	健康元	1,604	20,595.36	0.04
52 8	600970	中材国际	1,800	20,574.00	0.04
52 9	300482	万孚生物	520	20,477.60	0.04
53 0	601778	晶科科技	2,400	20,472.00	0.04
53 1	300463	迈克生物	700	20,433.00	0.04
53 2	600517	国网英大	2,800	20,412.00	0.04
53 3	600764	中国海防	500	20,330.00	0.04
53 4	002505	鹏都农牧	5,300	20,246.00	0.04
53 5	603233	大参林	480	20,212.80	0.04
53 6	000686	东北证券	2,300	20,194.00	0.04
53 7	600839	四川长虹	6,100	20,191.00	0.04
53 8	600498	烽火通信	1,112	19,993.76	0.04
53	600155	华创阳安	2,000	19,920.00	0.04

9					
54 0	600025	华能水电	3,000	19,770.00	0.04
54 1	600390	五矿资本	3,700	19,684.00	0.04
54 2	600158	中体产业	1,300	19,656.00	0.04
54 3	002701	奥瑞金	2,800	19,600.00	0.04
54 4	601992	金隅集团	6,900	19,596.00	0.04
54 5	600895	张江高科	1,300	19,578.00	0.04
54 6	002382	蓝帆医疗	1,200	19,548.00	0.04
54 7	600500	中化国际	2,280	19,516.80	0.04
54 8	603858	步长制药	924	19,487.16	0.04
54 9	000729	燕京啤酒	2,300	19,481.00	0.04
55 0	002595	豪迈科技	700	19,432.00	0.04
55 1	002939	长城证券	1,500	19,425.00	0.04
55 2	600667	太极实业	2,400	19,392.00	0.04
55 3	002004	华邦健康	2,668	19,316.32	0.04
55 4	002128	电投能源	1,300	19,305.00	0.04
55 5	600728	佳都科技	2,300	19,159.00	0.04

55 6	000401	冀东水泥	1,600	19,136.00	0.04
55 7	002294	信立泰	700	19,124.00	0.04
55 8	300376	易事特	1,900	19,095.00	0.04
55 9	600718	东软集团	1,400	18,984.00	0.04
56 0	000598	兴蓉环境	3,000	18,960.00	0.04
56 1	002966	苏州银行	2,800	18,956.00	0.04
56 2	601236	红塔证券	1,590	18,952.80	0.04
56 3	600511	国药股份	600	18,918.00	0.04
56 4	601898	中煤能源	3,000	18,870.00	0.04
56 4	601179	中国西电	3,400	18,870.00	0.04
56 4	600282	南钢股份	5,100	18,870.00	0.04
56 7	002396	星网锐捷	800	18,856.00	0.04
56 8	600216	浙江医药	1,100	18,788.00	0.04
56 9	603883	老百姓	380	18,764.40	0.04
57 0	002532	天山铝业	2,300	18,745.00	0.04
57 1	002032	苏泊尔	300	18,672.00	0.04
57	603225	新凤鸣	1,256	18,651.60	0.04

2					
57 3	000540	中天金融	7,000	18,480.00	0.04
57 4	300072	三聚环保	2,329	18,468.97	0.04
57 5	002174	游族网络	1,200	18,288.00	0.04
57 6	600409	三友化工	2,100	18,270.00	0.04
57 7	002670	国盛金控	1,900	18,240.00	0.04
57 8	605499	东鹏饮料	100	18,184.00	0.04
57 9	600528	中铁工业	2,200	18,062.00	0.04
58 0	600755	厦门国贸	2,500	18,025.00	0.04
58 1	002430	杭氧股份	600	18,006.00	0.04
58 2	600297	广汇汽车	6,700	17,889.00	0.04
58 3	600985	淮北矿业	1,600	17,888.00	0.04
58 4	603638	艾迪精密	560	17,875.20	0.04
58 5	603866	桃李面包	628	17,835.20	0.04
58 6	300271	华宇软件	1,400	17,780.00	0.03
58 7	600567	山鹰国际	5,400	17,766.00	0.03
58 8	002958	青农商行	4,600	17,756.00	0.03

589	603885	吉祥航空	1,000	17,750.00	0.03
590	601231	环旭电子	1,100	17,666.00	0.03
591	688088	虹软科技	397	17,491.82	0.03
592	600060	海信视像	1,300	17,485.00	0.03
593	600131	国网信通	800	17,480.00	0.03
594	600598	北大荒	1,200	17,472.00	0.03
595	002010	传化智联	2,000	17,400.00	0.03
596	601717	郑煤机	1,500	17,385.00	0.03
597	002925	盈趣科技	510	17,355.30	0.03
598	600827	百联股份	1,300	17,329.00	0.03
599	000778	新兴铸管	4,000	17,320.00	0.03
600	002048	宁波华翔	800	17,304.00	0.03
601	000581	威孚高科	800	17,232.00	0.03
602	000709	河钢股份	7,000	17,220.00	0.03
603	002183	怡亚通	2,600	17,212.00	0.03
604	002368	太极股份	620	17,074.80	0.03
60	600566	济川药业	600	17,004.00	0.03

5					
60 6	600737	中粮糖业	1,800	16,920.00	0.03
60 7	002075	沙钢股份	2,900	16,907.00	0.03
60 8	600782	新钢股份	3,200	16,896.00	0.03
60 9	600325	华发股份	2,800	16,856.00	0.03
61 0	000883	湖北能源	3,200	16,768.00	0.03
61 1	601456	国联证券	1,200	16,764.00	0.03
61 2	603195	公牛集团	100	16,730.00	0.03
61 2	600967	内蒙一机	1,400	16,730.00	0.03
61 4	600507	方大特钢	2,140	16,692.00	0.03
61 5	600820	隧道股份	3,101	16,683.38	0.03
61 6	600021	上海电力	1,300	16,666.00	0.03
61 7	000987	越秀金控	1,900	16,530.00	0.03
61 8	603927	中科软	600	16,416.00	0.03
61 9	600707	彩虹股份	2,400	16,368.00	0.03
62 0	002281	光迅科技	700	16,303.00	0.03
62 1	600663	陆家嘴	1,500	16,290.00	0.03

62 2	600022	山东钢铁	9,100	16,289.00	0.03
62 3	601880	辽港股份	9,400	16,262.00	0.03
62 4	002434	万里扬	1,100	16,214.00	0.03
62 5	600435	北方导航	1,500	16,020.00	0.03
62 6	601106	中国一重	4,600	16,008.00	0.03
62 7	600597	光明乳业	1,100	15,972.00	0.03
62 8	002124	天邦股份	2,460	15,842.40	0.03
62 9	000990	诚志股份	1,000	15,820.00	0.03
63 0	600446	金证股份	1,100	15,752.00	0.03
63 1	600329	中新药业	500	15,705.00	0.03
63 2	002146	荣盛发展	3,600	15,660.00	0.03
63 3	601577	长沙银行	2,000	15,620.00	0.03
63 4	600572	康恩贝	3,100	15,500.00	0.03
63 5	000800	一汽解放	1,500	15,435.00	0.03
63 6	000877	天山股份	1,000	15,310.00	0.03
63 7	603650	彤程新材	300	15,096.00	0.03
63	601808	中海油服	1,000	15,000.00	0.03

8					
63 9	002690	美亚光电	400	14,984.00	0.03
64 0	300166	东方国信	1,380	14,904.00	0.03
64 1	000488	晨鸣纸业	2,054	14,870.96	0.03
64 2	002440	闰土股份	1,550	14,864.50	0.03
64 3	000898	鞍钢股份	3,960	14,850.00	0.03
64 4	002390	信邦制药	2,000	14,840.00	0.03
64 5	002233	塔牌集团	1,400	14,812.00	0.03
64 6	601118	海南橡胶	2,800	14,784.00	0.03
64 7	600259	广晟有色	300	14,772.00	0.03
64 8	600808	马钢股份	4,000	14,760.00	0.03
64 9	600811	东方集团	4,900	14,749.00	0.03
65 0	688363	华熙生物	94	14,598.20	0.03
65 1	002429	兆驰股份	3,000	14,580.00	0.03
65 2	002155	湖南黄金	1,400	14,504.00	0.03
65 3	001914	招商积余	700	14,182.00	0.03
65 4	600908	无锡银行	2,500	14,175.00	0.03

65 5	600398	海澜之家	2,200	14,102.00	0.03
65 6	600906	财达证券	1,100	14,036.00	0.03
65 7	000559	万向钱潮	2,200	14,014.00	0.03
65 8	688321	微芯生物	400	14,004.00	0.03
65 9	002110	三钢闽光	2,050	13,940.00	0.03
66 0	600037	歌华有线	1,600	13,888.00	0.03
66 1	600195	中牧股份	1,058	13,828.06	0.03
66 2	002085	万丰奥威	2,500	13,725.00	0.03
66 3	002416	爱施德	1,200	13,656.00	0.03
66 4	600026	中远海能	2,300	13,616.00	0.03
66 5	601200	上海环境	1,080	13,597.20	0.03
66 6	600373	中文传媒	1,100	13,596.00	0.03
66 7	600167	联美控股	1,490	13,424.90	0.03
66 8	601000	唐山港	4,878	13,414.50	0.03
66 9	002081	金螳螂	2,200	13,376.00	0.03
67 0	601991	大唐发电	4,100	13,284.00	0.03
67	000685	中山公用	1,500	13,275.00	0.03

1					
67 2	600064	南京高科	1,420	13,262.80	0.03
67 3	603228	景旺电子	384	13,259.52	0.03
67 4	000961	中南建设	3,200	13,248.00	0.03
67 5	000528	柳工	1,710	13,184.10	0.03
67 6	000158	常山北明	1,900	13,148.00	0.03
67 7	600546	山煤国际	1,600	13,136.00	0.03
67 8	300133	华策影视	1,940	13,133.80	0.03
67 9	601718	际华集团	4,400	13,112.00	0.03
68 0	002387	维信诺	1,400	12,992.00	0.03
68 1	603000	人民网	900	12,978.00	0.03
68 2	002038	双鹭药业	1,200	12,972.00	0.03
68 3	601611	中国核建	1,300	12,961.00	0.03
68 4	601608	中信重工	2,900	12,934.00	0.03
68 5	600120	浙江东方	2,919	12,901.98	0.03
68 6	000090	天健集团	2,170	12,737.90	0.03
68 7	000959	首钢股份	2,200	12,606.00	0.02

68 8	000758	中色股份	2,300	12,558.00	0.02
68 9	601333	广深铁路	5,600	12,544.00	0.02
69 0	002867	周大生	700	12,446.00	0.02
69 1	000089	深圳机场	1,700	12,444.00	0.02
69 2	000671	阳光城	4,100	12,382.00	0.02
69 3	002705	新宝股份	500	12,350.00	0.02
69 4	600582	天地科技	2,800	12,264.00	0.02
69 5	000415	渤海租赁	4,100	11,931.00	0.02
69 6	600376	首开股份	2,097	11,869.02	0.02
69 7	688289	圣湘生物	200	11,800.00	0.02
69 8	000718	苏宁环球	2,500	11,775.00	0.02
69 9	600062	华润双鹤	880	11,765.60	0.02
70 0	000967	盈峰环境	1,600	11,728.00	0.02
70 1	600126	杭钢股份	2,280	11,696.40	0.02
70 2	601598	中国外运	2,600	11,648.00	0.02
70 3	002242	九阳股份	500	11,600.00	0.02
70	601098	中南传媒	1,200	11,484.00	0.02

4					
70 5	601975	招商南油	5,700	11,457.00	0.02
70 6	600307	酒钢宏兴	5,200	11,440.00	0.02
70 7	000402	金融街	2,000	11,320.00	0.02
70 8	002458	益生股份	1,000	11,310.00	0.02
70 9	300257	开山股份	700	11,116.00	0.02
71 0	600556	天下秀	900	11,115.00	0.02
71 1	601958	金钼股份	1,600	10,960.00	0.02
71 2	600959	江苏有线	3,324	10,935.96	0.02
71 3	003022	联泓新科	300	10,932.00	0.02
71 4	600643	爱建集团	1,600	10,816.00	0.02
71 5	603317	天味食品	402	10,777.62	0.02
71 6	003035	南网能源	1,300	10,777.00	0.02
71 7	000563	陕国投 A	3,330	10,755.90	0.02
71 8	001965	招商公路	1,400	10,738.00	0.02
71 9	600056	中国医药	900	10,629.00	0.02
72 0	601928	凤凰传媒	1,300	10,517.00	0.02

72 1	601860	紫金银行	3,100	10,385.00	0.02
72 2	002399	海普瑞	600	10,260.00	0.02
72 3	600901	江苏租赁	2,000	10,180.00	0.02
72 4	600266	城建发展	2,252	10,134.00	0.02
72 5	002815	崇达技术	600	10,110.00	0.02
72 6	601698	中国卫通	700	10,073.00	0.02
72 7	002563	森马服饰	1,300	10,049.00	0.02
72 8	600717	天津港	2,390	10,014.10	0.02
72 9	600968	海油发展	3,400	9,962.00	0.02
73 0	000937	冀中能源	1,800	9,918.00	0.02
73 1	002244	滨江集团	2,100	9,786.00	0.02
73 2	300741	华宝股份	200	9,570.00	0.02
73 3	000717	韶钢松山	2,000	9,500.00	0.02
73 4	000062	深圳华强	550	9,476.50	0.02
73 5	600928	西安银行	2,200	9,460.00	0.02
73 6	600787	中储股份	1,500	9,360.00	0.02
73	600776	东方通信	800	9,208.00	0.02

7					
73 8	002424	贵州百灵	1,200	9,120.00	0.02
73 9	600095	湘财股份	900	9,108.00	0.02
74 0	002468	申通快递	1,001	9,099.09	0.02
74 1	002423	中粮资本	1,100	8,910.00	0.02
74 2	600006	东风汽车	1,300	8,853.00	0.02
74 3	601139	深圳燃气	1,000	8,830.00	0.02
74 4	600649	城投控股	2,100	8,631.00	0.02
74 5	600339	中油工程	2,800	8,624.00	0.02
74 5	600299	安迪苏	700	8,624.00	0.02
74 7	601969	海南矿业	700	8,407.00	0.02
74 8	300888	稳健医疗	100	8,245.00	0.02
74 9	002375	亚厦股份	1,100	8,239.00	0.02
75 0	600623	华谊集团	900	8,190.00	0.02
75 1	002653	海思科	400	8,160.00	0.02
75 2	300869	康泰医学	200	8,110.00	0.02
75 3	603786	科博达	100	8,030.00	0.02

75 4	600835	上海机电	500	7,960.00	0.02
75 5	600648	外高桥	600	7,938.00	0.02
75 6	000031	大悦城	2,100	7,833.00	0.02
75 7	600729	重庆百货	300	7,806.00	0.02
75 8	600639	浦东金桥	600	7,662.00	0.02
75 9	000156	华数传媒	900	7,614.00	0.01
76 0	000028	国药一致	200	7,396.00	0.01
76 1	600871	石化油服	3,400	7,276.00	0.01
76 2	601228	广州港	2,100	6,993.00	0.01
76 3	600377	宁沪高速	800	6,896.00	0.01
76 4	601298	青岛港	1,200	6,828.00	0.01
76 5	001872	招商港口	400	6,780.00	0.01
76 6	603708	家家悦	400	6,656.00	0.01
76 7	601828	美凯龙	750	6,607.50	0.01
76 8	000046	泛海控股	3,500	6,580.00	0.01
76 9	601156	东航物流	300	6,564.00	0.01
77	601869	长飞光纤	200	6,548.00	0.01

0					
77 1	002948	青岛银行	1,400	6,482.00	0.01
77 2	002302	西部建设	800	6,424.00	0.01
77 3	000869	张裕A	200	6,372.00	0.01
77 4	600823	世茂股份	1,900	6,232.00	0.01
77 5	001203	大中矿业	400	6,032.00	0.01
77 6	603379	三美股份	260	5,922.80	0.01
77 7	000553	安道麦A	700	5,908.00	0.01
77 8	601568	北元集团	700	5,691.00	0.01
77 9	603515	欧普照明	270	5,605.20	0.01
78 0	002945	华林证券	400	5,464.00	0.01
78 1	603355	莱克电气	180	5,277.60	0.01
78 2	600657	信达地产	1,400	5,222.00	0.01
78 3	600350	山东高速	1,000	5,160.00	0.01
78 4	600466	蓝光发展	2,520	5,140.80	0.01
78 5	603056	德邦股份	500	5,115.00	0.01
78 6	002901	大博医疗	100	5,062.00	0.01

78 7	002946	新乳业	300	4,782.00	0.01
78 8	601665	齐鲁银行	800	4,464.00	0.01
78 9	603868	飞科电器	100	4,342.00	0.01
79 0	603719	良品铺子	100	4,247.00	0.01
79 1	600917	重庆燃气	500	4,195.00	0.01
79 2	601003	柳钢股份	800	4,176.00	0.01
79 3	600903	贵州燃气	400	3,872.00	0.01
79 4	601187	厦门银行	500	3,450.00	0.01
79 5	600956	新天绿能	200	3,442.00	0.01
79 6	603983	丸美股份	100	3,187.00	0.01

8.3.2 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	001296	长江材料	242	14,345.76	0.03
2	001234	泰慕士	259	4,281.27	0.01

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	300750	宁德时代	1,746,212.00	3.10
2	600519	贵州茅台	1,482,316.00	2.63
3	688169	石头科技	360,276.00	0.64
4	688111	金山办公	318,296.66	0.57
5	601012	隆基股份	256,232.00	0.45
6	300760	迈瑞医疗	249,659.00	0.44
7	002466	天齐锂业	229,289.00	0.41
8	601888	中国中免	218,354.00	0.39
9	000858	五粮液	217,515.00	0.39
10	603501	韦尔股份	206,422.00	0.37
11	600905	三峡能源	188,884.00	0.34
12	688981	中芯国际	184,809.65	0.33
13	601816	京沪高铁	177,851.00	0.32
14	601318	中国平安	170,649.00	0.30
15	002415	海康威视	169,686.00	0.30
16	300450	先导智能	165,368.00	0.29
17	601728	中国电信	161,646.00	0.29
18	603259	药明康德	154,450.00	0.27
19	300782	卓胜微	152,050.00	0.27
20	600036	招商银行	150,619.00	0.27

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。

8.4.2 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	600519	贵州茅台	1,701,102.00	3.02
2	601318	中国平安	519,897.00	0.92
3	000858	五粮液	509,690.00	0.90
4	600036	招商银行	459,131.00	0.82

5	601888	中国中免	353,975.00	0.63
6	601012	隆基股份	346,282.00	0.61
7	688169	石头科技	311,620.00	0.55
8	000333	美的集团	307,232.00	0.55
9	600887	伊利股份	256,761.00	0.46
10	002594	比亚迪	242,145.00	0.43
11	600276	恒瑞医药	223,768.80	0.40
12	600703	三安光电	218,400.00	0.39
13	601166	兴业银行	210,429.00	0.37
14	000568	泸州老窖	206,420.00	0.37
15	300059	东方财富	200,277.00	0.36
16	600089	特变电工	189,197.76	0.34
17	300750	宁德时代	187,120.00	0.33
18	000651	格力电器	176,330.00	0.31
19	002460	赣锋锂业	174,327.00	0.31
20	002415	海康威视	171,410.00	0.30

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。

8.4.3 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	21,636,285.97
卖出股票收入（成交）总额	27,962,050.53

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。

8.5 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)	60,296.10	0.12
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	60,296.10	0.12

8.6 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	113052	兴业转债	580	58,000.00	0.11
2	113633	科沃转债	10	1,296.10	0.00
3	113634	珀莱转债	10	1,000.00	0.00

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.11 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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；【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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	13,339.09
2	应收证券清算款	54,326.58
3	应收股利	-
4	应收利息	652.11
5	应收申购款	86,397.05
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	154,714.83

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 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。

8.12.5.2 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	001234	泰慕士	4,281.27	0.01	新股未上市

8.12.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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	3,68 5	3,770.52	-	-	13,894,373.82	100.0 0%
天弘 中证8 00C	3,19 4	7,239.51	12,890,750.89	55.7 5%	10,232,248.10	44.25%
合计	6,87 9	5,381.21	12,890,750.89	34.8 2%	24,126,621.92	65.18%

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）。

9.2 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800 A	92,289.67	0.66%
	天弘中证800 C	2,086.32	0.01%
	合计	94,375.99	0.25%

9.3 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

9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

注：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。

§ 10 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	17,091,316.79	24,606,899.76
本报告期基金总申购份额	15,162,570.91	33,272,210.46
减：本报告期基金总赎回份额	18,359,513.88	34,756,111.23
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	13,894,373.82	23,122,998.99

注：总申购份额含转换转入份额；总赎回份额含转换转出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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，韩歆毅先生任职公司董事长，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高级管理人员变更公告》。

本报告期内，胡晓明先生不再担任公司董事长，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董事长离任及总经理代行董事长职务的公告》。

本报告期内，朱海扬先生任职公司副总经理，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高级管理人员变更的公告》。

本报告期内，天弘基金管理有限公司股东会2021年第2次会议、第4次会议审议通过，选举韩歆毅先生、周志峰先生、祖国明先生、张杰先生、孟路先生新任公司第七届董事会董事。胡晓明先生、卢信群先生、屠剑威先生、黄浩先生、魏新顺先生不再担任公司董事。

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。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

根据《存托凭证发行与交易管理办法（试行）》等法律法规及基金合同等法律文件的规定，本基金投资策略发生变更，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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金应向普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）支付服务费 50,000.00 元。截至本报告期末，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）已为本基金提供审计服务6年6个月。

11.6 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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	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	佣金	占当期佣金总量的	

	元数量		额的比例		比例	
东方财富证券	2	20,912,726.11	43.14%	9,019.46	55.90%	-
东兴证券	1	3,188,110.25	6.58%	1,316.06	8.16%	-
方正证券	1	934,008.00	1.93%	402.94	2.50%	-
广发证券	3	23,438,780.77	48.35%	5,396.49	33.45%	-

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：无。

4、本基金报告期内停止租用交易单元：方正证券深圳交易单元、广发证券上海交易单元。

11.7.2 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	37,862.42	8.85%	-	-	-	-	-	-
东兴证券	66,278.40	15.49%	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	323,853.32	75.67%	-	-	-	-	-	-

11.8 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	中国证券报、中国证监会指定媒介	2021-01-01
2	天弘基金管理有限公司关于增加华泰证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投、转换业务以及参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、中国证监会指定媒介	2021-01-08
3	天弘基金管理有限公司关于增加交通银行股份有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投、转换业务以及参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、中国证监会指定媒介	2021-01-13
4	天弘中证800指数型发起式证券投资基金2020年第四季度报告	中国证券报、中国证监会指定媒介	2021-01-22
5	天弘基金管理有限公司关于增加中信银行股份有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投、转换业务的公告	中国证券报、中国证监会指定媒介	2021-02-01
6	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	中国证券报、中国证监会指定媒介	2021-02-24
7	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	中国证券报、中国证监会指定媒介	2021-03-04
8	天弘基金管理有限公司关于增加湘财证券有限责任公司为旗下部分基金销售机构并	中国证券报、中国证监会指定媒介	2021-03-12

	开通申购、赎回、定投、转换业务以及参加其费率优惠活动的公告		
9	天弘基金管理有限公司关于增加中国民生银行股份有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投、转换业务的公告	中国证券报、中国证监会指定媒介	2021-03-17
10	天弘中证800指数型发起式证券投资基金2020年年度报告	中国证券报、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	中国证券报、中国证监会指定媒介	2021-03-31
12	天弘中证800指数型发起式证券投资基金基金合同	中国证券报、中国证监会指定媒介	2021-03-31
13	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	2021-03-31
14	天弘中证800指数型发起式证券投资基金托管协议	中国证券报、中国证监会指定媒介	2021-03-31
15	天弘中证800指数型发起式证券投资基金产品资料概要（更新）	中国证券报、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	中国证券报、中国证监会指定媒介	2021-04-07
17	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网上直销系统的单笔最低申购金额及单笔最低赎回份额的公告	中国证券报、中国证监会指定媒介	2021-04-12

18	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	2021-04-14
19	天弘中证800指数型发起式证券投资基金2021年第一季度报告	中国证券报、中国证监会指定媒介	2021-04-22
20	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	中国证券报、中国证监会指定媒介	2021-06-02
21	天弘基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、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增加爱建证券有限责任公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投、转换业务以及参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、中国证监会指定媒介	2021-06-11
23	天弘基金管理有限公司关于增加华林证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投、转换业务以及参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、中国证监会指定媒介	2021-07-05
24	天弘基金管理有限公司关于增加国盛证券有限责任公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投、转换业务以及参加其费率优惠活动的公告	中国证券报、中国证监会指定媒介	2021-07-15
25	天弘基金管理有限公司关于增加国金证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投、转换业务以及参加其费率优惠	中国证券报、中国证监会指定媒介	2021-07-19

	活动的公告		
26	天弘中证800指数型发起式证券投资基金2021年第二季度报告	中国证券报、中国证监会指定媒介	2021-07-21
27	天弘基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、中国证监会指定媒介	2021-08-04
28	天弘基金管理有限公司关于增加交通银行股份有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投业务的公告	中国证券报、中国证监会指定媒介	2021-08-09
29	天弘中证800指数型发起式证券投资基金产品资料概要（更新）	中国证券报、中国证监会指定媒介	2021-08-11
30	天弘基金管理有限公司住所变更公告	中国证券报、中国证监会指定媒介	2021-08-18
31	天弘中证800指数型发起式证券投资基金2021年中期报告	中国证券报、中国证监会指定媒介	2021-08-31
32	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	2021-10-22
33	天弘中证800指数型发起式证券投资基金2021年第三季度报告	中国证券报、中国证监会指定媒介	2021-10-27
34	天弘基金管理有限公司关于董事变更的公告	中国证券报、中国证监会指定媒介	2021-11-17
35	天弘基金管理有限公司关于在网上直销系统开通邮储银行快捷支付业务并实施相关费率优惠的公告	中国证券报、中国证监会指定媒介	2021-11-25

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	20210101-20211231	12,890,750.89	-	-	12,890,750.89	34.82%
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。

12.2 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）》等法律法规及基金合同等法律文件的规定，本基金已于2021年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。

§ 13 备查文件目录

13.1 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

13.2 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

13.3 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
二〇二二年三月三十一日