天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金

2019 年年度报告

2019 年 12 月 31 日

基金管理人:天弘基金管理有限公司

基金托管人:国泰君安证券股份有限公司

送出日期:2020 年 04 月 24 日

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

§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。

基金托管人国泰君安证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2020年04月22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2019年09月12日起至2019年12月31日止。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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 7
3.3 过去三年基金的利润分配情况 9
§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遵规守信情况的说明 11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 12
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 13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 16
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 16
§5 托管人报告 16
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 16
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 16
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 16
§6 审计报告 16
6.1 审计报告基本信息 17
6.2 审计报告的基本内容 17
§7 年度财务报表 19
7.1 资产负债表 19
7.2 利润表 21
7.3 所有者权益（基金净值）变动表 22
7.4 报表附注 23
§8 投资组合报告 46
8.1 期末基金资产组合情况 46
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合 47
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 49
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 53
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 55
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 55
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 55
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 55
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 55
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 55

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 55
8.12 投资组合报告附注 55
§9 基金份额持有人信息 56
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 56
9.2 期末上市基金前十名持有人 57
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 57
9.4 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 57
§10 开放式基金份额变动 57
§11 重大事件揭示 58
11.1 基金份额持有人大会决议 58
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 58
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 58
11.4 基金投资策略的改变 58
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 58
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 58
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 58
11.8 其他重大事件 59
§12 影响投资者决策的其他重要信息 62
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 62
12.2 影响投资者决策的其他重要信息 63
§13 备查文件目录 63
13.1 备查文件目录 63
13.2 存放地点 63
13.3 查阅方式 63

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	创业板TH
场内简称	创业板TH
基金主代码	159977
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019年09月12日
基金管理人	天弘基金管理有限公司
基金托管人	国泰君安证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	1,462,936,410.00份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2019-09-27

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。
业绩比较基准	创业板指数收益率
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

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

	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	国泰君安证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	童建林	王健
	联系电话	022-83310208	021-38676252
	电子邮箱	service@thfund.com.cn	wangj222@gtjas.com
客户服务电话		95046	021-38917599-5
传真		022-83865569	021-38677819
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	中国（上海）自由贸易试验区商城路618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	上海市静安区新闸路669号博华广场19楼
邮政编码		300203	200041
法定代表人		胡晓明	贺青

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）	中国上海市湖滨路202号普华永道中心11楼

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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、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	本期2019年09月12日（基金合同生效日）- 2019年12月31日
本期已实现收益	44,585,893.83
本期利润	248,375,248.00
加权平均基金份额本期利润	0.1590
本期加权平均净值利润率	9.49%
本期基金份额净值增长率	5.96%
3.1.2 期末数据和指标	2019年末
期末可供分配利润	42,989,455.20
期末可供分配基金份额利润	0.0294
期末基金资产净值	2,628,469,685.95
期末基金份额净值	1.7967
3.1.3 累计期末指标	2019年末
基金份额累计净值增长率	5.96%

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。

4、本基金《基金合同》2019年09月12日起生效，报告期为2019年09月12日至2019年12月31日。

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	份额净值	业绩比较	业绩比较	①-③	②-④

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

	增长率①	增长率标准差②	基准收益率③	基准收益率标准差④		
过去三个月	10.35%	1.08%	10.48%	1.09%	-0.13%	-0.01%
自基金合同生效日起至今	5.96%	1.10%	5.55%	1.15%	0.41%	-0.05%

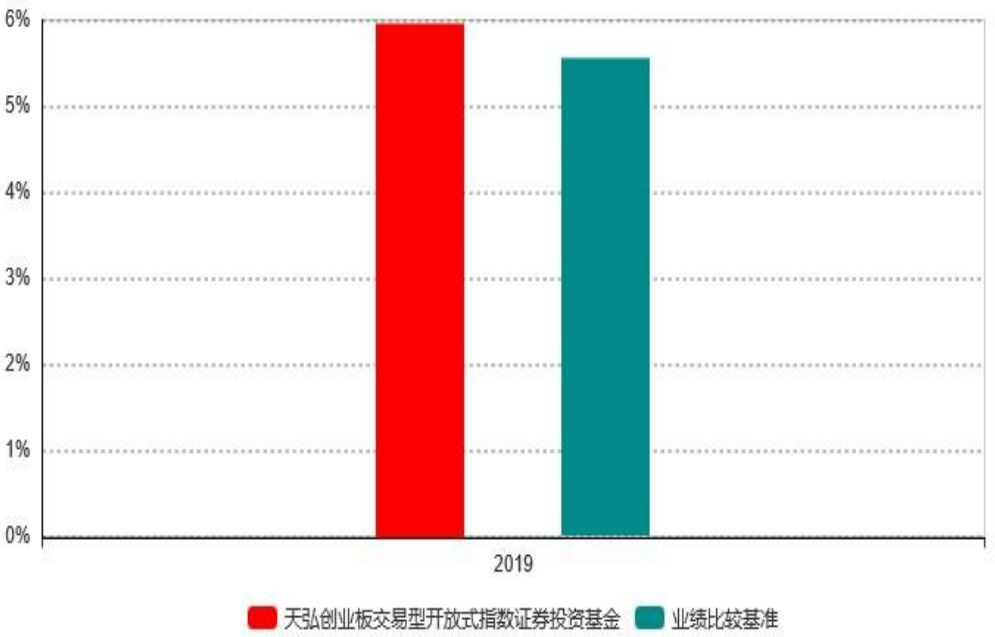
注：本基金的业绩比较基准为标的指数收益率，即创业板指数收益率。

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

注：1、本基金合同于2019年09月12日生效，本基金合同生效起至披露时点不满1年。2、按照本基金合同的约定，基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。本基金的建仓期为2019年09月12日至2020年03月11日，截止本报告期末本基金仍处于建仓期。

3.2.3 自基金合同生效以来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

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn



注：本基金合同于2019年09月12日生效。基金合同生效当年2019年的净值增长率按照基金合同生效后当年的实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金于2019年09月12日成立，自基金合同生效以来未进行利润分配，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
浙江蚂蚁小微金融服务集团股份有限公司	51%
天津信托有限责任公司	16.8%

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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2019年12月31日，本基金管理人共管理62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（原天弘沪深300指数型发起式证券投资基金）、天弘中证500指数型发起式证券投资基金、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（原天弘量化驱动股票型证券投资基金）、天弘中证证券保险指数型发起式证券投资基金、天弘中证银行指数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联接基金（原天弘创业板指数型发起式证券投资基金）、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、天弘中证电子指数型发起式证券投资基金、天弘中证计算机主题指数型发起式证券投资基金（原"天弘中证计算机指数型发起式证券投资基金"）、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、天弘穗利一年定期开放债券型证券投资基金、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

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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。

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		
杨超	本基金基金经理；指数与数量投资部副总经理。	2019年09月	-	9年	男，金融数学与计算硕士学位。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	本基金基金经理。	2019年09月	-	17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、上述任职日期根据本基金管理人对外披露的任职日期填写。
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遵规守信情况的说明

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。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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，通过交易系统中的公平交易程序，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

为规范投资行为，公平对待投资组合，制定《异常交易监控和报告办法》对可能显著影响市场价格、可能导致不公平交易、可能涉嫌利益输送等交易行为异常和交易价格异常的情形进行界定，拟定相应的监控、分析和防控措施。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

本报告期内，严格控制同一基金或不同基金组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易；针对非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购的申购方案和分配过程进行审核和监控，保证分配结果符合公平交易原则。未发现本基金存在异常交易行为。

本基金本报告期内未发生同一基金或不同基金组合之间在同一交易日内进行反向交易及其他可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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、严控流动性风险的原则，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，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造成的持仓与基准指数的差异、成分股调整以及成分股长期停牌等因素。当由于申赎变动、成分股调整、成分股停牌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适度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2019年12月31日，本基金份额净值为1.7967元，本报告期份额净值增长率5.96%，同期业绩比较基准增长率5.55%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2019年全球经济在贸易保护主义抬头和贸易摩擦、地缘政治冲突、大型经济联盟分裂等因素影响下增长速度在放缓，为了应对经济下滑，2019年全球货币政策迅速转向宽松，美联储、欧洲中央银行和许多其他央行都实施了降息，以求促进经济增长并抵消全球贸易战带来的负面影响，低利率的情况会在2020年得到维持，但我们仍然有理由对2020年的全球经济前景保持谨慎乐观的态度，相关因素包括中美贸易和谈达成第一阶段协议、英国正式退欧、以及随着企业开始重新投资，制造业可能最终恢复到正常水平。

放眼国内，2019年12月召开的中央经济工作会议提出，要“确保全面建成小康社会和‘十三五’规划圆满收官，得到人民认可、经得起历史检验”，这是2020年所有经济政策的核心目标，2020年作为十三五规划收官年、全面建成小康社会决胜年，经济和就业的平稳至关重要。同时，中央把稳增长摆在首要位置，强调经济下行压力加大，要求六稳，这也意味着2020年在经济下行压力较大的条件下，刺激政策会加码。保持宏观杠杆率基本稳定、坚持房住不炒和结构转型的政策、继续实施积极的财政政策和稳健的货币政策、推动制造业高质量发展、努力解决中小企业长期融资问题，一系列政策的组合

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

拳，将确保2020年的经济增长目标的实现。目前突发的新冠疫情以及由此导致的延迟复工，尽管会对某些行业和一季度经济增长造成较大影响，但疫情也会对本轮政策节奏产生深刻影响，有较大可能促进财政和货币政策的扩张性，如果疫情能在短时间内平稳下来，经济上的损失会在后续的高速增长中得到补偿，最终实现2020年的经济增长目标是大概率事件。

政策持续宽松、逆周期调节强化、中长期资金持续入市的背景下，看好2020年的资本市场。过往经验也证明了疫情对资本市场的影响是非常短暂的，无法改变资本市场的中长期运行方向。行业方面，外部贸易摩擦使我们清晰地认识到了我国经济长期可持续发展的隐患和短板，大力发展自主可控的高科技产业已经成为全民意识和国家意识，政策的强力支持将促进高科技行业的长期稳定发展。

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；

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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、风险管理人员及内控合规人员组成。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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，国泰君安证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金 （以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本托管人复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况（如有）、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整。

§6 审计报告

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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(2020)第23586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	天弘创业板交易型开放式指数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　我们审计了天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“创业板TH”)的财务报表，包括2019年12月31日的资产负债表，2019年9月12日(基金合同生效日)至2019年12月31日止期间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，公允反映了创业板TH2019年12月31日的财务状况以及2019年9月12日(基金合同生效日)至2019年12月31日止期间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，我们独立于创业板TH，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

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

其他信息	无
管理层和治理层对财务报表的责任	创业板TH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创业板TH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创业板TH、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创业板TH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

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

	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，就可能导致对创业板TH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创业板TH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、周祎
会计师事务所的地址	中国上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
审计报告日期	2020-04-23

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2019年12月31日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2019年12月31日
资 产：		
银行存款	7.4.7.1	8,161,914.20
结算备付金		118,006.54

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

存出保证金		554,235.12
交易性金融资产	7.4.7.2	2,621,459,490.20
其中：股票投资		2,621,459,490.20
基金投资		-
债券投资		-
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		75,479.91
应收利息	7.4.7.5	6,193.46
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		2,630,375,319.43
负债和所有者权益	**附注号**	本期末 2019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		86,790.67
应付赎回款		-
应付管理人报酬		1,162,103.39
应付托管费		232,420.69
应付销售服务费		-
应付交易费用	7.4.7.7	138,450.06
应交税费		-
应付利息		-

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	285,868.67
负债合计		1,905,633.48
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	2,480,669,017.38
未分配利润	7.4.7.10	147,800,668.57
所有者权益合计		2,628,469,685.95
负债和所有者权益总计		2,630,375,319.43

注：1、报告截止日2019年12月31日，基金份额净值1.7967元，基金份额总额1,462,936,410.00份。

2、本财务报表的实际编制期间为2019年09月12日（基金合同生效日）至2019年12月31日,无上一年度可比期间(下同)。

7.2 利润表

会计主体：天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2019年09月12日（基金合同生效日）至2019年12月31日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期2019年09月12日 （基金合同生效日）至2019年12月31日
一、收入		254,351,604.43
1.利息收入		349,825.53
其中：存款利息收入	7.4.7.11	349,825.53
债券利息收入		-
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）		50,578,143.10
其中：股票投资收益	7.4.7.12	47,785,346.65
基金投资收益		-

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

债券投资收益	7.4.7.13.1	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.2	-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	7.4.7.14	-
股利收益	7.4.7.15	2,792,796.45
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	203,789,354.17
4.汇兑收益（损失以“－”号填列）		-
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-365,718.37
减：二、费用		5,976,356.43
1．管理人报酬		4,023,027.44
2．托管费		804,605.48
3．销售服务费		-
4．交易费用	7.4.7.18	727,341.85
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	7.4.7.19	421,381.66
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		248,375,248.00
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		248,375,248.00

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2019年09月12日（基金合同生效日）至2019年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2019年09月12日（基金合同生效日）至2019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	640,858,438.00	-	640,858,438.00

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

(基金净值)			
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	248,375,248.00	248,375,248.00
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)	1,839,810,579.38	-100,574,579.43	1,739,235,999.95
其中：1.基金申购款	3,028,480,824.28	-84,006,844.96	2,944,473,979.32
2.基金赎回款	-1,188,670,244.90	-16,567,734.47	-1,205,237,979.37
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）	2,480,669,017.38	147,800,668.57	2,628,469,685.95

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	肖慧敏
————————	————————	————————
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

天弘创业板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]1409号《关于准予天弘创业板交易型开放式指数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《天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型的交易型开放式基金，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640,778,160.00 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0520号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于2019年09月12日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为640,858,438.00 份基

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

金份额，其中认购资金利息折合80,278.00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，基金托管人为国泰君安证券股份有限公司。

根据《天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定，经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上[2019]581号文审核同意，本基金377,936,410.00份基金份额于2019年9月27日在深交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数，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。本基金以标的指数成份股和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)、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：创业板指数收益率。

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，成立了天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“天弘创业板ETF联接基金”)。天弘创业板 ETF联接基金为交易型开放式基金，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。

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2020年4月23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》、《天弘创业板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。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

本财务报表以本基金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2019年09月12日(基金合同生效日)至2019年12月31日止期间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2019年12月31日的财务状况以及2019年09月12日(基金合同生效日)至2019年12月31日止期间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。本期财务报表的实际编制期间为2019年09月12日(基金合同生效日)至2019年12月31日。

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。本基金在投资人申购、赎回过程中而待与投资人结算的可退替代款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，在资产负债表中的其他负债科目下列示。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。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。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

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

本基金的管理人报酬和托管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

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，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。当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到 1%以上时，可进行收益分配。

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

本基金本报告期无其他重要的会计政策和会计估计。

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

本基金本报告期未发生会计政策变更。

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。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日
活期存款	8,161,914.20
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	8,161,914.20

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末2019年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		2,417,670,136.03	2,621,459,490.20	203,789,354.17
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	-	-	-
	银行间市场	-	-	-
	合计	-	-	-
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		2,417,670,136.03	2,621,459,490.20	203,789,354.17

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

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

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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 2019年12月31日
应收活期存款利息	5,801.29
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	117.83
应收债券利息	-
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	274.34
合计	6,193.46

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日
交易所市场应付交易费用	138,450.06
银行间市场应付交易费用	-
合计	138,450.06

7.4.7.8 其他负债

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31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	60,000.00
应付指数使用费	225,868.67
合计	285,868.67

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2019年09月12日（基金合同生效日）至2019年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	640,858,438.00	640,858,438.00
本期申购	-	-
本期赎回（以“-”号填列）	-	-
2019年09月19日基金拆分/份额折算前	640,858,438.00	640,858,438.00
基金拆分/份额折算调整	-262,922,028.00	-
本期申购	1,786,000,000.00	3,028,480,824.28
本期赎回（以“-”号填列）	-701,000,000.00	-1,188,670,244.90
本期末	1,462,936,410.00	2,480,669,017.38

注：1、本基金自2019年08月26日至2019年09月06日止期间公开发售，共募集有效净认购资金人民币640,778,160.00元，折合为640,778,160.00份基金份额。根据《天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入人民币80,278.00元在本基金成立后，折合为80,278.00份基金份额，划入基金份额持有人账户。

2、根据《天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金基金合同》、《天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》及《天弘基金管理有限公司关于天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购赎回业务的公告》的相关规定，本基金于2019年09月12日(基金合同生效日)至2019年09月26日止期间暂不向投资人开放基金交

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

易。申购和赎回业务自2019年09月27日起开始办理。

3、根据《天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的相关规定和《天弘基金管理有限公司关于天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金基金份额折算的公告》，本基金的基金管理人确定2019年9月19日为份额折算基准日，对本基金实施不定期份额折算。折算前，本基金基金份额总额为640,858,438.00份，根据基金份额折算公式，基金份额折算比例为0.58974180，折算后本基金基金份额总额为377,936,410.00份，减少本基金基金份额262,922,028.00份，份额净值为1.7056元。中国证券登记结算有限责任公司已根据上述折算比例，对全体基金份额持有人持有的基金份额进行了折算，并于2019年9月20日进行了变更登记。

4、截至2019年12月31日止，本基金于深交所上市的基金份额为1,462,936,410.00份，无托管在场外未上市交易的基金份额。

7.4.7.10 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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	44,585,893.83	203,789,354.17	248,375,248.00
本期基金份额交易产生的变动数	-1,596,438.63	-98,978,140.80	-100,574,579.43
其中：基金申购款	5,277,506.84	-89,284,351.80	-84,006,844.96
基金赎回款	-6,873,945.47	-9,693,789.00	-16,567,734.47
本期已分配利润	-	-	-
本期末	42,989,455.20	104,811,213.37	147,800,668.57

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2019年09月12日（基金合同生效日）至2019年12月31日
活期存款利息收入	325,708.88
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	16,522.49
其他	7,594.16

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

合计	349,825.53

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期2019年09月12日（基金合同生效日）至2019年12月31日
股票投资收益——买卖股票差价收入	5,197,362.57
股票投资收益——赎回差价收入	42,587,984.08
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	47,785,346.65

7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年09月12日（基金合同生效日）至2019年12月31日
卖出股票成交总额	320,503,004.85
减：卖出股票成本总额	315,305,642.28
买卖股票差价收入	5,197,362.57

7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年09月12日（基金合同生效日）至2019年12月31日
赎回基金份额对价总额	1,205,237,979.37
减：现金支付赎回款总额	7,164,085.37
赎回股票成本总额	1,155,485,909.92
赎回差价收入	42,587,984.08

7.4.7.12.4 股票投资收益——申购差价收入

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

本基金本报告期未取得因申购基金份额产生股票投资收益。

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

本基金本报告期未取得债券投资收益。

7.4.7.13.2 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。

7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期未取得衍生工具投资收益。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年09月12日（基金合同生效日）至2019年12月31日
股票投资产生的股利收益	2,792,796.45
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	2,792,796.45

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年09月12日（基金合同生效日）至2019年12月31日
1.交易性金融资产	203,789,354.17
——股票投资	203,789,354.17
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

——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	203,789,354.17

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年09月12日（基金合同生效日）至2019年12月31日
基金赎回费收入	-
ETF基金替代损益	-365,718.37
合计	-365,718.37

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年09月12日（基金合同生效日）至2019年12月31日
交易所市场交易费用	727,341.85
银行间市场交易费用	-
合计	727,341.85

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年09月12日（基金合同生效日）至2019年12月31日
审计费用	60,000.00

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

信息披露费	-
证券出借违约金	-
指数使用费	241,381.66
上市费	20,000.00
登记结算费	100,000.00
合计	421,381.66

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
国泰君安证券股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
浙江蚂蚁小微金融服务集团股份有限公司	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（有限合伙）	基金管理人的股东
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
天弘创业板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。

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

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年09月12日（基金合同生效日）至2019年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国泰君安证券股份有限公司	1,271,294,497.00	100.00%

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期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 2019年09月12日（基金合同生效日）至2019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
国泰君安证券股份有限公司	294,055.56	100.00%	138,450.06	100.00%

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

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 2019年09月12日（基金合同生效日）至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	4,023,027.44

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

其中：支付销售机构的客户维护费	-

注:支付基金管理人天弘基金管理有限公司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　X　0.50%/当年天数。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年09月12日（基金合同生效日）至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	804,605.48

注:支付基金托管人国泰君安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X　0.10%/当年天数。

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

本报告期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

本基金本报告期转融通证券出借业务未发生重大关联交易事项。

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

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2019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
国泰君安证券股份有限公司	6,515,904.00	0.45%
天弘创业板交易型开放式指	1,325,906,997.00	90.63%

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

数证券投资基金联接基金		

注：1、本基金基金合同生效日为2019年09月12日，无上年度可比期间数据。
2、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。

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 2019年09月12日（基金合同生效日）至2019年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
国泰君安证券股份有限公司	8,161,914.20	325,708.88

注：本基金的银行存款由基金托管人国泰君安证券股份有限公司保管，存放在具有基金托管资格的中国工商银行股份有限公司，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

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

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（2019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
002973	侨银	201	2020	新股	5.74	5.74	1,146	6,578.	6,578.	-

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

	环保	9-12-27	-01-06	未上市				04	04	

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

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2019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2019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

本基金是被动式投资的股票型指数基金，紧密跟踪创业板指数收益率，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，属于高风险、高收益的品种。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，跟踪创业板指数收益率，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

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

等；在管理层层面设立风险管理委员会，主要负责根据公司总体风险控制目标，将交易、运营风险控制目标和要求分配到各部门；讨论、协调各部门之间的风险管理过程；听取各部门风险管理工作方面的汇报，确定未来一段时间各部门应重点关注的风险点，并调整与改进相关的风险处理和控制策略；讨论向公司高级管理层提交的基金运作风险报告。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国泰君安证券股份有限公司开立于具有基金托管人资格的中国工商银行股份有限公司，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，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。

于2019年12月31日,本基金无债券投资。

7.4.13.3 流动性风险

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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。

于 2019年12月31日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

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。

本基金所持证券在证券交易所上市，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2019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为0.0003%。

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、结算备付金和存出保证金等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

本期末2019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	8,161,914.20	-	-	-	8,161,914.20
结算备付金	118,006.54	-	-	-	118,006.54
存出保证金	554,235.12	-	-	-	554,235.12
交易性金融资产	-	-	-	2,621,459,490.20	2,621,459,490.20
应收证券清算款	-	-	-	75,479.91	75,479.91
应收利息	-	-	-	6,193.46	6,193.46
资产总计	8,834,155.86	-	-	2,621,541,163.57	2,630,375,319.43
负债					
应付证券清算款	-	-	-	86,790.67	86,790.67
应付管理人报酬	-	-	-	1,162,103.39	1,162,103.39
应付托管费	-	-	-	232,420.69	232,420.69
应付交易费用	-	-	-	138,450.06	138,450.06
其他负债	-	-	-	285,868.67	285,868.67
负债总计	-	-	-	1,905,633.48	1,905,633.48
利率敏感度缺口	8,834,155.86	-	-	2,619,635,530.09	2,628,469,685.95

注：1、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。

2、本基金基金合同生效日为2019年09月12日，无上年度可比期间数据。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2019年12月31日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

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

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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，跟踪创业板指数，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，创业板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。

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 2019年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)
交易性金融资产－股票投资	2,621,459,490.20	99.73
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	2,621,459,490.20	99.73

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(附注7.4.1)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 2019年12月31日

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

	1.业绩比较基准(附注7.4.1)上升5%	131,460,462.98
	2.业绩比较基准(附注7.4.1)下降5%	-131,460,462.98

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2019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2,621,452,912.16元，属于第二层次的余额为6,578.04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2019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。

(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。

§8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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	2,621,459,490.20	99.66
	其中：股票	2,621,459,490.20	99.66
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	8,279,920.74	0.31
8	其他各项资产	635,908.49	0.02
9	合计	2,630,375,319.43	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	237,144,840.00	9.02
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,424,251,650.51	54.19
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	455,771,438.72	17.34

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

	术服务业		
J	金融业	134,896,580.00	5.13
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	17,538,730.00	0.67
M	科学研究和技术服务业	60,352,275.00	2.30
N	水利、环境和公共设施管理业	22,421,520.00	0.85
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	155,055,897.16	5.90
R	文化、体育和娱乐业	113,998,448.52	4.34
S	综合	-	-
	合计	2,621,431,379.91	99.73

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	21,532.25	0.00
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	-	-

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	6,578.04	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	28,110.29	0.00

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	300498	温氏股份	6,926,000	232,713,600.00	8.85
2	300750	宁德时代	1,383,600	147,215,040.00	5.60
3	300059	东方财富	8,554,000	134,896,580.00	5.13
4	300760	迈瑞医疗	675,643	122,899,461.70	4.68
5	300015	爱尔眼科	2,186,411	86,494,419.16	3.29
6	300142	沃森生物	2,124,100	68,905,804.00	2.62
7	300003	乐普医疗	1,925,500	63,695,540.00	2.42
8	300136	信维通信	1,380,400	62,642,552.00	2.38
9	300124	汇川技术	1,851,700	56,736,088.00	2.16
10	300347	泰格医药	858,400	54,207,960.00	2.06
11	300014	亿纬锂能	870,800	43,679,328.00	1.66
12	300122	智飞生物	857,653	42,591,047.98	1.62
13	300601	康泰生物	473,317	41,552,499.43	1.58

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

14	300408	三环集团	1,799,300	40,088,404.00	1.53
15	300144	宋城演艺	1,220,600	37,728,746.00	1.44
16	300033	同花顺	341,538	37,265,211.18	1.42
17	300383	光环新网	1,795,200	36,029,664.00	1.37
18	300450	先导智能	801,400	36,014,916.00	1.37
19	300012	华测检测	2,319,900	34,589,709.00	1.32
20	300088	长信科技	3,248,600	33,363,122.00	1.27
21	300413	芒果超媒	948,812	33,170,467.52	1.26
22	300207	欣旺达	1,671,900	32,635,488.00	1.24
23	300253	卫宁健康	2,123,800	31,814,524.00	1.21
24	300017	网宿科技	3,195,600	30,454,068.00	1.16
25	300454	深信服	260,048	29,746,890.72	1.13
26	300024	机器人	2,028,800	28,403,200.00	1.08
27	300315	掌趣科技	4,289,100	26,463,747.00	1.01
28	300285	国瓷材料	1,147,000	26,208,950.00	1.00
29	300661	圣邦股份	100,600	25,399,488.00	0.97
30	300271	华宇软件	996,600	25,313,640.00	0.96
31	300296	利亚德	3,023,400	23,189,478.00	0.88
32	300070	碧水源	2,950,200	22,421,520.00	0.85
33	300529	健帆生物	310,700	22,320,688.00	0.85
34	300146	汤臣倍健	1,276,200	20,789,298.00	0.79
35	300558	贝达药业	316,100	20,767,770.00	0.79
36	300699	光威复材	434,600	19,774,300.00	0.75
37	300357	我武生物	445,400	19,664,410.00	0.75
38	300676	华大基因	285,800	19,634,460.00	0.75
39	300433	蓝思科技	1,385,500	19,147,610.00	0.73
40	300496	中科创达	421,600	19,031,024.00	0.72
41	300113	顺网科技	740,390	19,020,619.10	0.72
42	300212	易华录	562,400	18,806,656.00	0.72
43	300251	光线传媒	1,592,300	18,789,140.00	0.71
44	300168	万达信息	1,202,400	18,553,032.00	0.71

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

45	300618	寒锐钴业	222,420	18,325,183.80	0.70
46	300058	蓝色光标	3,104,200	17,538,730.00	0.67
47	300166	东方国信	1,343,300	17,462,900.00	0.66
48	300115	长盈精密	969,900	17,254,521.00	0.66
49	300274	阳光电源	1,605,500	16,905,915.00	0.64
50	300308	中际旭创	317,050	16,534,157.50	0.63
51	300073	当升科技	601,600	16,423,680.00	0.62
52	300009	安科生物	1,085,500	16,380,195.00	0.62
53	300418	昆仑万维	973,500	16,306,125.00	0.62
54	300747	锐科激光	136,950	16,132,710.00	0.61
55	300316	晶盛机电	1,020,036	16,034,965.92	0.61
56	300226	上海钢联	204,504	15,910,411.20	0.61
57	300001	特锐德	891,500	15,315,970.00	0.58
58	300463	迈克生物	546,100	14,728,317.00	0.56
59	300244	迪安诊断	648,600	14,353,518.00	0.55
60	300010	立思辰	1,111,200	14,345,592.00	0.55
61	300595	欧普康视	298,500	14,128,005.00	0.54
62	300567	精测电子	255,700	14,022,588.00	0.53
63	300369	绿盟科技	772,000	13,988,640.00	0.53
64	300482	万孚生物	269,699	13,962,317.23	0.53
65	300457	赢合科技	390,300	13,250,685.00	0.50
66	300628	亿联网络	180,300	13,055,523.00	0.50
67	300133	华策影视	1,754,500	12,983,300.00	0.49
68	300072	三聚环保	2,049,000	12,949,680.00	0.49
69	300180	华峰超纤	1,429,100	12,633,244.00	0.48
70	300630	普利制药	220,500	12,489,120.00	0.48
71	300188	美亚柏科	729,395	12,472,654.50	0.47
72	300098	高新兴	2,076,000	12,310,680.00	0.47
73	300294	博雅生物	377,141	11,778,113.43	0.45
74	300170	汉得信息	1,175,000	11,385,750.00	0.43
75	300182	捷成股份	3,245,500	11,326,795.00	0.43

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

76	300078	思创医惠	907,000	11,137,960.00	0.42
77	300476	胜宏科技	674,700	11,004,357.00	0.42
78	300474	景嘉微	187,400	10,977,892.00	0.42
79	300038	数知科技	1,270,500	10,951,710.00	0.42
80	300068	南都电源	1,007,900	10,865,162.00	0.41
81	300724	捷佳伟创	257,200	9,745,308.00	0.37
82	300324	旋极信息	1,725,200	9,661,120.00	0.37
83	300026	红日药业	2,720,200	9,547,902.00	0.36
84	300377	赢时胜	814,098	9,353,986.02	0.36
85	300459	金科文化	2,795,400	8,917,326.00	0.34
86	300616	尚品宅配	117,314	8,742,239.28	0.33
87	300203	聚光科技	517,000	8,639,070.00	0.33
88	300748	金力永磁	211,000	8,220,560.00	0.31
89	300666	江丰电子	162,600	6,975,540.00	0.27
90	300633	开立医疗	273,700	6,541,430.00	0.25
91	300741	华宝股份	210,448	6,498,634.24	0.25
92	300222	科大智能	691,200	6,448,896.00	0.25
93	300759	康龙化成	118,900	6,128,106.00	0.23
94	300773	拉卡拉	72,400	5,681,228.00	0.22
95	300761	立华股份	74,600	4,431,240.00	0.17
96	300682	朗新科技	163,100	3,690,953.00	0.14
97	300634	彩讯股份	156,700	2,830,002.00	0.11
98	300768	迪普科技	72,300	2,636,781.00	0.10
99	300766	每日互动	72,500	2,378,725.00	0.09
100	300674	宇信科技	72,300	1,905,105.00	0.07

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

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

					值比例（%）
1	002972	科安达	1,075	21,532.25	-
2	002973	侨银环保	1,146	6,578.04	-

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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	300760	迈瑞医疗	102,240,573.96	3.89
2	300498	温氏股份	71,155,448.35	2.71
3	300059	东方财富	38,893,565.02	1.48
4	300750	宁德时代	32,693,088.04	1.24
5	300661	圣邦股份	26,010,377.00	0.99
6	300015	爱尔眼科	21,267,175.29	0.81
7	300347	泰格医药	18,974,672.94	0.72
8	300033	同花顺	17,568,520.21	0.67
9	300529	健帆生物	17,368,117.03	0.66
10	300142	沃森生物	17,096,188.80	0.65
11	300595	欧普康视	16,408,256.27	0.62
12	300003	乐普医疗	15,501,299.68	0.59
13	300601	康泰生物	15,392,707.43	0.59
14	300369	绿盟科技	15,245,731.93	0.58
15	300136	信维通信	15,138,820.41	0.58
16	300413	芒果超媒	15,099,538.89	0.57
17	300124	汇川技术	13,284,536.20	0.51
18	300122	智飞生物	13,110,527.92	0.50
19	300408	三环集团	11,362,438.00	0.43
20	300383	光环新网	10,520,482.00	0.40

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。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	300496	中科创达	16,915,045.60	0.64
2	300027	华谊兄弟	15,609,710.03	0.59
3	300036	超图软件	13,405,153.67	0.51
4	300059	东方财富	12,864,307.10	0.49
5	300002	神州泰岳	9,394,343.00	0.36
6	300197	铁汉生态	9,373,620.50	0.36
7	300628	亿联网络	9,262,830.86	0.35
8	300168	万达信息	8,868,714.00	0.34
9	300760	迈瑞医疗	7,838,390.00	0.30
10	300145	中金环境	7,719,273.61	0.29
11	300159	新研股份	7,581,829.00	0.29
12	300373	扬杰科技	7,348,011.30	0.28
13	300142	沃森生物	7,030,230.15	0.27
14	300367	东方网力	6,977,957.60	0.27
15	300347	泰格医药	6,316,345.46	0.24
16	300136	信维通信	5,808,543.98	0.22
17	300003	乐普医疗	5,737,655.00	0.22
18	300124	汇川技术	5,661,565.00	0.22
19	300199	翰宇药业	5,591,894.00	0.21
20	300323	华灿光电	5,281,227.00	0.20

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	951,029,356.86
卖出股票收入（成交）总额	320,503,004.85

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有权证。

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 本报告期内未发现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查，未发现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

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	554,235.12

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

2	应收证券清算款	75,479.91
3	应收股利	-
4	应收利息	6,193.46
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	635,908.49

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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。

8.12.5 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	002973	侨银环保	6,578.04	0.00	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

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

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

4,279	341,887.45	1,355,191,338.00	92.64%	107,745,072.00	7.36%

9.2 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	国泰君安证券股份有限公司－天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基金	1,325,906,997.00	90.63
2	方正证券股份有限公司	10,569,023.00	0.72
3	国泰君安证券股份有限公司	6,515,904.00	0.45
4	招商证券股份有限公司	6,094,003.00	0.42
5	中国银河证券股份有限公司	4,253,411.00	0.29
6	曹寅	990,900.00	0.07
7	赖国全	700,000.00	0.05
8	北京云海腾飞铸造有限责任公司	589,827.00	0.04
8	张凯歌	589,827.00	0.04
10	湖南艾华投资有限公司	589,816.00	0.04

注：持有人为场内持有人。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	1,278.00	0.00%

9.4 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、基金投资和研究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

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2019年09月12日)基金份额总额	640,858,438.00

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	1,786,000,000.00
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	701,000,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-262,922,028.00
本报告期期末基金份额总额	1,462,936,410.00

注： 本基金合同于2019年09月12日生效。

§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

本报告期内基金管理人于2019年10月15日披露《天弘基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，胡晓明先生任职公司董事长，同时井贤栋先生不再担任公司董事长。

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

本报告期内没有发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 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。

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60,000.00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4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

金额单位：人民币元

券商名称	交	股票交易	应支付该券商的佣金	备

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

	易单元数量	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	注
安信证券	2	-	-	-	-	-
方正证券	3	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券	6	1,271,294,497.00	100.00%	294,055.56	100.00%	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券	2	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投证券	2	-	-	-	-	-

注：1、基金专用交易单元的选择标准为：该证券经营机构财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；经营行为规范，内控制度健全，最近两年未因重大违规行为受到监管机关的处罚；研究实力较强，能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、市场分析报告、行业研究报告、个股分析报告及全面的信息服务。

2、基金专用交易单元的选择程序：本基金管理人根据上述标准进行考察后，确定选用交易席位的证券经营机构。然后基金管理人和被选用的证券经营机构签订交易席位租用协议。

3、本基金报告期内新租用交易单元：11个，其中包括安信证券上海交易单元1个；安信证券深圳交易单元1个；国泰君安证券上海交易单元1个；国泰君安证券深圳交易单元3个；方正证券上海交易单元1个；方正证券深圳交易单元1个；银河证券深圳交易单元1个；中信建投证券上海交易单元1个；中信建投证券深圳交易单元1个。

4、本基金报告期内停止租用交易单元：无。

11.8 其他重大事件

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	天弘创业板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	2019-08-23
2	天弘创业板交易型开放式指数 证券投资基金基金合同	中国证监会指定媒介	2019-08-23
3	天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金 招募说明书	中国证监会指定媒介	2019-08-23
4	天弘创业板交易型开放式指数 证券投资基金基金合同摘要	中国证监会指定媒介	2019-08-23
5	天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金 基金份额发售公告	中国证监会指定媒介	2019-08-23
6	天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金 上网发售提示性公告	中国证监会指定媒介	2019-08-26
7	天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金 基金合同生效公告	中国证监会指定媒介	2019-09-13
8	天弘基金管理有限公司关于增聘天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金基金经理的公告	中国证监会指定媒介	2019-09-16
9	天弘基金管理有限公司关于天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金基金份额折算的公告	中国证监会指定媒介	2019-09-18
10	天弘创业板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	2019-09-19
11	天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金 招募说明书（更新）摘要	中国证监会指定媒介	2019-09-19
12	天弘基金管理有限公司关于天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金基金份额折算结果的公告	中国证监会指定媒介	2019-09-23
13	天弘基金管理有限公司关于天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金开放日常申购赎回业务的公告	中国证监会指定媒介	2019-09-24
14	天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金 上市交易公告书	中国证监会指定媒介	2019-09-24

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

15	天弘基金管理有限公司关于天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告	中国证监会指定媒介	2019-09-27
16	天弘基金管理有限公司关于天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金上市交易提示性公告	中国证监会指定媒介	2019-09-27
17	天弘基金管理有限公司关于在网上直销交易系统开通中国工商银行快捷支付业务并实施相关费率优惠的公告	中国证监会指定媒介	2019-10-15
18	天弘基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会指定媒介	2019-10-15
19	天弘基金管理有限公司关于新增天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会指定媒介	2019-10-17
20	天弘创业板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	2019-10-19
21	天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金 招募说明书（更新）摘要	中国证监会指定媒介	2019-10-19
22	天弘基金管理有限公司关于调整天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金交易结算模式的公告	中国证监会指定媒介	2019-10-19
23	天弘基金管理有限公司关于系统升级维护的通知	中国证监会指定媒介	2019-10-25
24	天弘基金管理有限公司关于天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告	中国证监会指定媒介	2019-10-29
25	天弘基金管理有限公司关于新增天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会指定媒介	2019-11-16
26	天弘基金管理有限公司关于天弘创	中国证监会指定媒介	2019-11-19

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

	业板交易型开放式指数证券投资基金流动性服务商的公告		
27	天弘基金管理有限公司关于新增天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金申购赎回代办证券公司的公告	中国证监会指定媒介	2019-11-22
28	天弘创业板交易型开放式指数 证券投资基金基金合同	中国证监会指定媒介	2019-12-28
29	天弘创业板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	2019-12-28
30	天弘基金管理有限公司关于在网上直销交易系统开通中国光大银行股份有限公司快捷支付业务并实施相关费率优惠的公告	中国证监会指定媒介	2019-12-31

§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
联接基金	1	20190930-20191231	-	3,397,015,499.00	2,071,108,502.00	1,325,906,997.00	90.63%
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；							

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn

（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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

§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创业板交易型开放式指数证券投资基金募集的文件

2、天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金基金合同

3、天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金托管协议

4、天弘创业板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

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

二〇二〇年四月二十四日

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn