

天弘中证电子交易型开放式指数证券投资基金

2020 年中期报告

2020 年 06 月 30 日

基金管理人:天弘基金管理有限公司

基金托管人:海通证券股份有限公司

送出日期:2020 年 08 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带的法律责任。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人海通证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2020年08月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2020年02月27日起至2020年06月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	13
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	13
§6 中期财务会计报告(未经审计)	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	16
6.4 报表附注	17
§7 投资组合报告	41
7.1 期末基金资产组合情况	41
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	48
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	50
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	50
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	50
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	50
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	50
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	50
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	50
7.12 投资组合报告附注	50
§8 基金份额持有人信息	52
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	52
8.2 期末上市基金前十名持有人	52

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	53
8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	53
§9 开放式基金份额变动.....	53
§10 重大事件揭示.....	53
10.1 基金份额持有人大会决议.....	53
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	53
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	53
10.4 基金投资策略的改变.....	53
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	54
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	54
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	54
10.8 其他重大事件.....	54
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	56
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	56
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	57
§12 备查文件目录.....	57
12.1 备查文件目录.....	57
12.2 存放地点.....	57
12.3 查阅方式.....	57

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	天弘中证电子交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	电子ETF
场内简称	电子ETF
基金主代码	159997
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2020年02月27日
基金管理人	天弘基金管理有限公司
基金托管人	海通证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,449,306,634.00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	2020-03-20

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金力争将日均跟踪偏离度控制在0.2%以内，年化跟踪误差控制在2%以内。
投资策略	本基金主要采取完全复制策略，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况（如流动性不足、成份股长期停牌、法律法规限制等）导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。为使得基金的投资组合更紧密地跟踪标的指数，基金可投资于经中国证监会允许的各种金融衍生产品，如股指期货以及其他与标的指数或标的指数成份

	股相关的衍生工具。
业绩比较基准	中证电子指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	天弘基金管理有限公司	海通证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	童建林
	联系电话	022-83310208
	电子邮箱	service@thfund.com.cn
客户服务电话	95046	021-95553
传真	022-83865569	021-63410637
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	上海市黄浦区广东路689号海通证券大厦
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	上海市黄浦区广东路689号海通证券大厦
邮政编码	300203	200001
法定代表人	胡晓明	周杰

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.thfund.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2020年02月27日（基金合同生效日）－2020年06月30日）
本期已实现收益	80,447,101.54
本期利润	422,181,317.74
加权平均基金份额本期利润	0.1803
本期加权平均净值利润率	18.44%
本期基金份额净值增长率	13.15%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2020年06月30日）
期末可供分配利润	80,537,646.29
期末可供分配基金份额利润	0.0329
期末基金资产净值	2,771,461,625.32
期末基金份额净值	1.1315
3.1.3 累计期末指标	报告期末（2020年06月30日）
基金份额累计净值增长率	13.15%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	17.77%	1.76%	17.57%	1.76%	0.20%	0.00%

过去三个月	29.80%	2.07%	29.33%	2.08%	0.47%	-0.01%
自基金合同生效日起至 今	13.15%	2.10%	-5.10%	2.59%	18.25%	-0.49%

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

天弘中证电子交易型开放式指数证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2020年02月27日-2020年06月30日)



注：1、本基金合同于2020年02月27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2020年02月27日至2020年08月26日，截止本报告期末本基金仍处于建仓期。

§ 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%

注：2020年7月22日，公司披露了《天弘基金管理有限公司关于股东名称变更的公告》。

截至2020年6月30日，本基金管理人共管理74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、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、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（原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交易型开放式指数证券投资基金联接基金（原天弘中证计算机主题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式证券投资基金、天弘弘择短债债券型证券投资基金、天弘信益债券型证券投资基金、天弘养老目标日期2035三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、天弘弘新混合型发起式证券投资基金、天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金、天弘标普500发起式证券投资基金（QDII-FOF）、天弘优质成长企业精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、天弘鑫利三年定期开放债券型证券投资基金、天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金、天弘中证红利低波动100指数型发起式证券投资基金、天弘季季兴三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、天弘中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金、天弘沪深300指数增强型发起式证券投资基金、天弘越南市场股票型发起式证券投资基金（QDII）、天弘中证电子交易型开放式指数证券投资基金、天弘中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金、天弘增利短债债券型发起式证券投资基金、天弘恒享一年定期开放债券型发起式证券投资基金、天弘纯享一年定期开放债券型发起式证券投资基金、天弘中债1-3年国开行债券指数发起式证券投资基金、天弘永裕稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、天弘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。

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和智能投资部副总经理。	2020年02月	-	10年	男，金融数学与计算硕士。历任建信基金管理有限责任公司基金经理助理，泰达宏利基金管理有限公司基金经理。2019年1月加盟本公司。

注：1、上述任职日期/离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金按照国家法律法规及基金合同的相关约定进行操作，不存在违法违规及未履行基金合同承诺的情况。

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其配套规则和其他相关法律法规、基金合同的有关规定，勤勉尽责地管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。

本报告期内，本基金运作合法合规，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公平交易的执行情况包括：建立统一的研究平台和公共信息平台，保证各组合得到公平的投资资讯；公平对待不同投资组合，禁止各投资组合之间进行以利益输送为目的的投资交易活动；在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，严格执行授权审批程序；实行集中交易制度和公平交易分配制度；建立不同投资组合投资信息的管理及保密制度，保证不同投资组合经理之间的重大非公开投资信息的相互隔离；加强对投资交易行为的监察稽核力度，建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估体系等。

报告期内，公司公平交易程序运作良好，未出现异常情况；场外、网下业务公平交易制度执行情况良好，未出现异常情况。

公司对旗下各投资组合的交易行为进行监控和分析，对各投资组合不同时间窗口（1日、3日、5日）内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验，未发现违反公平交易原则的异常交易。

本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况，公司旗下各基金不存在因非公平交易等导致的利益输送行为，公平交易制度的整体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价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19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

本基金秉承被动复制为原则，通过积极管理控制跟踪误差，上市以来在场内为客户提供标准化投资电子行业的投资工具。上半年受新冠疫情和中美关系的不确定性双重影响，指数波动较大。在电子产业核心能力本土化，国产替代化等逻辑的驱动下，市场给予较高的预期。

场内交易方面，本基金为了进一步便利投资者的交易，上市以来进行了一次缩小单位创设净值的操作。同时本基金参与打新，为投资者增厚了一定的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2020年06月30日，本基金份额净值为1.1315元，本报告期份额净值增长率13.15%，同期业绩比较基准增长率-5.10%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，在上半年财政和货币政策的调整下，将密切关注实体经济整体3-4季度的盈利改善状况，同时在趋势性低利率环境下，短端利率水平的波动和市场风险偏好的变动将成为系统性风险的阶段性主导因素，同时电子行业权重公司的业绩兑现情况和技术路线以及市场空间的变化将会决定整体行业的中长期走势，本基金将密切关注。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构，负责制定公司所管理基金的基本估值政策，对公司旗下基金已采用的估值政策、方法、流程的执行情况进行审核监督，对因经营环境或市场变化等导致需调整已实施的估值政策、方法和流程的，负责审查批准基金估值政策、方法和流程的变更和执行。确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益。估值委员会由公司分管固定收益投资的高级管理人员、督察长、分管估值业务的IT运维总监、投资研究部负责人组成。

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

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

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

报告期内，本基金管理人未与任何第三方签订与估值相关的定价服务协议。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内本基金管理人无应说明预警信息。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本基金托管人在对天弘中证电子交易型开放式指数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，天弘中证电子交易型开放式指数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电子交易型开放式指数证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金收益的计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，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。本报告期内，天弘中证电子交易型开放式指数证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

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电子交易型开放式指数证券投资基金2020年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 中期财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：天弘中证电子交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：2020年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2020年06月30日
资 产：		
银行存款	6.4.7.1	14,661,850.85
结算备付金		1,697,393.88

存出保证金		1,341,984.06
交易性金融资产	6.4.7.2	2,761,490,434.10
其中：股票投资		2,761,490,434.10
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	6.4.7.3	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	—
应收证券清算款		5,603,009.46
应收利息	6.4.7.5	8,206.88
应收股利		—
应收申购款		—
递延所得税资产		—
其他资产	6.4.7.6	81,877.50
资产总计		2,784,884,756.73
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020年06月30日
负 债：		
短期借款		—
交易性金融负债		—
衍生金融负债	6.4.7.3	—
卖出回购金融资产款		—
应付证券清算款		11,440,235.09
应付赎回款		—
应付管理人报酬		1,044,727.42
应付托管费		208,945.48
应付销售服务费		—
应付交易费用	6.4.7.7	490,071.96
应交税费		—
应付利息		—

应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	6.4.7.8	239,151.46
负债合计		13,423,131.41
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	2,449,306,634.00
未分配利润	6.4.7.10	322,154,991.32
所有者权益合计		2,771,461,625.32
负债和所有者权益总计		2,784,884,756.73

注：1. 报告截止日2020年06月30日，基金份额净值1.1315元，基金份额总额2,449,306,634.00份。

2. 本财务报表的实际编制期间为2020年02月27日（基金合同生效日）至2020年06月30日，无上一年度可比期间（下同）。

6.2 利润表

会计主体：天弘中证电子交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020年02月27日（基金合同生效日）至2020年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期2020年02月27日（基金合同生效日）至2020年06月30日
一、收入		429,387,932.88
1. 利息收入		1,156,164.55
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,156,164.55
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）		87,205,103.86
其中：股票投资收益	6.4.7.12	73,691,462.07
基金投资收益		-

债券投资收益	6.4.7.13	-
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.2	-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	6.4.7.14	-
股利收益	6.4.7.15	13,513,641.79
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	341,734,216.20
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-707,551.73
减：二、费用		7,206,615.14
1. 管理人报酬		3,958,829.30
2. 托管费		791,765.86
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.18	2,109,587.18
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	6.4.7.19	346,432.80
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		422,181,317.74
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		422,181,317.74

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：天弘中证电子交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020年02月27日（基金合同生效日）至2020年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期		
	2020年02月27日（基金合同生效日）至2020年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益	1,154,306,634.00	-	1,154,306,634.00

(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)	-	422,181,317.74	422,181,317.74
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)	1,295,000,000.00	-100,026,326.42	1,194,973,673.58
其中: 1. 基金申购款	3,106,000,000.00	-105,161,719.75	3,000,838,280.25
2. 基金赎回款	-1,811,000,000.00	5,135,393.33	-1,805,864,606.67
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)	2,449,306,634.00	322,154,991.32	2,771,461,625.32

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

郭树强

薄贺龙

薄贺龙

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

天弘中证电子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]2154号《关于准予天弘中证电子交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》准予注册,由天弘基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘中证电子交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币1,154,248,000.00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(2020)第0123号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《天弘中证电子交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于2020年02月27日

正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为1,154,306,634.00份基金份额，其中认购资金利息折合58,634.00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，基金托管人为海通证券股份有限公司。

根据《天弘中证电子交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《天弘中证电子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[2020]169号文审核同意，本基金1,154,306,634.00份基金份额于2020年3月20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《天弘中证电子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允许上市的股票)、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)。基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数的成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%；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：中证电子指数收益率。

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，成立了天弘中证电子交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“天弘中证电子ETF联接基金”)。天弘中证电子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。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《天弘中证电子交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以本基金持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2020年02月27日（基金合同生效日）至2020年06月30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2020年06月30日的财务状况以及2020年02月27日（基金合同生效日）至2020年06月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

6.4.4.1 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。本财务报表的实际编制期间为2020年02月27日（基金合同生效日）至2020年06月30日。

6.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

6.4.4.3 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。

6.4.4.4 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。

6.4.4.5 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。

6.4.4.6 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。

6.4.4.7 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。

6.4.4.8 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)。

6.4.4.9 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。

6.4.4.10 费用的确认和计量

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。

6.4.4.11 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。

6.4.4.12 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。

6.4.4.13 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。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖股票、债券的差价收入，股票的股息、红利收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税，买入股票不征收股票交易印花税。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

	2020年06月30日
活期存款	14,661,850.85
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	14,661,850.85

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末2020年06月30日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		2,419,756,217.90	2,761,490,434.10	341,734,216.20
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		2,419,756,217.90	2,761,490,434.10	341,734,216.20

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日
应收活期存款利息	6,845.58
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	757.40
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	603.90
合计	8,206.88

6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日
其他应收款	-
待摊费用	81,877.50
合计	81,877.50

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日
交易所市场应付交易费用	490,071.96
银行间市场应付交易费用	-

合计	490,071.96
----	------------

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
应付证券出借违约金	-
预提费用	46,433.33
其他应付	192,718.13
合计	239,151.46

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2020年02月27日（基金合同生效日）至2020年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	1,154,306,634.00	1,154,306,634.00
本期申购	3,106,000,000.00	3,106,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-1,811,000,000.00	-1,811,000,000.00
本期末	2,449,306,634.00	2,449,306,634.00

注：本基金合同于2020年02月27日生效，基金合同生效日的基金份额总额为1,154,306,634.00份基金份额，其中认购资金利息折合58,634.00份基金份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	80,447,101.54	341,734,216.20	422,181,317.74
本期基金份额交易产生的变动数	90,544.75	-100,116,871.17	-100,026,326.42

其中：基金申购款	-473,193.83	-104,688,525.92	-105,161,719.75
基金赎回款	563,738.58	4,571,654.75	5,135,393.33
本期已分配利润	-	-	-
本期末	80,537,646.29	241,617,345.03	322,154,991.32

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2020年02月27日（基金合同生效日）至2020年06月30日
活期存款利息收入	1,111,784.78
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	26,216.18
其他	18,163.59
合计	1,156,164.55

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期2020年02月27日（基金合同生效日）至2020年06月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	16,877,657.82
股票投资收益——赎回差价收入	56,813,804.25
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	73,691,462.07

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年02月27日（基金合同生效日）至2020年06月30日
卖出股票成交总额	847,264,710.85
减：卖出股票成本总额	830,387,053.03

买卖股票差价收入	16,877,657.82
----------	---------------

6.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年02月27日（基金合同生效日）至2020年06月30日
赎回基金份额对价总额	1,805,864,606.67
减：现金支付赎回款总额	413,871,720.67
减：赎回股票成本总额	1,335,179,081.75
赎回差价收入	56,813,804.25

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期未取得债券投资收益。

6.4.7.13.2 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。

6.4.7.14 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期未取得买卖权证差价收入。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期未取得其他衍生工具投资收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年02月27日（基金合同生效日）至2020年06月30日
股票投资产生的股利收益	13,513,641.79
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	13,513,641.79
----	---------------

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年02月27日（基金合同生效日）至2020年06月30日
1. 交易性金融资产	341,734,216.20
——股票投资	341,734,216.20
——债券投资	—
——资产支持证券投资	—
——基金投资	—
——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	341,734,216.20

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年02月27日（基金合同生效日）至2020年06月30日
基金赎回费收入	—
ETF基金替代损益	-707,551.73
合计	-707,551.73

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2020年02月27日（基金合同生效日）至2020年06月30日
交易所市场交易费用	2,109,587.18
银行间市场交易费用	—
合计	2,109,587.18

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年02月27日（基金合同生效日）至2020年06月30日
审计费用	32,362.50
信息披露费	—
证券出借违约金	—
汇划手续费	6,447.17
指数使用费	237,529.80
IOPV计算发布费	14,070.83
ETF登记结算费	55,622.50
其他费用	400.00
合计	346,432.80

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
天弘基金管理有限公司	基金管理人

海通证券股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
天弘中证电子交易型开放式指数证券投资基金联接基金	本基金的联接基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年02月27日（基金合同生效日）至2020年06月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
海通证券股份有限公司	3,154,416,540.87	100.00%

6.4.10.1.2 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。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年02月27日（基金合同生效日）至2020年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
海通证券股份有限公司	966,503.68	100.00%	490,071.96	100.00%

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

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2020年02月27日（基金合同生效日）至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	3,958,829.30
其中：支付销售机构的客户维护费	-

注：1、支付基金管理人的管理人报酬按前一日基金资产净值0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×该日适用费率/当年天数。

2、客户维护费是指基金管理人与基金销售机构在基金销售协议中约定的依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2020年02月27日（基金合同生效日）至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	791,765.86

注：支付基金托管人海通证券股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值×该日适用费率/当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期末与关联方进行过银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期末未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

份额单位：份

关联方名称	本期末 2020年06月30日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占 基金总份额的比例
天弘中证电子交易型开放式指数证券投资基金联接基金	1,883,291,036.00	76.89%

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

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年02月27日（基金合同生效日）至2020年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
海通证券股份有限公司	14,661,850.85	1,111,784.78

注：本基金的银行存款由基金托管人海通证券股份有限公司保管，存放在具有基金托管资格的银行，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2020年02月27日（基金合同生效日）至2020年06月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单	总金额

				位：张/股)	
海通证券股份有限公司	688505	复旦张江	网下申购	22,688	203,057.60
海通证券股份有限公司	300847	中船汉光	网下申购	1,421	9,861.74

6.4.10.8 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。

6.4.11 利润分配情况——按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

本基金本报告期无利润分配事项。

6.4.12 期末（2020年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
688558	N国盛	2020-06-19	2020-12-30	科创板打新限售	17.37	35.26	8,488	147,436.56	299,286.88	-
688568	中科星图	2020-06-30	2020-07-08	新股未上市	16.21	16.21	11,020	178,634.20	178,634.20	-
688377	迪威尔	2020-06-29	2020-07-08	新股未上市	16.42	16.42	7,894	129,619.48	129,619.48	-
688277	天智航	2020-06-24	2020-07-07	新股未上市	12.04	12.04	8,810	106,072.40	106,072.40	-
688027	国盾量子	2020-06-30	2020-07-09	新股未上市	36.18	36.18	2,830	102,389.40	102,389.40	-

688600	皖仪科技	2020-06-23	2020-07-03	新股未上市	15.50	15.50	5,468	84,754.00	84,754.00	-
300847	中船汉光	2020-06-29	2020-07-09	新股未上市	6.94	6.94	1,421	9,861.74	9,861.74	-
300845	捷安高科	2020-06-24	2020-07-03	新股未上市	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	-
300843	胜蓝股份	2020-06-23	2020-07-02	新股未上市	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-
300840	酷特智能	2020-06-30	2020-07-08	新股未上市	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	-
300846	首都在线	2020-06-22	2020-07-01	新股未上市	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-

注：根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起6个月。

6.4.12.2 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。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2020年06月30日，本基金未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2020年06月30日，本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

本基金的基金管理人奉行全面风险管理理念，建立了以审计与风险控制委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、内控合规部、风险管理部、内审部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。在全面风险管理体系的框架下，董事会负责监督检查公司的合法合规运营、内部控制、风险管理，从而控制公司的整体运营风险。在董事会下设立审计与风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理委员会，主要负责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。

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合同责任，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海通证券股份有限公司开立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。

债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本期末未持有短期信用评级的债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本期末未持有短期信用评级的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本期末未持有短期信用评级的同业存单。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本期末未持有长期信用评级的债券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本期末未持有长期信用评级的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本期末未持有长期信用评级的同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

于2020年06月30日,本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息,可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息,因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理,通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期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6.4.12。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。

6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险,包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2020年06月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	14,661,850.85	-	-	-	14,661,850.85
结算备付金	1,697,393.88	-	-	-	1,697,393.88
存出保证金	1,341,984.06	-	-	-	1,341,984.06
交易性金融资产	-	-	-	2,761,490,434.10	2,761,490,434.10
应收证券清算款	-	-	-	5,603,009.46	5,603,009.46
应收利息	-	-	-	8,206.88	8,206.88
其他资产	-	-	-	81,877.50	81,877.50
资产总计	17,701,228.79	-	-	2,767,183,527.94	2,784,884,756.73
负债					
应付证券清算款	-	-	-	11,440,235.09	11,440,235.09
应付管理人报酬	-	-	-	1,044,727.42	1,044,727.42
应付托管费	-	-	-	208,945.48	208,945.48
应付交易费用	-	-	-	490,071.96	490,071.96
其他负债	-	-	-	239,151.46	239,151.46
负债总计	-	-	-	13,423,131.41	13,423,131.41
利率敏感度缺口	17,701,228.79	-	-	2,753,760,396.53	2,771,461,625.32

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2020年06月30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。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金原则上采用完全复制法，跟踪中证电子指数，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。此外,本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控,定期运用多种定量方法对基金进行风险度量来测试本基金面临的潜在价格风险,及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位:人民币元

项目	本期末 2020年06月30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	2,761,490,434.10	99.64
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	2,761,490,434.10	99.64

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币元)
		本期末 2020年06月30日
	业绩比较基准上升5%	196,164,019.31
	业绩比较基准下降5%	-196,164,019.31

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2020年06月30日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为 2,760,553,162.02元，属于第二层次的余额为 937,272.08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2020年06月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	2,761,490,434.10	99.16

	其中：股票	2,761,490,434.10	99.16
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	16,359,244.73	0.59
8	其他各项资产	7,035,077.90	0.25
9	合计	2,784,884,756.73	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,750,173,099.48	99.23
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	10,229,094.00	0.37
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	2,760,402,193.48	99.60

7.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	884,742.53	0.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,766.32	0.00
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	190,731.77	0.01
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	-	-

0	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	1,088,240.62	0.04

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

7.3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002475	立讯精密	5,249,008	269,536,560.80	9.73
2	000725	京东方A	33,924,600	158,427,882.00	5.72
3	002415	海康威视	4,680,587	142,055,815.45	5.13
4	000100	TCL科技	16,940,300	105,029,860.00	3.79
5	603986	兆易创新	413,683	97,591,956.53	3.52
6	002241	歌尔股份	2,845,655	83,548,430.80	3.01
7	600703	三安光电	3,065,835	76,645,875.00	2.77
8	002371	北方华创	309,100	52,828,281.00	1.91
9	603160	汇顶科技	228,600	50,954,940.00	1.84
10	603019	中科曙光	1,303,460	50,052,864.00	1.81
11	000977	浪潮信息	1,262,652	49,470,705.36	1.79
12	300433	蓝思科技	1,647,800	46,204,312.00	1.67
13	600584	长电科技	1,405,800	43,959,366.00	1.59
14	603501	韦尔股份	216,700	43,762,565.00	1.58
15	002456	欧菲光	2,363,200	43,459,248.00	1.57
16	002236	大华股份	2,255,700	43,331,997.00	1.56

17	002384	东山精密	1, 409, 100	42, 202, 545. 00	1. 52
18	600183	生益科技	1, 425, 638	41, 728, 424. 26	1. 51
19	002049	紫光国微	531, 500	38, 666, 625. 00	1. 40
20	002008	大族激光	1, 067, 711	38, 384, 210. 45	1. 38
21	002463	沪电股份	1, 511, 400	37, 754, 772. 00	1. 36
22	002185	华天科技	2, 744, 335	37, 130, 852. 55	1. 34
23	002600	领益智造	3, 416, 600	36, 318, 458. 00	1. 31
24	300408	三环集团	1, 304, 700	36, 140, 190. 00	1. 30
25	300661	圣邦股份	118, 450	36, 133, 172. 50	1. 30
26	300088	长信科技	3, 057, 200	34, 240, 640. 00	1. 24
27	002841	视源股份	327, 226	32, 565, 531. 52	1. 18
28	002916	深南电路	179, 188	30, 017, 573. 76	1. 08
29	000066	中国长城	2, 200, 000	29, 040, 000. 00	1. 05
30	002179	中航光电	689, 900	28, 292, 799. 00	1. 02
31	300782	卓胜微	66, 780	27, 097, 320. 60	0. 98
32	002180	纳思达	798, 100	26, 265, 471. 00	0. 95
33	000636	风华高科	898, 500	26, 227, 215. 00	0. 95
34	002273	水晶光电	1, 524, 000	26, 121, 360. 00	0. 94
35	000988	华工科技	1, 006, 900	24, 598, 567. 00	0. 89
36	600271	航天信息	1, 400, 400	22, 742, 496. 00	0. 82
37	300308	中际旭创	355, 880	22, 420, 440. 00	0. 81
38	002156	通富微电	868, 315	21, 751, 290. 75	0. 78
39	600100	同方股份	2, 968, 800	21, 642, 552. 00	0. 78
40	002138	顺络电子	806, 800	20, 129, 660. 00	0. 73
41	000021	深科技	922, 000	20, 127, 260. 00	0. 73
42	000050	深天马 A	1, 281, 508	19, 683, 962. 88	0. 71
43	002152	广电运通	1, 507, 700	19, 509, 638. 00	0. 70
44	002436	兴森科技	1, 490, 300	19, 120, 549. 00	0. 69
45	603005	晶方科技	241, 620	19, 005, 829. 20	0. 69
46	600667	太极实业	1, 581, 100	18, 688, 602. 00	0. 67
47	002402	和而泰	1, 145, 800	18, 573, 418. 00	0. 67

48	300502	新易盛	289,740	18,288,388.80	0.66
49	601231	环旭电子	818,500	17,876,040.00	0.65
50	002690	美亚光电	337,500	17,752,500.00	0.64
51	300223	北京君正	170,323	17,192,403.62	0.62
52	002938	鹏鼎控股	317,500	15,894,050.00	0.57
53	300115	长盈精密	684,700	15,645,395.00	0.56
54	000413	东旭光电	5,498,800	14,681,796.00	0.53
55	002387	维信诺	1,027,100	14,666,988.00	0.53
56	600460	士兰微	985,600	14,468,608.00	0.52
57	300476	胜宏科技	584,129	14,048,302.45	0.51
58	300296	利亚德	2,229,600	13,533,672.00	0.49
59	600839	四川长虹	4,624,800	13,273,176.00	0.48
60	300747	锐科激光	121,900	13,266,377.00	0.48
61	300567	精测电子	185,500	12,660,375.00	0.46
62	002217	合力泰	2,345,000	12,311,250.00	0.44
63	600171	上海贝岭	705,900	12,268,542.00	0.44
64	600060	海信视像	983,114	11,944,835.10	0.43
65	300078	思创医惠	872,400	11,803,572.00	0.43
66	002036	联创电子	931,300	11,641,250.00	0.42
67	603228	景旺电子	318,960	11,224,202.40	0.40
68	002429	兆驰股份	2,266,800	11,220,660.00	0.40
69	300458	全志科技	289,100	10,638,880.00	0.38
70	600563	法拉电子	170,140	10,514,652.00	0.38
71	000970	中科三环	1,065,882	10,424,325.96	0.38
72	600206	有研新材	742,100	10,367,137.00	0.37
73	300324	旋极信息	1,535,900	10,229,094.00	0.37
74	000733	振华科技	451,900	10,163,231.00	0.37
75	002925	盈趣科技	172,900	10,017,826.00	0.36
76	300666	江丰电子	167,800	10,014,304.00	0.36
77	002635	安洁科技	398,800	9,930,120.00	0.36
78	300373	扬杰科技	295,100	9,891,752.00	0.36

79	002745	木林森	640,900	9,876,269.00	0.36
80	603678	火炬电子	338,900	9,495,978.00	0.34
81	000016	深康佳 A	1,400,500	9,467,380.00	0.34
82	300572	安车检测	146,800	9,329,140.00	0.34
83	002815	崇达技术	443,400	8,969,982.00	0.32
84	300456	赛微电子	320,700	8,857,734.00	0.32
85	000810	创维数字	666,800	8,054,944.00	0.29
86	002859	洁美科技	257,380	7,716,252.40	0.28
87	300735	光弘科技	389,320	7,182,954.00	0.26
88	600562	国睿科技	467,900	6,934,278.00	0.25
89	300602	飞荣达	190,884	6,264,812.88	0.23
90	300232	洲明科技	738,394	5,973,607.46	0.22
91	300679	电连技术	176,700	5,650,866.00	0.20
92	603328	依顿电子	500,000	5,215,000.00	0.19
93	603068	博通集成	51,400	4,141,812.00	0.15
94	600707	彩虹股份	899,600	4,102,176.00	0.15
95	603267	鸿远电子	85,820	3,711,715.00	0.13
96	603508	思维列控	101,100	3,401,004.00	0.12
97	300776	帝尔激光	39,200	3,284,176.00	0.12
98	002955	鸿合科技	87,830	2,670,032.00	0.10
99	603327	福蓉科技	64,500	1,666,035.00	0.06
100	603256	宏和科技	122,400	1,400,256.00	0.05

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688558	N国盛	8,488	299,286.88	0.01
2	688568	中科星图	11,020	178,634.20	0.01
3	688377	迪威尔	7,894	129,619.48	0.00
4	603087	甘李药业	1,076	107,922.80	0.00
5	688277	天智航	8,810	106,072.40	0.00

6	688027	国盾量子	2,830	102,389.40	0.00
7	688600	皖仪科技	5,468	84,754.00	0.00
8	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.00
9	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.00
10	300839	N博汇	502	11,751.82	0.00
11	300847	中船汉光	1,421	9,861.74	0.00
12	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
13	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
14	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
15	300846	首都在线	1,131	3,811.47	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值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	603986	兆易创新	145,148,387.92	5.24
2	600703	三安光电	137,064,698.27	4.95
3	603160	汇顶科技	124,143,293.46	4.48
4	002475	立讯精密	92,020,707.91	3.32
5	600183	生益科技	81,446,828.92	2.94
6	603019	中科曙光	79,431,332.08	2.87
7	000725	京东方 A	78,466,676.00	2.83
8	002415	海康威视	76,393,508.24	2.76
9	600584	长电科技	65,700,329.88	2.37
10	600271	航天信息	52,363,047.83	1.89
11	000100	TCL科技	47,649,657.90	1.72
12	600100	同方股份	45,889,293.50	1.66
13	603501	韦尔股份	45,469,181.08	1.64
14	300782	卓胜微	34,989,101.54	1.26
15	300661	圣邦股份	31,965,832.83	1.15

16	600667	太极实业	30,289,521.36	1.09
17	600460	士兰微	30,096,656.89	1.09
18	002371	北方华创	29,140,809.74	1.05
19	000977	浪潮信息	28,770,945.75	1.04
20	601231	环旭电子	28,475,606.76	1.03

注：本项的“买入金额”均按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值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	600703	三安光电	65,383,603.85	2.36
2	603160	汇顶科技	64,889,528.04	2.34
3	603986	兆易创新	62,964,044.08	2.27
4	600183	生益科技	39,500,735.30	1.43
5	603019	中科曙光	34,403,542.71	1.24
6	600584	长电科技	33,672,832.87	1.21
7	300661	圣邦股份	31,775,627.52	1.15
8	002475	立讯精密	23,341,912.14	0.84
9	600271	航天信息	21,675,508.69	0.78
10	002414	高德红外	20,606,154.99	0.74
11	600100	同方股份	19,978,729.05	0.72
12	300782	卓胜微	17,814,713.00	0.64
13	600563	法拉电子	14,360,635.88	0.52
14	601231	环旭电子	13,790,581.25	0.50
15	600460	士兰微	13,576,572.40	0.49
16	603068	博通集成	13,267,968.00	0.48
17	603228	景旺电子	12,617,355.86	0.46
18	002415	海康威视	11,870,678.84	0.43
19	600839	四川长虹	11,734,260.00	0.42

20	002371	北方华创	11,423,434.47	0.41
----	--------	------	---------------	------

注：本项的“卖出金额”均按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,311,895,235.99
卖出股票收入（成交）总额	847,264,710.85

注：本项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本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。

7.12.2 基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,341,984.06
2	应收证券清算款	5,603,009.46
3	应收股利	-
4	应收利息	8,206.88
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	81,877.50
8	其他	-
9	合计	7,035,077.90

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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	688558	N国盛	299,286.88	0.01	科创板打新限售
2	688568	中科星图	178,634.20	0.01	新股未上市
3	688377	迪威尔	129,619.48	0.00	新股未上市
4	688277	天智航	106,072.40	0.00	新股未上市

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人 户数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		联接基金	
		持有份额	占总份 额比例	持有份额	占总 份额 比例	持有份额	占总 份额 比例
15,570	157,309.35	2,016,845,124.00	82.34%	432,461,510.00	17.66%	1,883,291,036.00	76.89%

8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总 份额比例 (%)
1	海通证券股份有限公司一天弘中证电子交易型开放式指数证券投资基金联接基金	1,883,291,036.00	76.89
2	华泰证券股份有限公司融券专用证券账户	38,118,202.00	1.56
3	中国平安人寿保险股份有限公司—投连—发展投资账户	20,000,000.00	0.82
4	招商证券股份有限公司	16,440,884.00	0.67
5	中信证券股份有限公司	11,778,504.00	0.48
6	方正证券股份有限公司	9,807,938.00	0.40
7	文登市森鹿制革有限公司	8,500,000.00	0.35
8	中信建投证券股份有限公司	6,304,667.00	0.26
9	国信证券股份有限公司	4,484,919.00	0.18
10	邱菊华	4,000,152.00	0.16

注：持有人为场内持有人。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和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

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2020年02月27日)基金份额总额	1,154,306,634.00
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	3,106,000,000.00
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	1,811,000,000.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,449,306,634.00

注：本基金合同于2020年02月27日生效。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，经天弘基金管理有限公司股东会2020年第2次会议审议通过，黄浩先生担任公司董事，祖国明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。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略没有改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生变化。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人、托管人及其高级管理人员没有发生受稽查或处罚的情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
长江证券	1	—	—	—	—	—
海通证券	6	3,155,277,943.11	100.00%	966,503.68	100.00%	—
华创证券	1	—	—	—	—	—
西藏东方财富证券	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：1个，其中包括海通证券深圳交易单元1个。

4、本基金报告期内停止租用交易单元：无。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	天弘中证电子交易型开放式指数	中国证监会指定媒介	2020-02-07

	证券投资基金基金份额发售公告		
2	天弘中证电子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	2020-02-07
3	天弘中证电子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	2020-02-07
4	天弘中证电子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	2020-02-07
5	天弘中证电子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	2020-02-10
6	天弘基金管理有限公司关于天弘中证电子交易型开放式指数证券投资基金提前结束募集的公告	中国证监会指定媒介	2020-02-15
7	天弘中证电子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	2020-02-28
8	天弘基金管理有限公司关于天弘中证电子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	2020-03-17
9	天弘中证电子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	2020-03-17
10	天弘基金管理有限公司关于天弘中证电子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	2020-03-20
11	天弘基金管理有限公司关于天弘中证电子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	2020-03-20
12	天弘基金管理有限公司关于天弘中证电子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	2020-03-20
13	天弘基金管理有限公司关于推迟披露旗下公募基金2019年年度报	中国证监会指定媒介	2020-03-25

	告的公告		
14	天弘基金管理有限公司关于调整网上直销交易系统通联支付渠道费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2020-04-02
15	天弘基金管理有限公司关于提醒客户及时提供或更新身份信息资料的公告	中国证监会指定媒介	2020-04-04
16	天弘基金管理有限公司关于终止泰诚财富基金销售（大连）有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定媒介	2020-04-04
17	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会指定媒介	2020-06-12
18	天弘基金管理有限公司关于天弘中证电子交易型开放式指数证券投资基金调整最小申购赎回单位的公告	中国证监会指定媒介	2020-06-15
19	天弘中证电子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	2020-06-15
20	天弘中证电子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	2020-06-15

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
联接基金	1	20200320-20200630	0.00	2,814,540,636.00	931,249,600.00	1,883,291,036.00	76.89%
产品特有风险							
基金管理人秉承谨慎勤勉、独立决策、规范运作、充分披露原则，公平对待投资							

者，保障投资者合法权益。当单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%时，由此可能导致的特有风险主要包括：

（1）超出基金管理人允许的单一投资者持有基金份额比例的申购申请不被确认的风险；

（2）极端市场环境下投资者集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对赎回申请的风险；

（3）持有基金份额占比较高的投资者大额赎回可能引发基金净值大幅波动的风险；

（4）持有基金份额占比较高的投资者在召开基金份额持有人大会并对重大事项进行投票表决时，可能拥有较大话语权；

（5）极端情况下，持有基金份额占比较高的投资者大量赎回后，可能出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元而面临的转换基金运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等风险。

注：申购份额包括申购或者买入基金份额，赎回份额包括赎回或者卖出基金份额。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，基金管理人根据法律法规及《基金合同》相关规定，决定自 2020年6月16日起调整天弘中证电子交易型开放式指数证券投资基金的最小申购赎回单位并相应更新了《招募说明书》。具体信息请参见基金管理人在指定媒介披露的《天弘基金管理有限公司关于天弘中证电子交易型开放式指数证券投资基金调整最小申购赎回单位的公告》。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准天弘中证电子交易型开放式指数证券投资基金募集的文件
- 2、天弘中证电子交易型开放式指数证券投资基金基金合同
- 3、天弘中证电子交易型开放式指数证券投资基金托管协议
- 4、天弘中证电子交易型开放式指数证券投资基金招募说明书
- 5、报告期内在指定报刊上披露的各项公告
- 6、中国证监会规定的其他文件

12.2 存放地点

天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层

12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公场所及网站或基金托管人的办公场所免费查阅备查文件，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

公司网站：www.thfund.com.cn

天弘基金管理有限公司
二〇二〇年八月三十一日