

# 天弘沪深 300 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:招商证券股份有限公司

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。

基金托管人招商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01月01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.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
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.....	14
§5 托管人报告.....	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见.....	14
§6 中期财务会计报告(未经审计).....	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益(基金净值)变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18
§7 投资组合报告.....	65
7.1 期末基金资产组合情况.....	66
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	66
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.....	68
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	79
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	81
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.....	81
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	81
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	81
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	81
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	81
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	82
7.12 投资组合报告附注.....	82
§8 基金份额持有人信息.....	84
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	84
8.2 期末上市基金前十名持有人.....	84

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	85
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.....	85
§9 开放式基金份额变动.....	85
§10 重大事件揭示.....	85
10.1 基金份额持有人大会决议.....	86
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.....	86
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	86
10.4 基金投资策略的改变.....	86
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	86
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.....	86
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	86
10.8 其他重大事件.....	87
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	89
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.....	89
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	90
§12 备查文件目录.....	90
12.1 备查文件目录.....	90
12.2 存放地点.....	90
12.3 查阅方式.....	90

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	天弘300
场内简称	天弘300
基金主代码	515330
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2019年12月05日
基金管理人	天弘基金管理有限公司
基金托管人	招商证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	5,552,709,496.00份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2019-12-26

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金力争将日均跟踪偏离度控制在0.2%以内，年化跟踪误差控制在2%以内。
投资策略	本基金主要采取完全复制策略，即按照标的指数的成份股构成及其权重构建基金股票投资组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应调整。当预期成份股发生调整和成份股发生配股、增发、分红等行为时，或因基金的申购和赎回等对本基金跟踪标的指数的效果可能带来影响时，或因某些特殊情况（如流动性不足、成份股长期停牌、法律法规限制等）导致流动性不足时，或其他原因导致无法有效复制和跟踪标的指数时，基金管理人可以对投资组合管理进行适当变通和调整，从而使得投资组合紧密地跟踪标的指数。
业绩比较基准	沪深300指数收益率
风险收益特征	本基金属股票型基金，预期风险与预期收益高于混合

	型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。
--	---

### 2.3 基金管理人和基金托管人

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

### 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	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01月01日- 2020年06月30日）
本期已实现收益	77,194,882.23
本期利润	318,400,132.69
加权平均基金份额本期利润	0.0552
本期加权平均净值利润率	5.59%
本期基金份额净值增长率	2.51%
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	23,757,540.52
期末可供分配基金份额利润	0.0043
期末基金资产净值	5,854,687,564.49
期末基金份额净值	1.0544
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	5.44%

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	8.33%	0.90%	7.68%	0.90%	0.65%	0.00%

过去三个月	13.98%	0.90%	12.96%	0.90%	1.02%	0.00%
过去六个月	2.51%	1.52%	1.64%	1.52%	0.87%	0.00%
自基金合同生效日起至 今	5.44%	1.42%	8.16%	1.44%	-2.72%	-0.02%

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



注：1、本基金合同于2019年12月05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12月05日至2020年06月04日，建仓期结束时及至报告期末，各项资产配置比例均符合基金合同的约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

天弘基金管理有限公司（以下简称“公司”或“本基金管理人”）经中国证监会证监基金字[2004]164号文批准，于2004年11月8日正式成立。注册资本金为5.143亿元人民币，总部设在天津，在北京、上海、广州、天津、深圳、四川设有分公司。公司股权结构为：

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

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。	2019年12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。
张子法	本基金基金经理。	2019年12月	-	13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。
陈瑶	本基金基金经理。	2019年12月	-	9年	女，金融学硕士。2011年7月加盟本公司，历任交易员、交易主管，从事交易管理，程序化交易策略、基差交易策略、融资融券交易策略等研究工作。

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

报告期内本基金秉承合规第一、风控第一的原则,在运作过程中严格遵守基金合同,对指数基金采取被动复制的方式跟踪指数,完全复制标的指数,保证基金净值增长率与基准指数间的高度正相关和跟踪误差最小化。

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

报告期内,本基金跟踪误差的来源主要是申购赎回、打新、成分股调整导致的权重偏离因素。当由于申赎等情况可能对指数跟踪效果带来影响时,本基金坚持既定的指数化投资策略,对指数基金采取被动复制与组合优化相结合的方式跟踪指数,同时紧密跟踪成分股的股息事件,及时有效处理,避免权重偏离造成跟踪误差的扩大。报告期内,本基金整体运行平稳。

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2020年06月30日,本基金份额净值为1.0544元,本报告期份额净值增长率2.51%,同期业绩比较基准增长率1.64%。

### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年疫情对国内经济造成了巨大的冲击,包括疫情海外扩散以及原油价格下跌,引发对通缩和外需下滑的担忧,导致投资者对宏观经济较为悲观。今年1到2月份为了抗击疫情停工停产,我们用短时间的停工停产为抗击疫情争取了宝贵的时间,在疫情得到

控制的情况下，三月份以来复工复产持续推进。近几个月的经济数据也出现了持续的环比改善。二季度，我国GDP同比增长3.2%，如期转正，并且幅度还是比较超预期的。出口方面，我们看到2020年6月出口同比增长了0.5%，进口同比增长了2.7%，这主要是由于欧美复工推动了进出口的好转，后续外需向上趋势确立。6月份的CPI是2.5%，下半年CPI受到去年猪价高基数的制约，基本上不会成为今年经济和货币政策的一个主要关注点。PPI的环比拐点已经出现了，6月PPI环比转正，PPI和周期品的价格有较高的相关性，从趋势上看，我们预计PPI下半年同比数据会有一个确定性的回升。6月社融和信贷增速继续提升，居民贷款边际修复明显，企业中长期融资继续向好，社融和贷款增长趋势也表明了政策是鼓励金融资源去支持实体经济的。总体上看，我们看好宏观经济的持续修复。

利率方面，当前整体的利率还是处于比较低的一个水平，随着理财产品净值化的趋势推进，对于净值型理财产品，就存在去寻求预期收益率更高的配置需求。另外相比国外的利率水平，中美利差仍保持较高水平，对于外资而言，当经济活动趋于平稳，中国较高的利率水平将吸引更多的外资流入。因此我们看好宏观经济修复背景下A股的表现。

#### 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

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

#### 4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内本基金管理人无应说明预警信息。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，招商证券股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

#### 5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

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

#### 5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

### § 6 中期财务会计报告(未经审计)

#### 6.1 资产负债表

会计主体：天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金

报告截止日：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	上年度末 2019年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	29,215,243.01	90,254,421.00
结算备付金		7,584,922.01	9,562,187.68

存出保证金		5,208,422.57	2,463,000.00
交易性金融资产	6.4.7.2	5,826,999,412.70	4,332,238,902.60
其中：股票投资		5,826,999,412.70	4,332,238,902.60
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		13,130,827.39	-
应收利息	6.4.7.5	100,881.17	58,482.50
应收股利		102,203.19	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	75,409.88	28,144.32
资产总计		5,882,417,321.92	4,434,605,138.10
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2020年06月30日</b>	<b>上年度末 2019年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		23,389,526.05	73,307,677.13
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		2,536,084.99	328,747.58
应付托管费		507,216.99	65,749.51
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	6.4.7.7	687,982.79	800,102.40
应交税费		3,174.69	-

应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	605,771.92	24,116.76
负债合计		27,729,757.43	74,526,393.38
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	5,552,709,496.00	4,238,709,496.00
未分配利润	6.4.7.10	301,978,068.49	121,369,248.72
所有者权益合计		5,854,687,564.49	4,360,078,744.72
负债和所有者权益总计		5,882,417,321.92	4,434,605,138.10

注：1. 报告截止日2020年06月30日，基金份额净值1.0544元，基金份额总额5,552,709,496.00份。

2. 本基金的合同生效日为2019年12月05日，无上一年度可比期间(下同)。

## 6.2 利润表

会计主体：天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020年01月01日至2020年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2020年01月01日至2020年06月30日
<b>一、收入</b>		339,256,639.00
1. 利息收入		395,160.15
其中：存款利息收入	6.4.7.11	300,676.77
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		94,483.38
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		96,612,421.17
其中：股票投资收益	6.4.7.12	31,828,580.31
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	-293,123.88
股利收益	6.4.7.15	65,076,964.74
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	241,205,250.46
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	1,043,807.22
<b>减：二、费用</b>		20,856,506.31
1. 管理人报酬		14,103,466.25
2. 托管费		2,820,693.31
3. 销售服务费		-
4. 交易费用	6.4.7.18	2,852,965.19
5. 利息支出		-
其中：卖出回购金融资产支出		-
6. 税金及附加		3,352.62
7. 其他费用	6.4.7.19	1,076,028.94
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		318,400,132.69
减：所得税费用		-
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		318,400,132.69

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金

本报告期：2020年01月01日至2020年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益	4,238,709,496.00	121,369,248.72	4,360,078,744.72

(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)	-	318,400,132.69	318,400,132.69
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	1,314,000,000.00	-137,791,312.92	1,176,208,687.08
其中:1.基金申购款	3,150,000,000.00	-113,870,022.74	3,036,129,977.26
2.基金赎回款	-1,836,000,000.00	-23,921,290.18	-1,859,921,290.18
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	5,552,709,496.00	301,978,068.49	5,854,687,564.49

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

郭树强

薄贺龙

薄贺龙

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2019]1044号《关于准予天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》准予注册,由天弘基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币236,708,830.00元(含募集股票市值),业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2019)第0653号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金合同》

于2019年12月5日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为236,709,496.00份基金份额，其中认购资金利息折合666.00份基金份额。本基金的基金管理人为天弘基金管理有限公司，基金托管人为招商证券股份有限公司。

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金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、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)。基金的投资组合比例为：本基金投资于标的指数的成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%，且不低于非现金基金资产的80%；每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金；股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为：沪深300指数收益率。

本基金的基金管理人天弘基金管理有限公司以本基金为目标ETF，成立了天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金(以下简称“天弘沪深300ETF联接基金”)。天弘沪深300ETF联接基金为交易型开放式基金，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》、《天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以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年度上半年财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2020年06月30日的财务状况以及2020年度上半年的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

### 6.4.4 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。

#### 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。

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

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### 6.4.4.10 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	29,215,243.01
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	29,215,243.01

##### 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	5,513,569,281.11	5,826,999,412.70	313,430,131.59
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	5,513,569,281.11	5,826,999,412.70	313,430,131.59

## 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末2020年06月30日			备注
	合同/名义金额	公允价值		
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	23,507,400.00	-	-	-
其中：股指期货投资	23,507,400.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	23,507,400.00	-	-	-

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为0。

于2020年06月30日，本基金持有的股指期货合约情况如下：

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动	风险说明
IF2007	IF2007	20	24,708,000.00	1,200,600.00	-
公允价值变动总额合计（元）					1,200,600.00
股指期货投资本期收益（元）					-293,123.88
股指期货投资本期公允价值变动（元）					674,820.00

注：买入持仓量以正数表示，卖出持仓量以负数表示。

## 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	15,033.39
应收定期存款利息	-
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	2,159.22
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	82,456.66
其他	1,231.90
合计	100,881.17

**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	75,409.88
合计	75,409.88

**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	687,982.79
银行间市场应付交易费用	-
合计	687,982.79

## 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	131,478.47
应付指数使用费	474,293.45
合计	605,771.92

## 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2020年01月01日至2020年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	4,238,709,496.00	4,238,709,496.00
本期申购	3,150,000,000.00	3,150,000,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-1,836,000,000.00	-1,836,000,000.00
本期末	5,552,709,496.00	5,552,709,496.00

## 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-34,840,021.74	156,209,270.46	121,369,248.72
本期利润	77,194,882.23	241,205,250.46	318,400,132.69
本期基金份额交易产生的变动数	-18,597,319.97	-119,193,992.95	-137,791,312.92
其中：基金申购款	-26,240,226.66	-87,629,796.08	-113,870,022.74

基金赎回款	7,642,906.69	-31,564,196.87	-23,921,290.18
本期已分配利润	-	-	-
本期末	23,757,540.52	278,220,527.97	301,978,068.49

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2020年01月01日至2020年06月30日
活期存款利息收入	218,798.47
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	66,397.24
其他	15,481.06
合计	300,676.77

#### 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01月01日至2020年06月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	44,311,684.26
股票投资收益——赎回差价收入	-12,483,103.95
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	31,828,580.31

##### 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01月01日至2020年06月30日
卖出股票成交总额	1,325,661,085.34
减：卖出股票成本总额	1,281,349,401.08
买卖股票差价收入	44,311,684.26

## 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01月01日至2020年06月30日
赎回基金份额对价总额	1,859,921,290.18
减：现金支付赎回款总额	659,144,946.18
减：赎回股票成本总额	1,213,259,447.95
赎回差价收入	-12,483,103.95

## 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

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2020年01月01日至2020年06月30日
股指期货投资收益	-293,123.88

## 6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2020年01月01日至2020年06月30日
股票投资产生的股利收益	65,076,964.74
其中：证券出借权益补偿收入	106,944.19
基金投资产生的股利收益	-

合计	65,076,964.74
----	---------------

## 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01月01日至2020年06月30日
1. 交易性金融资产	240,530,430.46
——股票投资	240,530,430.46
——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	674,820.00
——权证投资	-
——期货投资	674,820.00
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	241,205,250.46

## 6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
基金赎回费收入	-
ETF基金替代损益	1,043,807.22
合计	1,043,807.22

## 6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020年01月01日至2020年06月30日
交易所市场交易费用	2,852,965.19
银行间市场交易费用	-
合计	2,852,965.19

#### 6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2020年01月01日至2020年06月30日
审计费用	18,523.96
信息披露费	58,836.57
证券出借违约金	-
指数使用费	846,207.93
IOPV计算发布费	49,726.04
ETF登记结算费	74,590.12
上市费	28,144.32
合计	1,076,028.94

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
天弘基金管理有限公司	基金管理人

招商证券股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金	本基金的联接基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年01月01日至2020年06月30日	
	成交金额	占当期股票成交 总额的比例
招商证券股份有限公司	2,343,155,869.55	76.75%

##### 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01月01日至2020年06月30日			
	当期佣金	占当期 佣金总 量的比 例	期末应付佣金余额	占期末应 付佣金总 额的比例
招商证券股份有限公司	891,982.37	74.45%	446,476.61	64.90%

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。2、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

##### 6.4.10.2 关联方报酬

**6.4.10.2.1 基金管理费**

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	14,103,466.25
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01月01日至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	2,820,693.31

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

**6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易**

本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		上年度末 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	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
招商证券股份有限公司	4,371,433.00	0.08%	6,035,697.00	0.14%
天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金联接基金	5,517,919,200.00	99.37%	4,097,433,100.00	96.67%

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01月01日至2020年06月30日	
	期末余额	当期利息收入

招商证券 股份有限 公司	29,215,243.01	218,798.47
--------------------	---------------	------------

注：本基金的银行存款由基金托管人招商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01月01日至2020年06月30日					
关联 方名 称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位： 张/股）	总金额
招商 证券 股份 有限 公司	688106	金宏气体	网下申购	26,075	403,641.00

#### 6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本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
6883 96	华润 微	2020 -02-	2020 -08-	科创 板打	12.8 0	41.4 5	81,911	1,04 8,46	3,39 5,21	-

		14	27	新限售				0.80	0.95	
688169	石头科技	2020-02-13	2020-08-21	科创板打新限售	271.12	365.14	5,382	1,459,167.84	1,965,183.48	-
688158	优刻得	2020-01-10	2020-07-20	科创板打新限售	33.23	68.38	20,700	687,861.00	1,415,466.00	-
688520	神州细胞	2020-06-11	2020-12-22	科创板打新限售	25.64	58.82	12,351	316,679.64	726,485.82	-
688505	复旦张江	2020-06-10	2020-12-21	科创板打新限售	8.95	24.78	22,688	203,057.60	562,208.64	-
688518	联赢激光	2020-06-12	2020-12-22	科创板打新限售	7.81	20.83	14,111	110,206.91	293,932.13	-
688004	博汇科技	2020-06-05	2020-12-14	科创板打新限售	28.77	71.90	2,500	71,925.00	179,750.00	-
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-	2020-07-	新股未上	12.04	12.04	8,810	106,072.	106,072.	-

		24	07	市				40	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

金额单位：人民币元

合约编号	证券代码	证券名称	成交时间	出借到期日	期末估值单价	数量（股）	期末估值总额
2020061 6000004 90	000709	河钢股份	2020-06 -16	2020- 07-14	2.04	437200	891,888.00
2020061 6000006 14	000860	顺鑫农业	2020-06 -16	2020- 07-14	56.98	16700	951,566.00
2020061 6000006 26	000876	新希望	2020-06 -16	2020- 07-14	29.80	100000	2,980,000.0 0
2020061 6000008 97	600196	复星医药	2020-06 -16	2020- 07-14	33.85	44200	1,496,170.0 0
2020061 6000011 17	601162	天风证券	2020-06 -16	2020- 07-14	6.06	99400	602,364.00
2020061 6000013 83	601857	中国石油	2020-06 -16	2020- 07-14	4.19	17300	72,487.00
2020061 6000024 03	002352	顺丰控股	2020-06 -16	2020- 07-14	54.70	30000	1,641,000.0 0
2020061 6000025 77	002422	科伦药业	2020-06 -16	2020- 07-14	21.00	28900	606,900.00
2020061 6000030	002714	牧原股份	2020-06 -16	2020- 07-14	82.00	20000	1,640,000.0 0

51							
2020061 6000031 52	300014	亿纬锂 能	2020-06 -16	2020- 07-14	47.85	71000	3,397,350.0 0
2020061 7000005 51	000100	TCL科技	2020-06 -17	2020- 07-15	6.20	400000	2,480,000.0 0
2020061 7000013 24	601727	上海电 气	2020-06 -17	2020- 07-01	5.04	147700	744,408.00
2020061 7000017 26	600068	葛洲坝	2020-06 -17	2020- 07-01	5.95	93700	557,515.00
2020061 7000017 69	601162	天风证 券	2020-06 -17	2020- 07-15	6.06	14100	85,446.00
2020061 7000017 99	600516	方大炭 素	2020-06 -17	2020- 07-01	6.28	160000	1,004,800.0 0
2020061 7000021 98	600795	国电电 力	2020-06 -17	2020- 07-01	1.85	416700	770,895.00
2020061 7000022 35	600352	浙江龙 盛	2020-06 -17	2020- 07-01	12.79	58700	750,773.00
2020061 7000025 68	601888	中国中 免	2020-06 -17	2020- 07-01	154.0 3	20000	3,080,600.0 0
2020061 7000026 40	002044	美年健 康	2020-06 -17	2020- 07-15	14.41	40600	585,046.00
2020061 7000026	002044	美年健 康	2020-06 -17	2020- 07-01	14.41	62000	893,420.00

42							
2020061 7000027 61	603799	华友钴业	2020-06 -17	2020- 07-01	38.86	70500	2,739,630.0 0
2020061 7000031 41	002129	中环股份	2020-06 -17	2020- 07-15	22.46	66300	1,489,098.0 0
2020061 7000031 43	002129	中环股份	2020-06 -17	2020- 07-01	22.46	33000	741,180.00
2020061 7000036 92	601066	中信建投	2020-06 -17	2020- 07-01	39.38	11000	433,180.00
2020061 7000038 22	601117	中国化学	2020-06 -17	2020- 07-01	5.48	46300	253,724.00
2020061 7000042 30	600297	广汇汽车	2020-06 -17	2020- 07-01	3.19	232100	740,399.00
2020061 7000044 71	601162	天风证券	2020-06 -17	2020- 07-01	6.06	51000	309,060.00
2020061 7000045 03	600208	新湖中宝	2020-06 -17	2020- 07-01	2.98	18500	55,130.00
2020061 7000045 15	600208	新湖中宝	2020-06 -17	2020- 07-01	2.98	251400	749,172.00
2020061 7000045 82	601881	中国银河	2020-06 -17	2020- 07-15	11.47	36900	423,243.00
2020061 7000046	002352	顺丰控股	2020-06 -17	2020- 07-01	54.70	16500	902,550.00

58							
2020061 7000050 87	002460	赣锋锂 业	2020-06 -17	2020- 07-01	53.57	41600	2,228,512.0 0
2020061 7000053 96	002714	牧原股 份	2020-06 -17	2020- 07-01	82.00	10000	820,000.00
2020061 8000002 00	000876	新 希 望	2020-06 -18	2020- 07-16	29.80	10000	298,000.00
2020061 8000002 30	002007	华兰生 物	2020-06 -18	2020- 07-16	50.11	20000	1,002,200.0 0
2020061 8000002 35	002044	美年健 康	2020-06 -18	2020- 07-16	14.41	29800	429,418.00
2020061 8000002 38	002044	美年健 康	2020-06 -18	2020- 07-02	14.41	83100	1,197,471.0 0
2020061 8000002 42	002044	美年健 康	2020-06 -18	2020- 07-16	14.41	10000	144,100.00
2020061 8000003 16	002241	歌尔股 份	2020-06 -18	2020- 07-16	29.36	231600	6,799,776.0 0
2020061 8000003 70	002475	立讯精 密	2020-06 -18	2020- 07-16	51.35	100000	5,135,000.0 0
2020061 8000004 08	002714	牧原股 份	2020-06 -18	2020- 07-02	82.00	21000	1,722,000.0 0
2020061 8000004	300015	爱尔眼 科	2020-06 -18	2020- 07-16	43.45	22000	955,900.00

43							
2020061 8000005 26	300433	蓝思科 技	2020-06 -18	2020- 07-02	28.04	40000	1,121,600.0 0
2020061 8000005 79	600050	中国联 通	2020-06 -18	2020- 07-16	4.84	41500	200,860.00
2020061 8000006 09	601328	交通银 行	2020-06 -18	2020- 07-02	5.13	11300	57,969.00
2020061 8000006 26	601066	中信建 投	2020-06 -18	2020- 07-16	39.38	28600	1,126,268.0 0
2020061 8000006 54	600050	中国联 通	2020-06 -18	2020- 07-02	4.84	59500	287,980.00
2020061 8000006 90	600795	国电电 力	2020-06 -18	2020- 07-02	1.85	164400	304,140.00
2020061 8000007 05	600011	华能国 际	2020-06 -18	2020- 07-02	4.22	122800	518,216.00
2020061 8000007 39	600690	海尔智 家	2020-06 -18	2020- 07-16	17.70	59600	1,054,920.0 0
2020061 8000008 40	601997	贵阳银 行	2020-06 -18	2020- 07-02	7.16	21300	152,508.00
2020061 8000008 53	600498	烽火通 信	2020-06 -18	2020- 07-16	28.91	34000	982,940.00
2020061 8000008	600196	复星医 药	2020-06 -18	2020- 07-02	33.85	10000	338,500.00

59							
2020061 8000008 77	601601	中国太 保	2020-06 -18	2020- 07-16	27.25	10000	272,500.00
2020061 8000009 12	600297	广汇汽 车	2020-06 -18	2020- 07-02	3.19	181100	577,709.00
2020061 8000009 63	600208	新湖中 宝	2020-06 -18	2020- 07-02	2.98	168600	502,428.00
2020061 8000009 82	601360	三六零	2020-06 -18	2020- 07-16	18.31	53000	970,430.00
2020061 8000010 00	600886	国投电 力	2020-06 -18	2020- 07-02	7.86	65500	514,830.00
2020061 8000010 11	600848	上海临 港	2020-06 -18	2020- 07-16	21.47	46400	996,208.00
2020061 9000001 60	000063	中兴通 讯	2020-06 -19	2020- 07-17	40.13	10000	401,300.00
2020061 9000001 63	000063	中兴通 讯	2020-06 -19	2020- 07-03	40.13	10000	401,300.00
2020061 9000001 89	000100	TCL科技	2020-06 -19	2020- 07-17	6.20	200000	1,240,000.0 0
2020061 9000002 10	000651	格力电 器	2020-06 -19	2020- 07-03	56.57	10500	593,985.00
2020061 9000002	000876	新希 望	2020-06 -19	2020- 07-17	29.80	30000	894,000.00

25							
2020061 9000002 34	000938	紫光股 份	2020-06 -19	2020- 07-03	42.98	60000	2,578,800.0 0
2020061 9000002 37	000977	浪潮信 息	2020-06 -19	2020- 07-03	39.18	60000	2,350,800.0 0
2020061 9000002 62	002044	美年健 康	2020-06 -19	2020- 07-03	14.41	42900	618,189.00
2020061 9000002 64	002044	美年健 康	2020-06 -19	2020- 07-17	14.41	11200	161,392.00
2020061 9000003 67	300059	东方财 富	2020-06 -19	2020- 07-17	20.20	19400	391,880.00
2020061 9000003 76	300059	东方财 富	2020-06 -19	2020- 07-03	20.20	19400	391,880.00
2020061 9000003 95	300144	宋城演 艺	2020-06 -19	2020- 07-17	17.30	55000	951,500.00
2020061 9000004 15	300413	芒果超 媒	2020-06 -19	2020- 07-03	65.20	39000	2,542,800.0 0
2020061 9000004 16	300433	蓝思科 技	2020-06 -19	2020- 07-03	28.04	94000	2,635,760.0 0
2020061 9000004 58	600050	中国联 通	2020-06 -19	2020- 07-17	4.84	34700	167,948.00
2020061 9000004	600848	上海临 港	2020-06 -19	2020- 07-03	21.47	14900	319,903.00

84							
2020061 9000005 03	600050	中国联 通	2020-06 -19	2020- 07-03	4.84	34000	164,560.00
2020061 9000005 13	601888	中国中 免	2020-06 -19	2020- 07-03	154.0 3	10000	1,540,300.0 0
2020061 9000005 23	600516	方大炭 素	2020-06 -19	2020- 07-03	6.28	72700	456,556.00
2020061 9000005 35	601555	东吴证 券	2020-06 -19	2020- 07-03	8.16	54000	440,640.00
2020061 9000005 54	600352	浙江龙 盛	2020-06 -19	2020- 07-03	12.79	22700	290,333.00
2020061 9000005 63	600011	华能国 际	2020-06 -19	2020- 07-03	4.22	68900	290,758.00
2020061 9000005 88	601066	中信建 投	2020-06 -19	2020- 07-03	39.38	12400	488,312.00
2020061 9000006 02	600398	海澜之 家	2020-06 -19	2020- 07-03	5.82	49400	287,508.00
2020061 9000006 17	600498	烽火通 信	2020-06 -19	2020- 07-03	28.91	37900	1,095,689.0 0
2020062 2000003 78	000063	中兴通 讯	2020-06 -22	2020- 07-20	40.13	60000	2,407,800.0 0
2020062 2000003	000063	中兴通 讯	2020-06 -22	2020- 07-06	40.13	140000	5,618,200.0 0

80							
2020062 2000003 81	000063	中兴通 讯	2020-06 -22	2020- 07-06	40.13	10000	401,300.00
2020062 2000004 21	000100	TCL科技	2020-06 -22	2020- 07-20	6.20	200000	1,240,000.0 0
2020062 2000007 20	000651	格力电 器	2020-06 -22	2020- 07-20	56.57	10000	565,700.00
2020062 2000007 27	000651	格力电 器	2020-06 -22	2020- 07-06	56.57	21500	1,216,255.0 0
2020062 2000012 67	001979	招商蛇 口	2020-06 -22	2020- 07-06	16.44	61600	1,012,704.0 0
2020062 2000012 74	001979	招商蛇 口	2020-06 -22	2020- 07-20	16.44	22300	366,612.00
2020062 2000013 97	002050	三花智 控	2020-06 -22	2020- 07-06	21.90	20000	438,000.00
2020062 2000016 36	601985	中国核 电	2020-06 -22	2020- 07-20	4.09	89900	367,691.00
2020062 2000016 85	600011	华能国 际	2020-06 -22	2020- 07-20	4.22	87100	367,562.00
2020062 2000018 75	600588	用友网 络	2020-06 -22	2020- 07-06	44.10	20000	882,000.00
2020062 2000022	600050	中国联 通	2020-06 -22	2020- 07-06	4.84	40400	195,536.00

64							
2020062 2000028 94	600011	华能国际	2020-06 -22	2020- 07-06	4.22	81700	344,774.00
2020062 2000030 99	600010	包钢股份	2020-06 -22	2020- 07-20	1.08	200000	216,000.00
2020062 2000032 22	600000	浦发银行	2020-06 -22	2020- 07-06	10.58	11400	120,612.00
2020062 2000039 06	601788	光大证券	2020-06 -22	2020- 07-06	16.06	162300	2,606,538.00
2020062 2000040 60	002460	赣锋锂业	2020-06 -22	2020- 07-20	53.57	11000	589,270.00
2020062 2000041 90	600398	海澜之家	2020-06 -22	2020- 07-20	5.82	26100	151,902.00
2020062 2000042 13	600398	海澜之家	2020-06 -22	2020- 07-06	5.82	58700	341,634.00
2020062 2000044 65	601601	中国太保	2020-06 -22	2020- 07-20	27.25	45000	1,226,250.00
2020062 2000047 25	601985	中国核电	2020-06 -22	2020- 07-06	4.09	84300	344,787.00
2020062 2000047 44	600233	圆通速递	2020-06 -22	2020- 07-20	14.56	61000	888,160.00
2020062 2000051	603993	洛阳钼业	2020-06 -22	2020- 07-06	3.67	28500	104,595.00

17							
2020062 2000054 24	300059	东方财 富	2020-06 -22	2020- 07-20	20.20	14000	282,800.00
2020062 2000057 38	300413	芒果超 媒	2020-06 -22	2020- 07-06	65.20	32900	2,145,080.0 0
2020062 3000001 78	000066	中国长 城	2020-06 -23	2020- 07-07	13.20	94900	1,252,680.0 0
2020062 3000001 79	000066	中国长 城	2020-06 -23	2020- 07-07	13.20	76700	1,012,440.0 0
2020062 3000001 87	000651	格力电 器	2020-06 -23	2020- 07-21	56.57	10000	565,700.00
2020062 3000001 93	000651	格力电 器	2020-06 -23	2020- 07-07	56.57	21700	1,227,569.0 0
2020062 3000002 19	000876	新 希 望	2020-06 -23	2020- 07-07	29.80	68000	2,026,400.0 0
2020062 3000002 31	000938	紫光股 份	2020-06 -23	2020- 07-21	42.98	23000	988,540.00
2020062 3000002 34	000977	浪潮信 息	2020-06 -23	2020- 07-21	39.18	10000	391,800.00
2020062 3000002 40	001979	招商蛇 口	2020-06 -23	2020- 07-07	16.44	38100	626,364.00
2020062 3000002	001979	招商蛇 口	2020-06 -23	2020- 07-21	16.44	23500	386,340.00

44							
2020062 3000002 45	001979	招商蛇 口	2020-06 -23	2020- 07-07	16.44	65400	1,075,176.0 0
2020062 3000002 52	002007	华兰生 物	2020-06 -23	2020- 07-21	50.11	88200	4,419,702.0 0
2020062 3000002 76	002129	中环股 份	2020-06 -23	2020- 07-07	22.46	92900	2,086,534.0 0
2020062 3000003 29	002939	长城证 券	2020-06 -23	2020- 07-21	12.32	17600	216,832.00
2020062 3000003 46	300015	爱尔眼 科	2020-06 -23	2020- 07-07	43.45	24700	1,073,215.0 0
2020062 3000003 54	300015	爱尔眼 科	2020-06 -23	2020- 07-21	43.45	10000	434,500.00
2020062 3000003 77	300059	东方财 富	2020-06 -23	2020- 07-21	20.20	187900	3,795,580.0 0
2020062 3000003 78	300059	东方财 富	2020-06 -23	2020- 07-21	20.20	21600	436,320.00
2020062 3000003 80	300059	东方财 富	2020-06 -23	2020- 07-07	20.20	71100	1,436,220.0 0
2020062 3000005 54	601985	中国核 电	2020-06 -23	2020- 07-21	4.09	94500	386,505.00
2020062 3000005	600050	中国联 通	2020-06 -23	2020- 07-21	4.84	44200	213,928.00

75							
2020062 3000005 99	600109	国金证 券	2020-06 -23	2020- 07-21	11.41	36400	415,324.00
2020062 3000006 09	600109	国金证 券	2020-06 -23	2020- 07-21	11.41	29100	332,031.00
2020062 3000006 16	600109	国金证 券	2020-06 -23	2020- 07-21	11.41	31200	355,992.00
2020062 3000006 22	600219	南山铝 业	2020-06 -23	2020- 07-07	2.03	500000	1,015,000.0 0
2020062 3000006 58	600703	三安光 电	2020-06 -23	2020- 07-21	25.00	19800	495,000.00
2020062 3000006 74	600655	豫园股 份	2020-06 -23	2020- 07-21	8.86	113000	1,001,180.0 0
2020062 3000006 89	600000	浦发银 行	2020-06 -23	2020- 07-07	10.58	11800	124,844.00
2020062 3000006 91	601788	光大证 券	2020-06 -23	2020- 07-07	16.06	24900	399,894.00
2020062 3000007 07	601828	美凯龙	2020-06 -23	2020- 07-07	10.59	35000	370,650.00
2020062 3000007 34	600346	恒力石 化	2020-06 -23	2020- 07-21	14.00	74000	1,036,000.0 0
2020062 3000007	601601	中国太 保	2020-06 -23	2020- 07-21	27.25	10000	272,500.00

47							
2020062 3000007 59	600999	招商证 券	2020-06 -23	2020- 07-07	21.95	10900	239,255.00
2020062 3000007 65	600109	国金证 券	2020-06 -23	2020- 07-07	11.41	18100	206,521.00
2020062 3000007 68	600109	国金证 券	2020-06 -23	2020- 07-07	11.41	72700	829,507.00
2020062 3000007 71	601985	中国核 电	2020-06 -23	2020- 07-07	4.09	99700	407,773.00
2020062 3000007 77	601985	中国核 电	2020-06 -23	2020- 07-07	4.09	123800	506,342.00
2020062 3000008 00	600999	招商证 券	2020-06 -23	2020- 07-21	21.95	10900	239,255.00
2020062 3000008 10	601555	东吴证 券	2020-06 -23	2020- 07-21	8.16	43800	357,408.00
2020062 3000008 14	601881	中国银 河	2020-06 -23	2020- 07-07	11.47	10800	123,876.00
2020062 3000008 33	600010	包钢股 份	2020-06 -23	2020- 07-07	1.08	532800	575,424.00
2020062 4000002 27	000100	TCL科技	2020-06 -24	2020- 07-22	6.20	320000	1,984,000.0 0
2020062 4000003	000651	格力电 器	2020-06 -24	2020- 07-22	56.57	355600	20,116,292. 00

78							
2020062 4000007 20	600588	用友网 络	2020-06 -24	2020- 07-08	44.10	20000	882,000.00
2020062 4000007 42	000977	浪潮信 息	2020-06 -24	2020- 07-22	39.18	28000	1,097,040.0 0
2020062 4000008 88	601108	财通证 券	2020-06 -24	2020- 07-08	10.25	243600	2,496,900.0 0
2020062 4000010 25	600061	国投资 本	2020-06 -24	2020- 07-08	12.73	17100	217,683.00
2020062 4000012 64	600383	金地集 团	2020-06 -24	2020- 07-08	13.70	10000	137,000.00
2020062 4000014 17	600703	三安光 电	2020-06 -24	2020- 07-22	25.00	37300	932,500.00
2020062 4000014 69	002157	正邦科 技	2020-06 -24	2020- 07-22	17.48	40000	699,200.00
2020062 4000018 65	600177	雅戈尔	2020-06 -24	2020- 07-08	5.96	60000	357,600.00
2020062 4000020 31	601878	浙商证 券	2020-06 -24	2020- 07-08	9.91	27000	267,570.00
2020062 4000023 38	002475	立讯精 密	2020-06 -24	2020- 07-08	51.35	36800	1,889,680.0 0
2020062 4000023	601360	三六零	2020-06 -24	2020- 07-22	18.31	45400	831,274.00

46							
2020062 4000024 10	601881	中国银 河	2020-06 -24	2020- 07-22	11.47	37300	427,831.00
2020062 4000024 47	601881	中国银 河	2020-06 -24	2020- 07-22	11.47	32300	370,481.00
2020062 4000025 56	600977	中国电 影	2020-06 -24	2020- 07-08	13.13	10000	131,300.00
2020062 4000026 40	002714	牧原股 份	2020-06 -24	2020- 07-22	82.00	10000	820,000.00
2020062 4000027 15	300059	东方财 富	2020-06 -24	2020- 07-22	20.20	202500	4,090,500.0 0
2020062 4000027 16	300059	东方财 富	2020-06 -24	2020- 07-08	20.20	18900	381,780.00
2020062 4000027 17	300059	东方财 富	2020-06 -24	2020- 07-22	20.20	30700	620,140.00
2020062 4000027 62	300122	智飞生 物	2020-06 -24	2020- 07-08	100.1 5	15900	1,592,385.0 0
2020062 4000028 93	300408	三环集 团	2020-06 -24	2020- 07-08	27.70	10000	277,000.00
2020062 9000002 09	000100	TCL科技	2020-06 -29	2020- 07-13	6.20	100000	620,000.00
2020062 9000002	000651	格力电 器	2020-06 -29	2020- 07-13	56.57	23100	1,306,767.0 0

44							
2020062 9000003 14	000961	中南建 设	2020-06 -29	2020- 07-27	8.90	112000	996,800.00
2020062 9000005 99	300015	爱尔眼 科	2020-06 -29	2020- 07-27	43.45	10000	434,500.00
2020062 9000006 00	300015	爱尔眼 科	2020-06 -29	2020- 07-13	43.45	27000	1,173,150.0 0
2020062 9000008 04	601006	大秦铁 路	2020-06 -29	2020- 07-27	7.04	40500	285,120.00
2020062 9000008 36	601601	中国太 保	2020-06 -29	2020- 07-13	27.25	195600	5,330,100.0 0
2020062 9000008 39	600588	用友网 络	2020-06 -29	2020- 07-13	44.10	32300	1,424,430.0 0
2020062 9000008 75	600588	用友网 络	2020-06 -29	2020- 07-27	44.10	23100	1,018,710.0 0
2020062 9000009 11	600109	国金证 券	2020-06 -29	2020- 07-27	11.41	34200	390,222.00
2020062 9000009 23	601138	工业富 联	2020-06 -29	2020- 07-27	15.15	10000	151,500.00
2020062 9000009 50	600010	包钢股 份	2020-06 -29	2020- 07-27	1.08	454900	491,292.00
2020062 9000009	601992	金隅集 团	2020-06 -29	2020- 07-13	3.06	318800	975,528.00

78							
2020062 9000009 89	600010	包钢股 份	2020-06 -29	2020- 07-27	1.08	1000000	1,080,000.0 0
2020062 9000010 17	601766	中国中 车	2020-06 -29	2020- 07-13	5.57	134200	747,494.00
2020062 9000010 52	603019	中科曙 光	2020-06 -29	2020- 07-27	38.40	10000	384,000.00
2020062 9000011 12	601012	隆基股 份	2020-06 -29	2020- 07-27	40.73	20000	814,600.00
2020062 9000011 60	600999	招商证 券	2020-06 -29	2020- 07-13	21.95	18400	403,880.00
2020062 9000012 11	601985	中国核 电	2020-06 -29	2020- 07-13	4.09	66900	273,621.00
2020062 9000012 50	601985	中国核 电	2020-06 -29	2020- 07-13	4.09	36200	148,058.00
2020062 9000012 53	601138	工业富 联	2020-06 -29	2020- 07-13	15.15	57000	863,550.00
2020062 9000012 90	600438	通威股 份	2020-06 -29	2020- 07-27	17.38	58000	1,008,040.0 0
2020062 9000013 20	601138	工业富 联	2020-06 -29	2020- 07-13	15.15	20000	303,000.00
2020063 0000004	000166	申万宏 源	2020-06 -30	2020- 07-28	5.05	76000	383,800.00

41							
2020063 0000009 83	001979	招商蛇 口	2020-06 -30	2020- 07-14	16.44	53200	874,608.00
2020063 0000016 47	002463	沪电股 份	2020-06 -30	2020- 07-14	24.98	60000	1,498,800.0 0
2020063 0000017 73	002594	比亚迪	2020-06 -30	2020- 07-14	71.80	20000	1,436,000.0 0
2020063 0000019 37	300015	爱尔眼 科	2020-06 -30	2020- 07-14	43.45	20200	877,690.00
2020063 0000022 72	600118	中国卫 星	2020-06 -30	2020- 07-28	30.83	32200	992,726.00
2020063 0000025 70	600028	中国石 化	2020-06 -30	2020- 07-14	3.91	63100	246,721.00
2020063 0000026 28	601555	东吴证 券	2020-06 -30	2020- 07-14	8.16	138600	1,130,976.0 0
2020063 0000029 15	601888	中国中 免	2020-06 -30	2020- 07-14	154.0 3	18400	2,834,152.0 0
2020063 0000029 41	600390	五矿资 本	2020-06 -30	2020- 07-28	7.06	64800	457,488.00
2020063 0000029 93	600438	通威股 份	2020-06 -30	2020- 07-14	17.38	28700	498,806.00
2020063 0000030	600085	同仁堂	2020-06 -30	2020- 07-28	27.12	15600	423,072.00

97							
2020063 0000032 08	601766	中国中 车	2020-06 -30	2020- 07-14	5.57	78200	435,574.00
2020063 0000034 05	600170	上海建 工	2020-06 -30	2020- 07-14	3.07	421500	1,294,005.0 0
2020063 0000034 56	600196	复星医 药	2020-06 -30	2020- 07-14	33.85	27700	937,645.00
2020063 0000036 11	603156	养元饮 品	2020-06 -30	2020- 07-28	21.50	15700	337,550.00
2020063 0000036 23	600999	招商证 券	2020-06 -30	2020- 07-14	21.95	174700	3,834,665.0 0
2020063 0000036 87	600999	招商证 券	2020-06 -30	2020- 07-14	21.95	36600	803,370.00
2020063 0000037 43	600438	通威股 份	2020-06 -30	2020- 07-28	17.38	58200	1,011,516.0 0
2020063 0000037 48	601216	君正集 团	2020-06 -30	2020- 07-28	2.54	100000	254,000.00
2020063 0000037 51	600999	招商证 券	2020-06 -30	2020- 07-28	21.95	11000	241,450.00
2020063 0000037 76	600893	航发动 力	2020-06 -30	2020- 07-28	23.48	42800	1,004,944.0 0
2020063 0000038	601216	君正集 团	2020-06 -30	2020- 07-14	2.54	10000	25,400.00

15							
2020063 0000039 80	600703	三安光 电	2020-06 -30	2020- 07-14	25.00	81300	2,032,500.0 0
2020063 0000082 14	601236	红塔证 券	2020-06 -30	2020- 07-14	19.40	36700	711,980.00
合计						16,469,600	230,099,309.00

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

#### **6.4.13.2 信用风险**

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人招商证券股份有限公司开立于具有基金托管人资格的银行的托管账户，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**

本期末及上年度末均未持有短期信用评级的债券。

##### **6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资**

本期末及上年度末均未持有短期信用评级的资产支持证券。

##### **6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资**

本期末及上年度末均未持有短期信用评级的同业存单。

##### **6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资**

本期末及上年度末均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

本期末及上年度末均未持有长期信用评级的资产支持证券。

#### 6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本期末及上年度末均未持有长期信用评级的同业存单。

#### 6.4.13.3 流动性风险

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

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

##### 6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理,通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金所持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	29,215,243.01	-	-	-	29,215,243.01
结算备付金	7,584,922.01	-	-	-	7,584,922.01
存出保证金	2,737,622.57	-	-	2,470,800.00	5,208,422.57
交易性金融资产	-	-	-	5,826,999,412.70	5,826,999,412.70
应收证券清算款	-	-	-	13,130,827.39	13,130,827.39
应收利息	-	-	-	100,881.17	100,881.17
应收股利	-	-	-	102,203.19	102,203.19
其他资产	-	-	-	75,409.88	75,409.88
资产总计	39,537,787.59	-	-	5,842,879,534.33	5,882,417,321.92
负债					
应付证券清算款	-	-	-	23,389,526.05	23,389,526.05
应付管理人报酬	-	-	-	2,536,084.99	2,536,084.99
应付托管费	-	-	-	507,216.99	507,216.99
应付交易费用	-	-	-	687,982.79	687,982.79
应交税费	-	-	-	3,174.69	3,174.69
其他负债	-	-	-	605,771.92	605,771.92
负债总计	-	-	-	27,729,757.43	27,729,757.43
利率敏感度缺口	39,537,787.59	-	-	5,815,149,776.90	5,854,687,564.49
上年度末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	90,254,421.00	-	-	-	90,254,421.00
结算备付金	-	-	-	9,562,187.68	9,562,187.68
存出保证金	-	-	-	2,463,000.00	2,463,000.00

交易性金融资产	-	-	-	4,332,238,902.60	4,332,238,902.60
应收利息	-	-	-	58,482.50	58,482.50
其他资产	-	-	-	28,144.32	28,144.32
资产总计	90,254,421.00	-	-	4,344,350,717.10	4,434,605,138.10
负债					
应付证券清算款	-	-	-	73,307,677.13	73,307,677.13
应付管理人报酬	-	-	-	328,747.58	328,747.58
应付托管费	-	-	-	65,749.51	65,749.51
应付交易费用	-	-	-	800,102.40	800,102.40
其他负债	-	-	-	24,116.76	24,116.76
负债总计	-	-	-	74,526,393.38	74,526,393.38
利率敏感度缺口	90,254,421.00	-	-	4,269,824,323.72	4,360,078,744.72

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(2019年12月31日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2019年12月31日：同)。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金原则上采用完全复制法，跟踪沪深300指数，即按照标的指数的成份股组成及其权重构建基金投资组合，并根据标的指数组成及其权重的变动而进行相应调整。但因特殊情况(如流动性不足等)导致无法获得足够数量的股票时，基金管理人将搭配使用其他合理方法进行适当的替代。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中，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		上年度末 2019年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	5,826,999,412.70	99.53	4,332,238,902.60	99.36
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	5,826,999,412.70	99.53	4,332,238,902.60	99.36

#### 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	上年度末 2019年12月31日
	业绩比较基准上升5%	310,580,290.48	221,348,297.10

	业绩比较基准下降5%	-310,580,290.48	-221,348,297.10
--	------------	-----------------	-----------------

#### 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5,817,823,190.48元，属于第二层次的余额为9,176,222.22元，无属于第三层次的余额(2019年12月31日：第一层次4,324,274,244.60元，第二层次7,964,658.00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(2019年12月31日：同)。

##### (d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

## 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	5,826,999,412.70	99.06
	其中：股票	5,826,999,412.70	99.06
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	36,800,165.02	0.63
8	其他各项资产	18,617,744.20	0.32
9	合计	5,882,417,321.92	100.00

注：1、上表中的股票投资项含可退替代款估值增值，而下一节按行业分类股票投资组合的合计项不含可退替代款估值增值。

2、本报告期末，本基金参与转融通证券出借业务出借证券的公允价值为 230,099,309.00 元，占基金资产净值的比例为 3.93%。

## 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	86,512,010.40	1.48
B	采矿业	140,424,128.55	2.40
C	制造业	2,791,748,963.63	47.68
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	118,584,679.00	2.03

E	建筑业	115,246,098.00	1.97
F	批发和零售业	59,994,222.88	1.02
G	交通运输、仓储和邮政业	163,393,186.61	2.79
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	238,230,635.66	4.07
J	金融业	1,646,865,836.74	28.13
K	房地产业	217,809,603.38	3.72
L	租赁和商务服务业	83,257,087.00	1.42
M	科学研究和技术服务业	39,439,461.60	0.67
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	7,470,300.00	0.13
Q	卫生和社会工作	70,976,494.76	1.21
R	文化、体育和娱乐业	37,718,924.90	0.64
S	综合	-	-
	合计	5,817,671,633.11	99.37

### 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	7,528,476.67	0.13
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	1,785,947.77	0.03
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	9,327,190.76	0.16

### 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	601318	中国平安	4,258,486	304,055,900.40	5.19
2	600519	贵州茅台	197,600	289,065,088.00	4.94
3	600036	招商银行	4,055,306	136,744,918.32	2.34
4	600276	恒瑞医药	1,460,416	134,796,396.80	2.30
5	000858	五粮液	763,252	130,607,682.24	2.23
6	000333	美的集团	1,926,464	115,183,282.56	1.97
7	000651	格力电器	1,892,322	107,048,655.54	1.83
8	002475	立讯精密	1,647,077	84,577,403.95	1.44

9	600030	中信证券	3,349,500	80,756,445.00	1.38
10	601166	兴业银行	4,900,618	77,331,752.04	1.32
11	600887	伊利股份	2,385,300	74,254,389.00	1.27
12	000002	万科A	2,675,200	69,929,728.00	1.19
13	601398	XD工商银	13,784,200	68,645,316.00	1.17
14	600900	长江电力	3,460,500	65,541,870.00	1.12
15	601888	中国中免	383,600	59,085,908.00	1.01
16	601328	交通银行	10,800,800	55,408,104.00	0.95
17	300059	东方财富	2,532,620	51,158,924.00	0.87
18	600585	海螺水泥	943,400	49,915,294.00	0.85
19	000725	京东方A	10,655,600	49,761,652.00	0.85
20	000001	平安银行	3,813,640	48,814,592.00	0.83
21	600000	浦发银行	4,611,500	48,789,670.00	0.83
22	002714	牧原股份	589,175	48,312,350.00	0.83
23	000661	长春高新	110,854	48,254,746.20	0.82
24	603288	海天味业	382,241	47,550,780.40	0.81
25	600016	民生银行	8,362,400	47,414,808.00	0.81
26	002415	海康威视	1,470,200	44,620,570.00	0.76
27	601688	华泰证券	2,313,300	43,490,040.00	0.74
28	600031	三一重工	2,317,200	43,470,672.00	0.74
29	000063	中兴通讯	1,060,700	42,565,891.00	0.73
30	601012	隆基股份	1,037,300	42,249,229.00	0.72
31	600048	保利地产	2,815,500	41,613,090.00	0.71
32	600837	海通证券	3,179,000	39,991,820.00	0.68
33	603259	药明康德	408,276	39,439,461.60	0.67
34	601668	中国建筑	8,236,600	39,288,582.00	0.67
35	601288	农业银行	11,303,800	38,206,844.00	0.65
36	300498	温氏股份	1,752,278	38,199,660.40	0.65
37	600570	恒生电子	328,124	35,338,954.80	0.60
38	300015	爱尔眼科	792,392	34,429,432.40	0.59
39	000100	TCL科技	5,317,500	32,968,500.00	0.56

40	601229	上海银行	3,913,400	32,481,220.00	0.55
41	300142	沃森生物	604,700	31,662,092.00	0.54
42	002142	宁波银行	1,181,580	31,040,106.60	0.53
43	600309	万华化学	617,894	30,888,521.06	0.53
44	601211	国泰君安	1,774,099	30,620,948.74	0.52
45	603986	兆易创新	129,160	30,470,135.60	0.52
46	601601	中国太保	1,070,100	29,160,225.00	0.50
47	601988	中国银行	8,279,300	28,811,964.00	0.49
48	601169	北京银行	5,818,600	28,511,140.00	0.49
49	002352	顺丰控股	519,400	28,411,180.00	0.49
50	600588	用友网络	638,920	28,176,372.00	0.48
51	600009	上海机场	378,500	27,278,495.00	0.47
52	601766	中国中车	4,771,100	26,575,027.00	0.45
53	600690	海尔智家	1,485,500	26,293,350.00	0.45
54	002241	歌尔股份	893,600	26,236,096.00	0.45
55	000568	泸州老窖	287,300	26,178,776.00	0.45
56	000338	潍柴动力	1,885,700	25,871,804.00	0.44
57	002594	比亚迪	356,600	25,603,880.00	0.44
58	300122	智飞生物	252,200	25,257,830.00	0.43
59	002304	洋河股份	237,945	25,017,537.30	0.43
60	002410	广联达	355,600	24,785,320.00	0.42
61	000876	新希望	827,400	24,656,520.00	0.42
62	600999	招商证券	1,122,616	24,641,421.20	0.42
63	600703	三安光电	961,300	24,032,500.00	0.41
64	601899	紫金矿业	5,409,100	23,800,040.00	0.41
65	600104	XD上汽集	1,378,500	23,420,715.00	0.40
66	002555	三七互娱	497,139	23,266,105.20	0.40
67	002230	科大讯飞	605,900	22,678,837.00	0.39
68	002027	分众传媒	4,037,800	22,490,546.00	0.38
69	601818	光大银行	6,256,800	22,399,344.00	0.38
70	600745	闻泰科技	176,600	22,242,770.00	0.38

71	002007	华兰生物	430,540	21,574,359.40	0.37
72	300601	康泰生物	131,700	21,356,472.00	0.36
73	300347	泰格医药	206,522	21,040,461.36	0.36
74	600919	江苏银行	3,624,700	20,552,049.00	0.35
75	600028	中国石化	5,239,140	20,485,037.40	0.35
76	001979	招商蛇口	1,242,111	20,420,304.84	0.35
77	600436	片仔癀	118,000	20,089,500.00	0.34
78	000538	云南白药	201,328	18,886,579.68	0.32
79	600547	山东黄金	510,600	18,698,172.00	0.32
80	601088	中国神华	1,295,100	18,597,636.00	0.32
81	600406	国电南瑞	908,200	18,391,050.00	0.31
82	300413	芒果超媒	279,422	18,218,314.40	0.31
83	000895	双汇发展	391,600	18,048,844.00	0.31
84	300003	乐普医疗	490,602	17,916,785.04	0.31
85	000166	申万宏源	3,546,300	17,908,815.00	0.31
86	601628	中国人寿	655,404	17,833,542.84	0.30
87	600050	中国联通	3,655,500	17,692,620.00	0.30
88	600438	通威股份	1,013,000	17,605,940.00	0.30
89	002271	东方雨虹	433,200	17,600,916.00	0.30
90	601009	南京银行	2,363,400	17,323,722.00	0.30
91	000938	紫光股份	402,300	17,290,854.00	0.30
92	300014	亿纬锂能	361,252	17,285,908.20	0.30
93	002129	中环股份	766,900	17,224,574.00	0.29
94	601939	建设银行	2,639,300	16,653,983.00	0.28
95	002371	北方华创	96,700	16,526,997.00	0.28
96	000776	广发证券	1,166,000	16,463,920.00	0.28
97	601006	大秦铁路	2,336,300	16,447,552.00	0.28
98	603160	汇顶科技	72,258	16,106,308.20	0.28
99	300136	信维通信	303,600	16,096,872.00	0.27
100	601390	中国中铁	3,198,800	16,057,976.00	0.27
101	002460	赣锋锂业	299,250	16,030,822.50	0.27

102	601857	XD中国石	3,821,285	16,011,184.15	0.27
103	600196	复星医药	472,700	16,000,895.00	0.27
104	600019	宝钢股份	3,504,500	15,980,520.00	0.27
105	603019	中科曙光	409,274	15,716,121.60	0.27
106	000977	浪潮信息	396,447	15,532,793.46	0.27
107	300124	汇川技术	408,708	15,526,816.92	0.27
108	002044	美年健康	1,076,100	15,506,601.00	0.26
109	002050	三花智控	706,900	15,481,110.00	0.26
110	601186	中国铁建	1,811,400	15,179,532.00	0.26
111	002602	世纪华通	979,140	14,990,633.40	0.26
112	600809	山西汾酒	102,329	14,837,705.00	0.25
113	600015	华夏银行	2,422,600	14,826,312.00	0.25
114	002311	海大集团	309,743	14,740,669.37	0.25
115	002001	新和成	506,300	14,733,330.00	0.25
116	002624	完美世界	255,600	14,732,784.00	0.25
117	601336	新华保险	327,900	14,519,412.00	0.25
118	300433	蓝思科技	515,400	14,451,816.00	0.25
119	601989	中国重工	3,587,400	14,349,600.00	0.25
120	601933	永辉超市	1,505,420	14,120,839.60	0.24
121	603501	韦尔股份	68,500	13,833,575.00	0.24
122	002456	欧菲光	741,100	13,628,829.00	0.23
123	002236	大华股份	707,700	13,594,917.00	0.23
124	600958	东方证券	1,406,700	13,349,583.00	0.23
125	000157	中联重科	2,041,700	13,128,131.00	0.22
126	600183	生益科技	448,100	13,115,887.00	0.22
127	600352	浙江龙盛	1,021,900	13,070,101.00	0.22
128	600741	华域汽车	619,800	12,885,642.00	0.22
129	002024	苏宁易购	1,462,100	12,822,617.00	0.22
130	601377	兴业证券	1,841,400	12,613,590.00	0.22
131	601788	光大证券	766,400	12,308,384.00	0.21
132	600383	金地集团	887,200	12,154,640.00	0.21

133	002008	大族激光	334,800	12,036,060.00	0.21
134	601138	XD工业富	782,600	11,856,390.00	0.20
135	002463	沪电股份	473,110	11,818,287.80	0.20
136	000860	顺鑫农业	204,800	11,669,504.00	0.20
137	600346	恒力石化	829,800	11,617,200.00	0.20
138	600660	福耀玻璃	549,400	11,465,978.00	0.20
139	601901	方正证券	1,616,500	11,444,820.00	0.20
140	300408	三环集团	409,300	11,337,610.00	0.19
141	601225	陕西煤业	1,566,200	11,292,302.00	0.19
142	002120	韵达股份	457,812	11,193,503.40	0.19
143	300033	同花顺	83,982	11,176,324.56	0.19
144	601877	正泰电器	422,700	11,138,145.00	0.19
145	601155	新城控股	354,400	11,071,456.00	0.19
146	600522	中天科技	963,000	11,026,350.00	0.19
147	000425	徐工机械	1,847,400	10,918,134.00	0.19
148	002736	国信证券	966,100	10,916,930.00	0.19
149	600340	华夏幸福	474,289	10,842,246.54	0.19
150	002202	金风科技	1,086,300	10,830,411.00	0.18
151	600109	国金证券	948,400	10,821,244.00	0.18
152	300144	宋城演艺	616,320	10,662,336.00	0.18
153	603799	华友钴业	269,200	10,461,112.00	0.18
154	601669	中国电建	3,010,700	10,417,022.00	0.18
155	000783	长江证券	1,524,900	10,277,826.00	0.18
156	603993	XD洛阳钼	2,779,500	10,200,765.00	0.17
157	002841	视源股份	102,300	10,180,896.00	0.17
158	601800	中国交建	1,384,800	10,164,432.00	0.17
159	601108	财通证券	988,400	10,131,100.00	0.17
160	601985	中国核电	2,453,600	10,035,224.00	0.17
161	601555	东吴证券	1,220,080	9,955,852.80	0.17
162	600089	特变电工	1,464,100	9,911,957.00	0.17
163	603369	今世缘	247,597	9,851,884.63	0.17

164	000069	华侨城 A	1,613,600	9,778,416.00	0.17
165	600867	通化东宝	560,600	9,771,258.00	0.17
166	600010	包钢股份	8,953,800	9,670,104.00	0.17
167	000768	中航飞机	544,700	9,662,978.00	0.17
168	002916	深南电路	56,548	9,472,920.96	0.16
169	002493	荣盛石化	742,800	9,136,440.00	0.16
170	000066	中国长城	690,200	9,110,640.00	0.16
171	600029	南方航空	1,741,800	9,005,106.00	0.15
172	002179	中航光电	216,400	8,874,564.00	0.15
173	600606	绿地控股	1,434,500	8,865,210.00	0.15
174	600487	亨通光电	539,100	8,846,631.00	0.15
175	000963	华东医药	343,300	8,685,490.00	0.15
176	002157	正邦科技	493,100	8,619,388.00	0.15
177	600795	国电电力	4,645,800	8,594,730.00	0.15
178	000625	长安汽车	769,200	8,461,200.00	0.14
179	600061	国投资本	663,800	8,450,174.00	0.14
180	600886	国投电力	1,069,400	8,405,484.00	0.14
181	600705	中航资本	2,108,300	8,348,868.00	0.14
182	601607	上海医药	454,056	8,345,549.28	0.14
183	600926	杭州银行	933,700	8,328,604.00	0.14
184	002422	科伦药业	396,094	8,317,974.00	0.14
185	600893	航发动力	354,100	8,314,268.00	0.14
186	603658	安图生物	51,100	8,300,684.00	0.14
187	601100	恒立液压	103,200	8,276,640.00	0.14
188	600111	北方稀土	858,200	7,998,424.00	0.14
189	002466	天齐锂业	348,200	7,991,190.00	0.14
190	600498	烽火通信	276,300	7,987,833.00	0.14
191	603899	晨光文具	146,100	7,977,060.00	0.14
192	601162	XD天风证	1,310,780	7,943,326.80	0.14
193	601066	XD中信建	200,900	7,911,442.00	0.14
194	600637	东方明珠	807,518	7,792,548.70	0.13

195	601111	中国国航	1,175,000	7,766,750.00	0.13
196	600176	中国巨石	827,000	7,567,050.00	0.13
197	002607	中公教育	269,200	7,470,300.00	0.13
198	600115	东方航空	1,765,700	7,451,254.00	0.13
199	002601	龙蟒佰利	398,200	7,366,700.00	0.13
200	601360	三六零	399,200	7,309,352.00	0.12
201	600011	华能国际	1,725,900	7,283,298.00	0.12
202	601727	上海电气	1,434,500	7,229,880.00	0.12
203	601816	京沪高铁	1,160,200	7,228,046.00	0.12
204	600233	圆通速递	496,400	7,227,584.00	0.12
205	600118	中国卫星	234,000	7,214,220.00	0.12
206	300628	亿联网络	105,482	7,200,201.32	0.12
207	600332	白云山	221,700	7,167,561.00	0.12
208	600271	航天信息	440,582	7,155,051.68	0.12
209	601600	中国铝业	2,565,400	7,080,504.00	0.12
210	000786	北新建材	330,800	7,055,964.00	0.12
211	601618	中国中冶	2,794,500	7,014,195.00	0.12
212	000656	金科股份	842,500	6,874,800.00	0.12
213	003816	中国广核	2,317,900	6,860,984.00	0.12
214	000596	古井贡酒	45,478	6,832,614.72	0.12
215	600221	海航控股	4,513,500	6,770,250.00	0.12
216	601838	成都银行	846,400	6,737,344.00	0.12
217	002252	上海莱士	796,000	6,734,160.00	0.12
218	000728	国元证券	794,700	6,675,480.00	0.11
219	600489	中金黄金	728,500	6,658,490.00	0.11
220	000703	恒逸石化	725,520	6,623,997.60	0.11
221	601919	中远海控	1,896,300	6,580,161.00	0.11
222	600177	雅戈尔	1,091,200	6,503,552.00	0.11
223	000961	中南建设	730,200	6,498,780.00	0.11
224	600068	葛洲坝	1,086,500	6,464,675.00	0.11
225	600066	宇通客车	520,800	6,353,760.00	0.11

226	601997	贵阳银行	885,800	6,342,328.00	0.11
227	600390	五矿资本	886,400	6,257,984.00	0.11
228	600004	白云机场	408,145	6,220,129.80	0.11
229	601998	中信银行	1,206,500	6,213,475.00	0.11
230	601198	东兴证券	543,500	5,924,150.00	0.10
231	600085	同仁堂	217,538	5,899,630.56	0.10
232	603833	欧派家居	50,000	5,795,000.00	0.10
233	601881	中国银河	505,000	5,792,350.00	0.10
234	002508	老板电器	185,800	5,780,238.00	0.10
235	600018	上港集团	1,366,200	5,738,040.00	0.10
236	600219	南山铝业	2,826,500	5,737,795.00	0.10
237	601231	环旭电子	258,300	5,641,272.00	0.10
238	600516	方大炭素	895,360	5,622,860.80	0.10
239	002673	西部证券	688,800	5,620,608.00	0.10
240	002146	荣盛发展	684,700	5,546,070.00	0.09
241	601018	宁波港	1,552,100	5,540,997.00	0.09
242	600362	江西铜业	409,500	5,511,870.00	0.09
243	600998	九州通	296,000	5,511,520.00	0.09
244	600655	豫园股份	612,800	5,429,408.00	0.09
245	600760	中航沈飞	164,500	5,398,890.00	0.09
246	601319	中国人保	838,000	5,396,720.00	0.09
247	600170	上海建工	1,743,600	5,352,852.00	0.09
248	601117	中国化学	968,400	5,306,832.00	0.09
249	601878	浙商证券	525,300	5,205,723.00	0.09
250	002773	康弘药业	103,150	5,116,240.00	0.09
251	600369	西南证券	1,113,200	5,109,588.00	0.09
252	600297	广汇汽车	1,592,100	5,078,799.00	0.09
253	600848	上海临港	236,400	5,075,508.00	0.09
254	600208	新湖中宝	1,695,500	5,052,590.00	0.09
255	601021	春秋航空	143,315	5,050,420.60	0.09
256	002739	万达电影	327,550	5,001,688.50	0.09

257	002938	鹏鼎控股	99,600	4,985,976.00	0.09
258	002153	石基信息	126,100	4,921,683.00	0.08
259	002958	青农商行	1,090,400	4,830,472.00	0.08
260	601658	邮储银行	1,054,600	4,819,522.00	0.08
261	600674	川投能源	515,000	4,774,050.00	0.08
262	600038	中直股份	115,214	4,731,838.98	0.08
263	002032	苏泊尔	64,700	4,593,700.00	0.08
264	002939	长城证券	367,600	4,528,832.00	0.08
265	600027	华电国际	1,283,900	4,390,938.00	0.07
266	603156	养元饮品	199,420	4,287,530.00	0.07
267	002558	巨人网络	240,500	4,184,700.00	0.07
268	000671	阳光城	644,600	4,086,764.00	0.07
269	000627	天茂集团	776,300	4,044,523.00	0.07
270	601992	金隅集团	1,316,800	4,029,408.00	0.07
271	600482	中国动力	255,670	4,014,019.00	0.07
272	600583	海油工程	873,500	3,974,425.00	0.07
273	002468	申通快递	240,541	3,947,277.81	0.07
274	600977	中国电影	292,200	3,836,586.00	0.07
275	601633	XD长城汽	474,529	3,663,363.88	0.06
276	601216	君正集团	1,338,200	3,399,028.00	0.06
277	000709	河钢股份	1,660,900	3,388,236.00	0.06
278	601916	浙商银行	859,300	3,385,642.00	0.06
279	601238	广汽集团	362,400	3,261,600.00	0.06
280	601577	长沙银行	404,400	3,210,936.00	0.05
281	600188	兖州煤业	351,800	3,081,768.00	0.05
282	600398	海澜之家	525,900	3,060,738.00	0.05
283	601808	中海油服	232,100	3,049,794.00	0.05
284	000723	美锦能源	486,000	3,042,360.00	0.05
285	601236	红塔证券	156,200	3,030,280.00	0.05
286	601698	中国卫通	155,100	2,793,351.00	0.05
287	600372	中航电子	208,800	2,781,216.00	0.05

288	600928	西安银行	524,800	2,760,448.00	0.05
289	601898	中煤能源	713,600	2,711,680.00	0.05
290	600025	华能水电	711,900	2,698,101.00	0.05
291	600989	宝丰能源	318,600	2,682,612.00	0.05
292	000708	中信特钢	139,400	2,382,346.00	0.04
293	601077	渝农商行	456,900	2,156,568.00	0.04
294	600968	海油发展	799,500	1,862,835.00	0.03
295	601828	美凯龙	158,700	1,680,633.00	0.03
296	601298	青岛港	270,500	1,536,440.00	0.03
297	603260	合盛硅业	54,702	1,495,552.68	0.03
298	601212	白银有色	581,800	1,483,590.00	0.03
299	002945	华林证券	106,000	1,463,860.00	0.03
300	600299	安迪苏	116,100	1,418,742.00	0.02

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688396	华润微	81,911	3,395,210.95	0.06
2	688169	石头科技	5,382	1,965,183.48	0.03
3	688158	优刻得	20,700	1,415,466.00	0.02
4	688520	神州细胞	12,351	726,485.82	0.01
5	688505	复旦张江	22,688	562,208.64	0.01
6	688518	联赢激光	14,111	293,932.13	0.01
7	688004	博汇科技	2,500	179,750.00	0.00
8	688568	中科星图	11,020	178,634.20	0.00
9	688377	迪威尔	7,894	129,619.48	0.00
10	603087	甘李药业	1,076	107,922.80	0.00

11	688277	天智航	8,810	106,072.40	0.00
12	688027	国盾量子	2,830	102,389.40	0.00
13	688600	皖仪科技	5,468	84,754.00	0.00
14	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.00
15	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.00
16	300839	N博汇	502	11,751.82	0.00
17	300847	中船汉光	1,421	9,861.74	0.00
18	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
19	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
20	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
21	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初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000651	格力电器	68,166,031.08	1.56
2	000333	美的集团	61,805,709.78	1.42
3	000858	五粮液	55,912,650.47	1.28
4	000661	长春高新	48,359,618.76	1.11
5	000002	万科A	46,159,309.32	1.06
6	000001	平安银行	32,782,896.37	0.75
7	002475	立讯精密	31,650,799.21	0.73
8	601398	工商银行	29,182,934.39	0.67
9	000725	京东方A	28,823,144.00	0.66
10	300498	温氏股份	28,241,614.65	0.65
11	002415	海康威视	27,898,418.15	0.64
12	000063	中兴通讯	26,739,611.98	0.61
13	002714	牧原股份	23,319,946.00	0.53
14	600745	闻泰科技	21,613,279.60	0.50

15	300601	康泰生物	21,465,250.24	0.49
16	300059	东方财富	21,249,671.94	0.49
17	300015	爱尔眼科	19,096,876.49	0.44
18	002142	宁波银行	18,952,483.30	0.43
19	002352	顺丰控股	18,801,460.34	0.43
20	002371	北方华创	18,064,323.30	0.41

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

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000651	格力电器	47,109,760.60	1.08
2	000661	长春高新	47,033,934.42	1.08
3	000858	五粮液	46,110,386.44	1.06
4	000333	美的集团	45,088,617.80	1.03
5	002475	立讯精密	26,368,776.06	0.60
6	000002	万科A	22,789,327.05	0.52
7	600519	贵州茅台	22,216,283.98	0.51
8	601318	中国平安	21,576,047.67	0.49
9	000001	平安银行	21,569,883.85	0.49
10	601166	兴业银行	20,542,357.99	0.47
11	603160	汇顶科技	18,906,782.65	0.43
12	002415	海康威视	17,771,110.94	0.41
13	601288	农业银行	17,280,400.00	0.40
14	300498	温氏股份	16,839,369.98	0.39
15	300059	东方财富	16,718,977.46	0.38
16	002714	牧原股份	16,487,737.64	0.38
17	000725	京东方A	15,286,269.00	0.35
18	603986	兆易创新	14,788,610.30	0.34

19	002916	深南电路	14,752,154.40	0.34
20	000568	泸州老窖	14,714,544.09	0.34

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

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,740,427,915.70
卖出股票收入（成交）总额	1,325,661,085.34

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

##### 7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动	风险说明
IF2007	IF2007	20	24,708,000.00	1,200,600.00	-
公允价值变动总额合计（元）					1,200,600.00

股指期货投资本期收益（元）	-293,123.88
股指期货投资本期公允价值变动（元）	674,820.00

### 7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

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

### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

### 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本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	5,208,422.57
2	应收证券清算款	13,130,827.39
3	应收股利	102,203.19
4	应收利息	100,881.17
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	75,409.88
8	其他	-
9	合计	18,617,744.20

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	000651	格力电器	25,592,268.00	0.44	转融通证券出借
2	002475	立讯精密	7,024,680.00	0.12	转融通证券出借

##### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	688396	华润微	3,395,210.95	0.06	科创板打新限售
2	688169	石头科技	1,965,183.48	0.03	科创板打新限售

3	688158	优刻得	1,415,466.00	0.02	科创板打新限售
4	688520	神州细胞	726,485.82	0.01	科创板打新限售
5	688505	复旦张江	562,208.64	0.01	科创板打新限售

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		联接基金	
		持有份额	占总 份额 比例	持有份额	占总 份额 比例	持有份额	占 总 份 额 比 例
689	8,059,084.90	5,541,660, 190.00	99.8 0%	11,049,30 6.00	0.20%	5,517,91 9,200.00	9 9.37 0%

### 8.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总份 额比例(%)
1	招商证券股份有限公司一天弘沪深300交易型 开放式指数证券投资基金联接基金	5,517,919,2 00.00	99.37
2	方正证券股份有限公司	8,864,400.0 0	0.16
3	华泰证券股份有限公司	7,928,274.0 0	0.14

4	招商证券股份有限公司	4,371,433.0 0	0.08
5	中信证券股份有限公司	2,576,883.0 0	0.05
6	王伟湘	1,500,000.0 0	0.03
7	袁汝喜	671,300.00	0.01
8	瞿雅岚	561,000.00	0.01
9	肖红	400,000.00	0.01
10	李盈忠	297,000.00	0.01

注：持有人为场内持有人。

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

期末基金管理人的从业人员未持有本基金。

### 8.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 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(2019年12月05日)基金份额总额	236,709,496.00
本报告期期初基金份额总额	4,238,709,496.00
本报告期基金总申购份额	3,150,000,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	1,836,000,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	5,552,709,496.00

## § 10 重大事件揭示

**10.1 基金份额持有人大会决议**

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

**10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动**

本报告期内，经天弘基金管理有限公司股东会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	
西藏东方财富证券	2	-	-	-	-	-
方正	2	-	-	-	-	-

证券						
光大证券	2	711,824,633.18	23.30%	306,103.43	25.55%	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	5	2,343,173,169.55	76.70%	891,982.37	74.45%	-

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

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：2个，其中包括方正证券上海交易单元1个，方正证券深圳交易单元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	2020-01-03
2	天弘基金管理有限公司关于旗下基金在泰信财富基金销	中国证监会指定媒介	2020-01-11

	售有限公司暂停办理基金销售业务的公告		
3	天弘基金管理有限公司关于深圳分公司经营场所变更的公告	中国证监会指定媒介	2020-01-18
4	天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会指定媒介	2020-01-20
5	天弘基金管理有限公司关于调整天弘沪深300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	2020-01-20
6	天弘基金管理有限公司及全资子公司投资旗下偏股型公募基金的公告	中国证监会指定媒介	2020-02-04
7	天弘基金管理有限公司关于天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金增加扩位证券简称的公告	中国证监会指定媒介	2020-03-14
8	天弘基金管理有限公司关于推迟披露旗下公募基金2019年年度报告的公告	中国证监会指定媒介	2020-03-25
9	天弘基金管理有限公司关于天弘沪深300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	2020-04-01
10	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
11	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

12	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
13	天弘基金管理有限公司关于天弘沪深300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	2020-04-21
14	天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金2020年第一季度报告	中国证监会指定媒介	2020-04-22
15	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会指定媒介	2020-06-11

## § 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	20200101-20200630	4,097,433,100.00	6,979,486,100.00	5,559,000,000.00	5,517,919,200.00	99.37%

#### 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，本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金募集的文件
- 2、天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金基金合同
- 3、天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金托管协议
- 4、天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金招募说明书
- 5、报告期内在指定报刊上披露的各项公告
- 6、中国证监会规定的其他文件

### 12.2 存放地点

天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层

### 12.3 查阅方式

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

公司网站：[www.thfund.com.cn](http://www.thfund.com.cn)

天弘基金管理有限公司  
二〇二〇年八月三十一日