

天弘中证 800 指数型发起式证券投资基金

2021 年中期报告

2021 年 06 月 30 日

基金管理人:天弘基金管理有限公司

基金托管人:广发证券股份有限公司

送出日期:2021 年 08 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人广发证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年08月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2021年01月01日起至2021年06月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	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	8
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
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	16
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	16
§6 中期财务会计报告(未经审计)	16
6.1 资产负债表	16
6.2 利润表	18
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	20
6.4 报表附注	21
§7 投资组合报告	47
7.1 期末基金资产组合情况	47
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	47
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	49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	95
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	97
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	97
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	98
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	98
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	98
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	98
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	98
7.12 投资组合报告附注	98
§8 基金份额持有人信息	99
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	99
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	100

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	100
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	100
§9 开放式基金份额变动	101
§10 重大事件揭示	101
10.1 基金份额持有人大会决议	101
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	101
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	101
10.4 基金投资策略的改变	101
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	101
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	102
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	102
10.8 其他重大事件	103
§11 影响投资者决策的其他重要信息	105
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	105
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	106
§12 备查文件目录	106
12.1 备查文件目录	106
12.2 存放地点	107
12.3 查阅方式	107

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	天弘中证800指数型发起式证券投资基金	
基金简称	天弘中证800	
基金主代码	001588	
基金运作方式	契约型开放式、发起式	
基金合同生效日	2015年07月16日	
基金管理人	天弘基金管理有限公司	
基金托管人	广发证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	39,051,104.29份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	天弘中证800A	天弘中证800C
下属分级基金的交易代码	001588	001589
报告期末下属分级基金的份额总额	16,044,405.27份	23,006,699.02份

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。
投资策略	本基金采用完全复制标的指数的方法，进行被动指数化投资。股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合复制标的指数，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，以复制和跟踪标的指数。本基金在严格控制基金的日均跟踪偏离度和年跟踪误差的前提下，力争获取与标的指数相似的投资收益。本基金产品投资策略主要包括大类资产配置、股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、参与融资及转融通证券出借业务策略、存托凭证投资策略、其他金融工具投资策略等策略。
业绩比较基准	中证800指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		天弘基金管理有限公司	广发证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	童建林	崔瑞娟
	联系电话	022-83310208	020-66338888
	电子邮箱	service@thfund.com.cn	cuirj@gf.com.cn
客户服务电话		95046	95575
传真		022-83865569	020-87555129
注册地址		天津自贸区（中心商务区）响螺湾旷世国际大厦A座1704-241号	广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街2号618室
办公地址		天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层	广州市天河区马场路26号广发证券大厦34楼
邮政编码		300203	510627
法定代表人		胡晓明	林传辉

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

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
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	天弘基金管理有限公司	天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2021年01月01日-2021年06月30日)	
	天弘中证800A	天弘中证800C
本期已实现收益	1,309,944.55	1,798,322.43
本期利润	907,202.06	1,341,666.56
加权平均基金份额本期利润	0.0572	0.0585
本期加权平均净值利润率	4.14%	4.30%
本期基金份额净值增长率	3.73%	3.63%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2021年06月30日)	
期末可供分配利润	6,603,458.49	9,034,242.02
期末可供分配基金份额利润	0.4116	0.3927
期末基金资产净值	22,647,863.76	32,040,941.04
期末基金份额净值	1.4116	1.3927
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2021年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	41.16%	39.27%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

天弘中证800A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.30%	0.73%	-1.23%	0.73%	0.93%	0.00%
过去三个月	6.18%	0.83%	4.46%	0.84%	1.72%	-0.01%
过去六个月	3.73%	1.14%	1.69%	1.15%	2.04%	-0.01%
过去一年	29.65%	1.21%	21.97%	1.22%	7.68%	-0.01%
过去三年	70.52%	1.28%	42.13%	1.29%	28.39%	-0.01%
自基金合同生效日起至今	41.16%	1.33%	19.69%	1.34%	21.47%	-0.01%

天弘中证800C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-0.31%	0.73%	-1.23%	0.73%	0.92%	0.00%
过去三个月	6.13%	0.83%	4.46%	0.84%	1.67%	-0.01%
过去六个月	3.63%	1.14%	1.69%	1.15%	1.94%	-0.01%
过去一年	29.38%	1.21%	21.97%	1.22%	7.41%	-0.01%
过去三年	69.51%	1.28%	42.13%	1.29%	27.38%	-0.01%
自基金合	39.27%	1.33%	19.69%	1.34%	19.58%	-0.01%

同生效日 起至今						
-------------	--	--	--	--	--	--

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

天弘中证800A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2015年07月16日-2021年06月30日)



天弘中证800C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2015年07月16日-2021年06月30日)



- 注：1、本基金合同于2015年07月16日生效。
2、本报告期内，本基金的各项投资比例达到基金合同约定的各项比例要求。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

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

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

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张子法	基金经理	2017年04月	-	14年	男，软件工程硕士。历任华夏基金管理有限公司金融工程师量化研究员。2014年3月加盟本公司，历任股票研究员、基金经理助理。

注：1、上述任职日期/离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

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

本报告期内，本基金运作合法合规，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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不公平交易等导致的利益输送行为，公平交易制度的整体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未产生同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易，未导致不公平交易和利益输送。

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

报告期内，本基金跟踪误差在合理范围之内，其来源主要是申购赎回、标的指数样本股调整、分红和打新因素。当由于申赎或打新锁定等情况可能对指数跟踪效果带来影响时，本基金坚持既定的指数化投资策略，对指数基金采取被动复制与基于风险控制的组合优化相结合的方式跟踪指数。报告期内，本基金整体运行平稳。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2021年06月30日，天弘中证800A基金份额净值为1.4116元，天弘中证800C基金份额净值为1.3927元。报告期内份额净值增长率天弘中证800A为3.73%，同期业绩比较基准增长率为1.69%；天弘中证800C为3.63%，同期业绩比较基准增长率为1.69%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2021年二季度国内GDP同比增长7.9%，两年平均增长5.5%；上半年GDP同比增长12.7%，两年平均增长5.3%，符合预期，经济已经形成稳中加固的恢复态势。而从结构上看，主要经济数据分项中，上半年进出口表现、社会零售品总额增速、工业增加值、

固定资产投资增速等主要指标均好于市场预期，而比较能代表经济内生动能的制造业投资明显向好，即便受到了局部疫情的扰动，消费也维持了逐渐改善态势，这对经济后续的稳步恢复也将起到较强的支撑作用，今年三季度和四季度两年平均GDP增速大概率仍将继续向好。

展望下半年的经济，尽管全球范围的疫情仍在反复以及国内局部洪涝灾害的短期扰动增加了经济运行的不确定性，但随着生产的稳健恢复以及需求的继续回升，经济发展稳中向好态势不会改变，同时，国内中长期政策加快落地，浦东“社会主义现代化建设引领区”方案印发，再次强化了对科技创新的大力支持；全国碳市场正式开始交易，能源革命的大幕已经拉开，在科技创新和能源革命的两大浪潮推动下，中国经济的高质量发展、绿色发展的长期动力非常充沛。

从2019年年初开始的这轮较好的行情已经持续了两年半的时间，但结构非常极端和不均衡，某些行业的估值已经创了历史新高，有些行业也创了新低，市场整体的估值水平和发展速度还是匹配的，没有出现明显的整体高估现象。伴随着出乎预期再次降准的落地，机构投资者对下半年货币趋紧的一致预期也开始分化，不再像之前那样悲观，同时，国家的产业政策和鼓励方向也非常明确，展望下半年，在科技创新和碳中和的大背景下，有理由相信国内资本市场在半导体、人工智能、生物医药、新能源、智能制造等领域快速发展驱动下会出现长期繁荣的走势。

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

本报告期内，本基金托管人在对天弘中证800指数型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，天弘中证800指数型发起式证券投资基金的管理人——天弘基金管理有限公司在天弘中证800指数型发起式证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对天弘基金管理有限公司编制和披露的天弘中证800指数型发起式证券投资基金2021年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800指数型发起式证券投资基金

报告截止日：2021年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末	上年度末
----	-----	-----	------

		2021年06月30日	2020年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	3,114,973.51	3,711,103.09
结算备付金		9,718.45	4,621.92
存出保证金		13,489.49	97,770.07
交易性金融资产	6.4.7.2	51,824,538.88	53,459,725.91
其中：股票投资		51,789,740.17	53,430,525.91
基金投资		-	-
债券投资		34,798.71	29,200.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	655.15	826.10
应收股利		-	-
应收申购款		291,043.49	128,766.38
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		55,254,418.97	57,402,813.47
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	137,048.17
应付赎回款		459,033.45	712,303.48
应付管理人报酬		22,245.28	23,409.38

应付托管费		4,449.04	4,681.87
应付销售服务费		5,194.82	5,435.24
应付交易费用	6.4.7.7	2,149.41	6,001.14
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	72,542.17	188,113.49
负债合计		565,614.17	1,076,992.77
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	39,051,104.29	41,698,216.55
未分配利润	6.4.7.10	15,637,700.51	14,627,604.15
所有者权益合计		54,688,804.80	56,325,820.70
负债和所有者权益总计		55,254,418.97	57,402,813.47

注：报告截止日2021年06月30日，天弘中证800指数型发起式证券投资基金A类基金份额净值1.4116元，天弘中证800指数型发起式证券投资基金C类基金份额净值1.3927元；基金份额总额39,051,104.29份，其中天弘中证800指数型发起式证券投资基金A类基金份额16,044,405.27份，天弘中证800指数型发起式证券投资基金C类基金份额23,006,699.02份。

6.2 利润表

会计主体：天弘中证800指数型发起式证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2021年01月01日至 2021年06月30日	2020年01月01日至2020年06月30日
一、收入		2,538,135.87	7,431,740.74
1. 利息收入		12,214.12	33,214.54
其中：存款利息收入	6.4.7.11	12,195.76	33,212.98
债券利息收入		18.36	1.56

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）		3,366,984.77	15,317,022.13
其中：股票投资收益	6.4.7.12	2,964,034.60	14,521,787.73
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	12,012.02	2,046.24
资产支持证券投资 收益	6.4.7.13. 3	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	390,938.15	793,188.16
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-859,398.36	-7,943,647.80
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	18,335.34	25,151.87
减：二、费用		289,267.25	780,877.82
1. 管理人报酬		131,857.41	332,800.48
2. 托管费		26,371.45	66,560.10
3. 销售服务费		30,980.52	22,731.15
4. 交易费用	6.4.7.19	19,591.10	254,114.26
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	6.4.7.20	80,466.77	104,671.83

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		2,248,868.62	6,650,862.92
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		2,248,868.62	6,650,862.92

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：天弘中证800指数型发起式证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	41,698,216.55	14,627,604.15	56,325,820.70
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	2,248,868.62	2,248,868.62
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）	-2,647,112.26	-1,238,772.26	-3,885,884.52
其中：1. 基金申购款	27,365,860.62	10,217,516.17	37,583,376.79
2. 基金赎回款	-30,012,972.88	-11,456,288.43	-41,469,261.31
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）	39,051,104.29	15,637,700.51	54,688,804.80
项 目	上年度可比期间		

	2020年01月01日至2020年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	143,898,357.59	-336,530.56	143,561,827.03
二、本期经营活动产 生的基金净值变动 数(本期利润)	-	6,650,862.92	6,650,862.92
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)	-118,038,856.96	-4,144,958.28	-122,183,815.24
其中: 1. 基金申购款	69,286,543.65	-1,230,941.38	68,055,602.27
2. 基金赎回 款	-187,325,400.61	-2,914,016.90	-190,239,417.51
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)	25,859,500.63	2,169,374.08	28,028,874.71

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800指数型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]1339号《关于准予天弘中证800指数型发起式证券投资基金注册的批复》注册,由天弘基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘中证800指数型发起式证券投资基金基金合同》负责

公开募集。本基金为契约型开放式发起式基金，存续期限不定，首次募集期间为2015年7月15日，首次设立募集不包括认购资金利息共募集10,000,000.00元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第959号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《天弘中证800指数型发起式证券投资基金基金合同》于2015年7月16日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为10,000,000.00份基金份额。本基金的基金管理人为天弘基金管理有限公司，基金托管人为广发证券股份有限公司。

根据《天弘中证800指数型发起式证券投资基金基金合同》和《天弘中证800指数型发起式证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金根据申购费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。认购/申购、赎回基金时收取认/申购费用、赎回费用，而不是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为天弘中证800指数型发起式证券投资基金A类(以下简称“A类基金”)；认购/申购、赎回基金时不收取认/申购费用、赎回费用，而是在本类别基金资产中计提销售服务费的，称为天弘中证800指数型发起式证券投资基金C类(以下简称“C类基金”)。本基金A类和C类两种收费模式并存，由于基金费用的不同，本基金A类基金份额及C类基金份额分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。投资者可自行选择申购某一类别的基金份额，但各类别基金份额之间不能相互转换。

本基金为发起式基金，基金募集份额总额不少于1,000万份，基金募集金额不少于1,000万元，其中基金管理人作为发起资金的提供方认购的金额为1,000万元且承诺持有期限不少于三年。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘中证800指数型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，以中证800指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于其他股票（非标的指数成份股及其备选成份股，含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、银行存款、债券、债券回购、权证、股指期货、资产支持证券、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金可以根据相关法律法规的规定参与融资和转融通证券出借业务。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。本基金投资于股票的资产比例不低于基金资产的90%，投资于中证800指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的80%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准：中证800指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。

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800指数型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2021年度上半年财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2021年06月30日的财务状况以及2021年度上半年的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

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

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

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

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
活期存款	3,114,973.51
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	3,114,973.51

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末
----	-----

		2021年06月30日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		44,703,779.38	51,789,740.17	7,085,960.79
贵金属投资-金交所黄金合约		-	-	-
债券	交易所市场	33,900.00	34,798.71	898.71
	银行间市场	-	-	-
	合计	33,900.00	34,798.71	898.71
资产支持证券		-	-	-
基金		-	-	-
其他		-	-	-
合计		44,737,679.38	51,824,538.88	7,086,859.50

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 2021年06月30日
应收活期存款利息	642.19
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	4.30

应收债券利息	2.56
应收资产支持证券利息	-
应收买入返售证券利息	-
应收申购款利息	-
应收黄金合约拆借孳息	-
应收出借证券利息	-
其他	6.10
合计	655.15

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
交易所市场应付交易费用	2,149.41
银行间市场应付交易费用	-
合计	2,149.41

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	75.40
应付证券出借违约金	-
预提费用	64,466.77
其他应付	8,000.00
合计	72,542.17

6.4.7.9 实收基金

6.4.7.9.1 天弘中证800A

金额单位：人民币元

项目 (天弘中证800A)	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	17,091,316.79	17,091,316.79
本期申购	9,937,464.51	9,937,464.51
本期赎回(以“-”号填列)	-10,984,376.03	-10,984,376.03
本期末	16,044,405.27	16,044,405.27

6.4.7.9.2 天弘中证800C

金额单位：人民币元

项目 (天弘中证800C)	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	24,606,899.76	24,606,899.76
本期申购	17,428,396.11	17,428,396.11
本期赎回(以“-”号填列)	-19,028,596.85	-19,028,596.85
本期末	23,006,699.02	23,006,699.02

注：申购含转换转入份额；赎回含转换转出份额。

6.4.7.10 未分配利润

6.4.7.10.1 天弘中证800A

单位：人民币元

项目 (天弘中证800A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	6,040,155.06	125,727.11	6,165,882.17
本期利润	1,309,944.55	-402,742.49	907,202.06
本期基金份额交易产生的变动数	-367,759.48	-101,866.26	-469,625.74
其中：基金申购款	3,911,452.14	-29,856.50	3,881,595.64
基金赎回款	-4,279,211.62	-72,009.76	-4,351,221.38

本期已分配利润	-	-	-
本期末	6,982,340.13	-378,881.64	6,603,458.49

6.4.7.10.2 天弘中证800C

单位：人民币元

项目 (天弘中证800C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	8,317,053.58	144,668.40	8,461,721.98
本期利润	1,798,322.43	-456,655.87	1,341,666.56
本期基金份额交易产生的变动数	-512,909.88	-256,236.64	-769,146.52
其中：基金申购款	6,653,443.82	-317,523.29	6,335,920.53
基金赎回款	-7,166,353.70	61,286.65	-7,105,067.05
本期已分配利润	-	-	-
本期末	9,602,466.13	-568,224.11	9,034,242.02

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
活期存款利息收入	11,878.06
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	113.39
其他	204.31
合计	12,195.76

6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
卖出股票成交总额	12,809,422.56

减：卖出股票成本总额	9,845,387.96
买卖股票差价收入	2,964,034.60

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	12,012.02
债券投资收益——赎回差价收入	-
债券投资收益——申购差价收入	-
合计	12,012.02

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	136,430.07
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	124,400.00
减：应收利息总额	18.05
买卖债券差价收入	12,012.02

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期未取得资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期未取得贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益**6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入**

本基金本报告期未取得买卖权证差价收入。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期未取得其他衍生工具投资收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
股票投资产生的股利收益	390,938.15
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	390,938.15

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2021年01月01日至2021年06月30日
1. 交易性金融资产	-859,398.36
——股票投资	-860,297.07
——债券投资	898.71
——资产支持证券投资	-
——贵金属投资	-
——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-

合计	-859,398.36
----	-------------

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
基金赎回费收入	12,169.23
基金转换费收入	6,166.11
合计	18,335.34

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
交易所市场交易费用	19,591.10
银行间市场交易费用	-
合计	19,591.10

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
审计费用	24,795.19
信息披露费	39,671.58
证券出借违约金	-
指数使用费	16,000.00
合计	80,466.77

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、基金销售机构、基金注册登记机构
广发证券股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
内蒙古君正能源化工集团股份有限公司	基金管理人的股东

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日	
	成交金额	占当期 股票成 交总额 的比例	成交金额	占当期 股票成 交总额 的比例
广发证券股份有限公司	21,177,846.83	100.00%	165,447,175.30	80.62%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券股份有限公司	4,898.68	100.00%	2,149.41	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券股份有限公司	44,061.07	71.98%	34,435.24	74.21%

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

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	131,857.41	332,800.48
其中：支付销售机构的客户维护费	35,550.21	28,233.79

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	上年度可比期间
	2021年01月01日至2021年06月30日	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	26,371.45	66,560.10

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

6.4.10.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2021年01月01日至2021年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	天弘中证800A	天弘中证800C	合计
天弘基金管理有限公司	-	17,786.16	17,786.16
广发证券股份有限公司	-	408.24	408.24
合计	-	18,194.40	18,194.40
获得销售服务费的	上年度可比期间		
	2020年01月01日至2020年06月30日		

各关联方名称	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	天弘中证800A	天弘中证800C	合计
天弘基金管理有限公司	-	10,704.37	10,704.37
广发证券股份有限公司	-	227.55	227.55
合计	-	10,931.92	10,931.92

注：1、支付基金销售机构的销售服务费按前一日各级基金资产净值的约定年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给天弘基金管理有限公司，再由天弘基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。天弘中证800C按0.20%计提销售服务费。销售服务费的计算公式为：

日销售服务费=前一日各级基金资产净值×该日适用费率/当年天数。

2、天弘中证800A不收取销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行过银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

天弘中证800A

份额单位：份

项目	本期 2021年01月01日至 2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至 2020年06月30日
报告期初持有的基金份额	-	5,000,000.00
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	5,000,000.00
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

天弘中证800C

份额单位：份

项目	本期 2021年01月01日至 2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至 2020年06月30日
报告期初持有的基金份额	-	17,236,632.82
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	17,236,632.82
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

注：1、基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

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

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

本基金本期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
广发证券股份有限公司	3,114,973.51	11,878.06	1,888,435.71	31,520.53

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

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券交易。

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本报告期末，本基金（因追踪指数成份股而被动）持有君正集团的股票，估值总额为人民币33,594.00元（上年度末：35,640.00元），占基金资产净值的比例为0.06%（上年度末：0.06%）；持有广发证券的股票，估值总额为人民币86,298.00元（上年度末：102,564.00元），占基金资产净值的比例为0.16%（上年度末：0.18%）。

6.4.11 利润分配情况——按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

本基金本报告期无利润分配事项。

6.4.12 期末（2021年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
605287	德才股份	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	31.56	31.56	327	10,320.12	10,320.12	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购	可流通日	流通受限	认购价格	期末估值	数量（单	期末成本	期末估值	备注

		日		类型		单价	位：张)	总额	总额	
113050	南银转债	2021-06-15	2021-07-01	新债未上市	100.00	100.00	240	24,000.00	24,000.00	-
127038	国微转债	2021-06-10	2021-07-14	新债未上市	100.00	100.00	20	2,000.00	2,000.00	-
113049	长汽转债	2021-06-10	2021-07-08	新债未上市	100.00	100.00	20	2,000.00	2,000.00	-
113051	节能转债	2021-06-21	2021-07-22	新债未上市	100.00	100.00	20	2,000.00	2,000.00	-
123117	健帆转债	2021-06-23	2021-07-12	新债未上市	100.00	100.00	10	1,000.00	1,000.00	-

注：1、基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金参与网下申购获得的新股或作为战略投资者参与配售获得的新股，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金参与网上申购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

2、以上“可流通日”的日期，最终以上市公司公告为准。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
600460	士兰微	2021-06-30	因刊登重要事项公	56.35	2021-07-01	59.49	1,500	25,103.56	84,525.00	-

			告							
600811	东方集团	2021-06-30	拟筹划重大资产重组	3.05	2021-07-14	3.36	5,800	23,869.41	17,690.00	-
002024	苏宁易购	2021-06-16	未刊登重要事项(未如期刊登临时公告)	5.59	2021-07-06	6.15	7,200	72,644.78	40,248.00	-

注:本基金截至2021年06月30日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,该类股票将在所公布事项的重大影响消除后,经交易所批准复牌。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2021年06月30日,本基金未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2021年06月30日,本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

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

本基金为股票型指数基金,采用指数复制投资策略,按照个股在标的指数中的基准权重构建股票组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应地调整,以复制和

跟踪标的指数。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，力争获取高于标的指数的投资收益。

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

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

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广发证券股份有限公司开立于具有基金托管资格的中国建设银行股份有限公司的托管账户，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本

基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级的债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级的同业存单。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	26,000.00	28,000.00
AAA以下	8,798.71	1,200.00
未评级	-	-
合计	34,798.71	29,200.00

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级的同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方

面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。此外，基金管理人经与基金托管人协商，在确保投资者得到公平对待的前提下，可依照法律法规及基金合同的约定，综合运用各类流动性风险管理工具，对赎回申请等进行适度调整，作为特定情形下基金管理人流动性风险管理的辅助措施。

于2021年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时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注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%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查

与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了交易对手管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年06月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,114,973.51	-	-	-	3,114,973.51
结算备付金	9,718.45	-	-	-	9,718.45
存出保证金	13,489.49	-	-	-	13,489.49
交易性金融资产	-	-	34,798.71	51,789,740.17	51,824,538.88
应收利息	-	-	-	655.15	655.15
应收申购款	-	-	-	291,043.49	291,043.49
资产总计	3,138,181.45	-	34,798.71	52,081,438.81	55,254,418.97
负债					
应付赎回款	-	-	-	459,033.45	459,033.45
应付管理人报酬	-	-	-	22,245.28	22,245.28
应付托管费	-	-	-	4,449.04	4,449.04
应付销售服务费	-	-	-	5,194.82	5,194.82

应付交易费用	-	-	-	2,149.41	2,149.41
其他负债	-	-	-	72,542.17	72,542.17
负债总计	-	-	-	565,614.17	565,614.17
利率敏感度缺口	3,138,181.45	-	34,798.71	51,515,824.64	54,688,804.80
上年度末 2020年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	3,711,103.09	-	-	-	3,711,103.09
结算备付金	4,621.92	-	-	-	4,621.92
存出保证金	97,770.07	-	-	-	97,770.07
交易性金融资产	-	-	29,200.00	53,430,525.91	53,459,725.91
应收利息	-	-	-	826.10	826.10
应收申购款	-	-	-	128,766.38	128,766.38
资产总计	3,813,495.08	-	29,200.00	53,560,118.39	57,402,813.47
负债					
应付证券清算款	-	-	-	137,048.17	137,048.17
应付赎回款	-	-	-	712,303.48	712,303.48
应付管理人报酬	-	-	-	23,409.38	23,409.38
应付托管费	-	-	-	4,681.87	4,681.87
应付销售服务费	-	-	-	5,435.24	5,435.24
应付交易费用	-	-	-	6,001.14	6,001.14
其他负债	-	-	-	188,113.49	188,113.49
负债总计	-	-	-	1,076,992.77	1,076,992.77
利率敏感度缺口	3,813,495.08	-	29,200.00	52,483,125.62	56,325,820.70

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2021年06月30日，本基金持有的交易性债券投资占基金资产净值的比例为0.06%（2020年12月31日：0.05%），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2020年12月31日：同）。

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或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金采用完全复制法进行指数化投资，股票资产跟踪的标的指数为中证800指数，通过指数化分散投资降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括VaR (Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日		上年度末 2020年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	51,789,740.17	94.70	53,430,525.91	94.86
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	51,789,740.17	94.70	53,430,525.91	94.86

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变	
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）

		本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
	业绩比较基准上升5%	3,144,606.28	2,816,291.04
	业绩比较基准下降5%	-3,144,606.28	-2,816,291.04

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2021年06月30日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为51,640,755.76元，属于第二层次的余额为183,783.12元，无属于第三层次的余额(2020年12月31日：第一层次53,249,947.83元，第二层次209,778.08元，无属于第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2021年06月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2020年12月31日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	51,789,740.17	93.73
	其中：股票	51,789,740.17	93.73
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	34,798.71	0.06
	其中：债券	34,798.71	0.06
	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	3,124,691.96	5.66
8	其他各项资产	305,188.13	0.55
9	合计	55,254,418.97	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	534,338.00	0.98
B	采矿业	1,272,581.02	2.33
C	制造业	29,475,082.02	53.90
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	955,823.50	1.75
E	建筑业	720,070.39	1.32

F	批发和零售业	686,642.67	1.26
G	交通运输、仓储和邮政业	1,396,907.50	2.55
H	住宿和餐饮业	63,725.00	0.12
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,388,639.98	4.37
J	金融业	10,137,917.31	18.54
K	房地产业	1,210,197.09	2.21
L	租赁和商务服务业	910,213.80	1.66
M	科学研究和技术服务业	567,234.52	1.04
N	水利、环境和公共设施管理业	101,295.41	0.19
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	56,036.88	0.10
Q	卫生和社会工作	845,005.80	1.55
R	文化、体育和娱乐业	291,229.80	0.53
S	综合	104,736.40	0.19
	合计	51,717,677.09	94.57

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	30,483.29	0.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,685.20	0.01
E	建筑业	10,320.12	0.02
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	-	-

	术服务业		
J	金融业	27,574.47	0.05
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	72,063.08	0.13

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	1,200	2,468,040.00	4.51
2	601318	中国平安	20,445	1,314,204.60	2.40
3	600036	招商银行	23,400	1,268,046.00	2.32
4	000858	五粮液	3,697	1,101,299.33	2.01
5	601012	隆基股份	8,212	729,554.08	1.33
6	000333	美的集团	9,286	662,741.82	1.21
7	600276	恒瑞医药	8,515	578,764.55	1.06
8	002415	海康威视	8,875	572,437.50	1.05
9	601888	中国中免	1,900	570,190.00	1.04
10	601166	兴业银行	27,500	565,125.00	1.03
11	300059	东方财富	15,626	512,376.54	0.94

12	603259	药明康德	3,128	489,813.52	0.90
13	000651	格力电器	9,100	474,110.00	0.87
14	002594	比亚迪	1,700	426,700.00	0.78
15	600887	伊利股份	11,500	423,545.00	0.77
16	000001	平安银行	18,300	413,946.00	0.76
17	600030	中信证券	16,100	401,534.00	0.73
18	600900	长江电力	19,300	398,352.00	0.73
19	002475	立讯精密	8,482	390,172.00	0.71
20	000725	京东方 A	57,500	358,800.00	0.66
21	601398	工商银行	66,200	342,254.00	0.63
22	000568	泸州老窖	1,400	330,316.00	0.60
23	300015	爱尔眼科	4,590	325,798.20	0.60
24	600031	三一重工	11,200	325,584.00	0.60
25	600309	万华化学	2,980	324,283.60	0.59
26	600809	山西汾酒	700	313,600.00	0.57
27	603288	海天味业	2,422	312,316.90	0.57
28	002714	牧原股份	5,020	305,316.40	0.56
29	000002	万科 A	12,801	304,791.81	0.56
30	603501	XD 韦尔股	900	289,800.00	0.53
31	601919	中远海控	9,300	284,022.00	0.52
32	688111	金山办公	696	274,780.80	0.50
33	600436	片仔癀	600	268,980.00	0.49
34	601328	交通银行	51,900	254,310.00	0.47
35	601899	紫金矿业	26,000	251,940.00	0.46
36	002304	洋河股份	1,200	248,640.00	0.45
37	002142	宁波银行	6,350	247,459.50	0.45
38	300122	智飞生物	1,300	242,749.00	0.44
39	002352	顺丰控股	3,500	236,950.00	0.43
40	002230	科大讯飞	3,400	229,772.00	0.42
41	600000	浦发银行	22,600	226,000.00	0.41
42	600438	通威股份	5,200	225,004.00	0.41

43	300274	阳光电源	1,940	223,216.40	0.41
44	300014	亿纬锂能	2,145	222,929.85	0.41
45	300124	汇川技术	3,000	222,780.00	0.41
46	002812	恩捷股份	900	210,690.00	0.39
47	000100	TCL科技	27,100	207,315.00	0.38
48	601816	京沪高铁	37,300	197,317.00	0.36
49	002241	歌尔股份	4,602	196,689.48	0.36
50	000661	长春高新	500	193,500.00	0.35
51	300347	泰格医药	1,000	193,300.00	0.35
52	600837	海通证券	16,700	192,050.00	0.35
53	002271	东方雨虹	3,450	190,854.00	0.35
54	600585	海螺水泥	4,601	188,871.05	0.35
55	601668	XD中国建	40,480	188,232.00	0.34
56	002027	分众传媒	19,860	186,882.60	0.34
57	601601	XD中国太	6,450	186,856.50	0.34
58	300142	沃森生物	3,000	185,100.00	0.34
59	600690	海尔智家	7,100	183,961.00	0.34
60	000063	中兴通讯	5,500	182,765.00	0.33
61	002460	赣锋锂业	1,501	181,756.09	0.33
62	600016	民生银行	41,040	180,986.40	0.33
63	603986	兆易创新	952	178,880.80	0.33
64	603799	华友钴业	1,516	173,127.20	0.32
65	601288	农业银行	55,400	167,862.00	0.31
66	600048	保利地产	13,900	167,356.00	0.31
67	600196	复星医药	2,300	165,899.00	0.30
68	000338	潍柴动力	9,200	164,404.00	0.30
69	600763	通策医疗	400	164,400.00	0.30
70	600919	江苏银行	22,950	162,945.00	0.30
71	601229	上海银行	19,170	157,194.00	0.29
72	601688	华泰证券	9,701	153,275.80	0.28
73	600660	福耀玻璃	2,700	150,795.00	0.28

74	600703	三安光电	4,700	150,635.00	0.28
75	600570	恒生电子	1,608	149,946.00	0.27
76	600104	上汽集团	6,802	149,439.94	0.27
77	601211	国泰君安	8,700	149,118.00	0.27
78	002129	中环股份	3,800	146,680.00	0.27
79	601766	中国中车	23,500	142,880.00	0.26
80	601169	北京银行	28,600	139,282.00	0.25
81	002371	北方华创	500	138,690.00	0.25
82	600999	招商证券	7,140	135,802.80	0.25
83	600019	宝钢股份	17,192	131,346.88	0.24
84	002311	海大集团	1,600	130,560.00	0.24
85	600406	国电南瑞	5,400	125,496.00	0.23
86	601988	中国银行	40,700	125,356.00	0.23
87	601088	中国神华	6,400	124,928.00	0.23
88	002049	紫光国微	800	123,352.00	0.23
89	300498	温氏股份	8,580	123,294.60	0.23
90	002709	天赐材料	1,154	122,993.32	0.22
91	002410	广联达	1,800	122,760.00	0.22
92	601818	光大银行	31,400	118,692.00	0.22
93	000538	云南白药	1,002	115,951.44	0.21
94	000625	长安汽车	4,400	115,632.00	0.21
95	300450	先导智能	1,920	115,468.80	0.21
96	600050	XD中国联	26,700	115,344.00	0.21
97	600028	中国石化	25,800	112,488.00	0.21
98	002821	凯莱英	300	111,780.00	0.20
99	600893	航发动力	2,100	111,699.00	0.20
10 0	601628	中国人寿	3,200	108,448.00	0.20
10 1	600346	恒力石化	4,120	108,108.80	0.20
10	600745	闻泰科技	1,100	106,590.00	0.19

2					
10 3	600588	用友网络	3,161	105,134.86	0.19
10 4	601633	长城汽车	2,400	104,616.00	0.19
10 5	300601	康泰生物	700	104,300.00	0.19
10 6	601390	中国中铁	19,700	103,228.00	0.19
10 7	000799	酒鬼酒	400	102,240.00	0.19
10 8	601009	南京银行	9,600	100,992.00	0.18
10 9	601377	兴业证券	10,400	100,464.00	0.18
11 0	600132	重庆啤酒	500	98,975.00	0.18
11 1	601857	中国石油	18,700	98,923.00	0.18
11 2	300413	芒果超媒	1,370	93,982.00	0.17
11 3	600089	特变电工	7,162	92,031.70	0.17
11 4	000009	中国宝安	5,020	91,715.40	0.17
11 5	601225	陕西煤业	7,700	91,245.00	0.17
11 6	600009	上海机场	1,886	90,773.18	0.17
11 7	002601	龙蟠佰利	2,600	89,908.00	0.16
11 8	600426	华鲁恒升	2,890	89,445.50	0.16

119	300408	三环集团	2,100	89,082.00	0.16
120	002493	荣盛石化	5,100	88,077.00	0.16
121	002074	国轩高科	2,000	87,120.00	0.16
122	300595	欧普康视	840	86,982.00	0.16
123	600111	北方稀土	4,200	86,940.00	0.16
124	603486	科沃斯	380	86,670.40	0.16
125	002001	新和成	3,020	86,613.60	0.16
126	601939	建设银行	13,000	86,450.00	0.16
127	000776	广发证券	5,700	86,298.00	0.16
128	002179	中航光电	1,088	85,973.76	0.16
129	300433	蓝思科技	2,900	85,289.00	0.16
130	600460	士兰微	1,500	84,525.00	0.15
131	600926	杭州银行	5,720	84,370.00	0.15
132	002050	三花智控	3,513	84,241.74	0.15
133	688036	传音控股	400	83,800.00	0.15
134	603806	福斯特	785	82,527.05	0.15
13	600958	东方证券	8,200	81,918.00	0.15

5					
13 6	000166	申万宏源	17,420	81,525.60	0.15
13 7	600741	华域汽车	3,100	81,437.00	0.15
13 8	600600	青岛啤酒	700	80,955.00	0.15
13 9	300003	乐普医疗	2,500	80,300.00	0.15
14 0	603882	金域医学	500	79,885.00	0.15
14 1	600584	长电科技	2,100	79,128.00	0.14
14 2	002007	华兰生物	2,155	79,045.40	0.14
14 3	000786	北新建材	2,000	78,500.00	0.14
14 4	002340	格林美	8,250	77,137.50	0.14
14 5	601901	方正证券	8,100	75,816.00	0.14
14 6	000963	华东医药	1,647	75,778.47	0.14
14 7	000157	中联重科	8,200	75,768.00	0.14
14 8	601006	大秦铁路	11,500	75,670.00	0.14
14 9	601233	桐昆股份	3,100	74,679.00	0.14
15 0	002841	视源股份	600	74,574.00	0.14
15 1	601336	新华保险	1,601	73,501.91	0.13

15 2	000895	双汇发展	2,300	73,140.00	0.13
15 3	300285	国瓷材料	1,500	73,125.00	0.13
15 4	600015	华夏银行	11,800	73,042.00	0.13
15 5	600143	金发科技	3,500	73,010.00	0.13
15 6	002236	大华股份	3,450	72,795.00	0.13
15 7	601100	恒立液压	844	72,516.48	0.13
15 8	601989	中国重工	17,600	72,512.00	0.13
15 9	688396	华润微	793	72,178.86	0.13
16 0	600176	中国巨石	4,601	71,361.51	0.13
16 1	000768	中航西飞	2,700	70,956.00	0.13
16 2	601155	新城控股	1,700	70,720.00	0.13
16 3	603993	洛阳钼业	13,700	70,692.00	0.13
16 4	601877	正泰电器	2,100	70,098.00	0.13
16 5	600760	中航沈飞	1,160	69,948.00	0.13
16 6	601658	邮储银行	13,800	69,276.00	0.13
16 7	300529	健帆生物	800	69,088.00	0.13
16	600352	浙江龙盛	5,000	68,700.00	0.13

8					
169	300207	欣旺达	2,100	68,376.00	0.13
170	600010	包钢股份	44,000	68,200.00	0.12
171	601788	光大证券	3,800	67,982.00	0.12
172	601799	星宇股份	300	67,716.00	0.12
173	600547	山东黄金	3,516	67,577.52	0.12
174	001979	招商蛇口	6,100	66,795.00	0.12
175	601600	中国铝业	12,600	66,780.00	0.12
176	601186	中国铁建	8,900	66,127.00	0.12
177	688012	中微公司	396	65,704.32	0.12
178	600885	宏发股份	1,040	65,208.00	0.12
179	002202	金风科技	5,351	65,068.16	0.12
180	603369	今世缘	1,200	64,992.00	0.12
181	002185	华天科技	4,200	64,638.00	0.12
182	002008	大族激光	1,600	64,624.00	0.12
183	000876	新希望	4,301	63,095.67	0.12
184	688029	南微医学	200	62,338.00	0.11

18 5	000938	紫光股份	2,823	61,767.24	0.11
18 6	003816	中国广核	22,800	60,876.00	0.11
18 7	300316	晶盛机电	1,200	60,600.00	0.11
18 8	002736	国信证券	5,600	60,200.00	0.11
18 9	002555	三七互娱	2,500	60,050.00	0.11
19 0	601066	中信建投	1,900	59,717.00	0.11
19 1	600109	国金证券	4,700	59,643.00	0.11
19 2	603899	晨光文具	700	59,192.00	0.11
19 3	000069	华侨城 A	7,900	58,776.00	0.11
19 4	601138	工业富联	4,700	58,327.00	0.11
19 5	000425	徐工机械	9,100	57,967.00	0.11
19 6	601669	中国电建	14,800	57,276.00	0.10
19 7	600733	北汽蓝谷	4,200	56,616.00	0.10
19 8	600795	国电电力	23,200	56,376.00	0.10
19 9	000977	浪潮信息	2,000	56,260.00	0.10
20 0	688008	澜起科技	896	55,892.48	0.10
20	601636	旗滨集团	3,000	55,680.00	0.10

1					
20 2	000783	长江证券	7,600	55,632.00	0.10
20 3	603019	中科曙光	2,000	55,220.00	0.10
20 4	603659	璞泰来	400	54,640.00	0.10
20 5	300558	贝达药业	500	54,120.00	0.10
20 6	603833	欧派家居	380	53,944.80	0.10
20 7	002624	完美世界	2,250	53,797.50	0.10
20 8	600079	人福医药	1,902	53,769.54	0.10
20 9	601838	成都银行	4,200	53,088.00	0.10
21 0	600183	生益科技	2,265	53,023.65	0.10
21 1	603444	吉比特	100	53,000.00	0.10
21 2	600886	国投电力	5,500	52,855.00	0.10
21 3	300146	汤臣倍健	1,600	52,640.00	0.10
21 4	300253	卫宁健康	3,200	52,064.00	0.10
21 5	603160	汇顶科技	400	51,852.00	0.09
21 6	600029	南方航空	8,600	51,772.00	0.09
21 7	300144	宋城演艺	3,080	51,744.00	0.09

21 8	600884	杉杉股份	2,200	51,304.00	0.09
21 9	601985	中国核电	10,100	51,106.00	0.09
22 0	002648	卫星石化	1,300	50,947.00	0.09
22 1	601555	东吴证券	6,090	50,790.60	0.09
22 2	603517	绝味食品	600	50,574.00	0.09
22 3	002600	领益智造	5,500	50,545.00	0.09
22 4	600779	水井坊	400	50,540.00	0.09
22 5	601108	财通证券	4,800	50,352.00	0.09
22 6	300628	亿联网络	600	50,280.00	0.09
22 7	002938	鹏鼎控股	1,400	50,232.00	0.09
22 8	000066	中国长城	3,437	50,180.20	0.09
22 9	002607	中公教育	2,400	50,136.00	0.09
23 0	601360	三六零	4,100	50,061.00	0.09
23 1	300037	新宙邦	500	50,050.00	0.09
23 2	300677	英科医疗	400	49,920.00	0.09
23 3	600219	南山铝业	13,860	49,896.00	0.09
23	603737	三棵树	280	49,280.00	0.09

4					
23 5	002353	杰瑞股份	1,100	49,170.00	0.09
23 6	601607	上海医药	2,290	48,387.70	0.09
23 7	000596	古井贡酒	201	48,139.50	0.09
23 8	600522	中天科技	4,800	48,000.00	0.09
23 9	002384	东山精密	2,300	47,932.00	0.09
24 0	002044	美年健康	5,260	47,918.60	0.09
24 1	600563	法拉电子	300	47,508.00	0.09
24 2	300676	华大基因	400	47,440.00	0.09
24 3	603589	口子窖	700	47,383.00	0.09
24 4	000547	航天发展	2,497	47,118.39	0.09
24 5	002602	世纪华通	7,295	46,833.90	0.09
24 6	002138	顺络电子	1,200	46,524.00	0.09
24 7	300136	信维通信	1,500	46,320.00	0.08
24 8	600872	中炬高新	1,100	46,222.00	0.08
24 9	601099	太平洋	13,400	45,426.00	0.08
25 0	002414	高德红外	1,643	45,313.94	0.08

25 1	601111	中国国航	5,800	45,124.00	0.08
25 2	300033	同花顺	400	45,112.00	0.08
25 3	002508	老板电器	970	45,105.00	0.08
25 4	600085	同仁堂	1,100	44,935.00	0.08
25 5	688099	晶晨股份	400	44,880.00	0.08
25 6	600362	江西铜业	2,000	44,760.00	0.08
25 7	601800	中国交建	6,900	44,712.00	0.08
25 8	600486	扬农化工	400	44,708.00	0.08
25 9	600115	中国东航	8,800	44,704.00	0.08
26 0	601916	浙商银行	11,200	44,464.00	0.08
26 1	002444	巨星科技	1,300	44,304.00	0.08
26 2	600161	XD天坛生	1,293	44,285.25	0.08
26 3	601168	西部矿业	3,700	44,141.00	0.08
26 4	600383	金地集团	4,300	44,032.00	0.08
26 5	002625	光启技术	2,110	43,909.10	0.08
26 6	002223	鱼跃医疗	1,150	43,849.50	0.08
26	688208	道通科技	500	43,495.00	0.08

7					
26 8	000703	恒逸石化	3,638	43,474.10	0.08
26 9	600061	国投资本	5,016	42,585.84	0.08
27 0	000636	风华高科	1,400	42,308.00	0.08
27 1	000860	顺鑫农业	1,000	42,180.00	0.08
27 2	600315	上海家化	700	42,098.00	0.08
27 3	601618	中国中冶	14,100	42,018.00	0.08
27 4	000708	中信特钢	2,000	41,680.00	0.08
27 5	600739	辽宁成大	2,000	41,620.00	0.08
27 6	002797	第一创业	5,800	41,412.00	0.08
27 7	002078	太阳纸业	3,100	41,385.00	0.08
27 8	000830	鲁西化工	2,200	41,206.00	0.08
27 9	601117	中国化学	4,700	41,172.00	0.08
28 0	000728	国元证券	5,140	40,965.80	0.07
28 1	600699	均胜电子	1,600	40,832.00	0.07
28 2	600705	中航资本	10,500	40,635.00	0.07
28 3	002439	启明星辰	1,400	40,614.00	0.07

28 4	600068	葛洲坝	5,400	40,446.00	0.07
28 5	300223	北京君正	400	40,368.00	0.07
28 6	002024	苏宁易购	7,200	40,248.00	0.07
28 7	600392	盛和资源	2,310	40,101.60	0.07
28 8	600862	中航高科	1,300	40,014.00	0.07
28 9	601127	小康股份	600	40,002.00	0.07
29 0	002422	科伦药业	2,000	39,900.00	0.07
29 1	600754	锦江酒店	700	39,865.00	0.07
29 2	601021	春秋航空	700	39,830.00	0.07
29 3	002252	上海莱士	5,300	39,697.00	0.07
29 4	300088	长信科技	4,800	39,648.00	0.07
29 5	688002	睿创微纳	396	39,532.68	0.07
29 6	002030	达安基因	1,858	39,463.92	0.07
29 7	002385	大北农	5,800	39,440.00	0.07
29 8	600704	物产中大	5,000	39,350.00	0.07
29 9	601878	浙商证券	3,000	39,240.00	0.07
29	600606	绿地控股	7,200	39,240.00	0.07

9					
30 1	000630	铜陵有色	14,400	39,168.00	0.07
30 2	002916	深南电路	352	39,117.76	0.07
30 3	002250	联化科技	1,400	39,060.00	0.07
30 4	002180	纳思达	1,200	38,640.00	0.07
30 5	300357	我武生物	600	38,472.00	0.07
30 6	600989	宝丰能源	2,800	38,304.00	0.07
30 7	002075	沙钢股份	3,500	38,185.00	0.07
30 8	000513	丽珠集团	761	38,065.22	0.07
30 9	300699	光威复材	500	37,975.00	0.07
31 0	600150	中国船舶	2,300	37,973.00	0.07
31 1	002456	欧菲光	4,274	37,953.12	0.07
31 2	000039	中集集团	2,080	37,814.40	0.07
31 3	002507	涪陵榨菜	1,000	37,660.00	0.07
31 4	000988	华工科技	1,600	37,632.00	0.07
31 5	601238	广汽集团	2,900	37,555.00	0.07
31 6	600201	生物股份	2,147	37,465.15	0.07

31 7	002013	中航机电	3,700	37,259.00	0.07
31 8	600332	白云山	1,100	37,235.00	0.07
31 9	002028	思源电气	1,200	36,948.00	0.07
32 0	000807	云铝股份	3,100	36,890.00	0.07
32 1	600011	华能国际	8,700	36,714.00	0.07
32 2	000656	金科股份	6,300	36,477.00	0.07
32 3	603392	万泰生物	140	36,285.20	0.07
32 4	600177	雅戈尔	5,500	36,245.00	0.07
32 5	601997	贵阳银行	5,060	36,229.60	0.07
32 6	300001	特锐德	1,200	36,132.00	0.07
32 7	002157	正邦科技	3,000	35,850.00	0.07
32 8	002511	中顺洁柔	1,300	35,815.00	0.07
32 9	601727	上海电气	8,398	35,607.52	0.07
33 0	002212	天融信	1,800	35,586.00	0.07
33 1	002463	沪电股份	2,300	35,581.00	0.07
33 2	601933	永辉超市	7,500	35,475.00	0.06
33	600845	宝信软件	689	35,070.10	0.06

3					
33 4	002603	以岭药业	1,200	34,992.00	0.06
33 5	603939	益丰药房	620	34,775.80	0.06
33 6	600655	豫园股份	3,000	34,770.00	0.06
33 7	300308	中际旭创	900	34,668.00	0.06
33 8	600316	洪都航空	900	34,632.00	0.06
33 9	000021	深科技	1,800	34,452.00	0.06
34 0	600536	中国软件	600	34,158.00	0.06
34 1	002465	海格通信	3,600	34,056.00	0.06
34 2	002273	水晶光电	2,318	34,051.42	0.06
34 3	002080	中材科技	1,300	34,021.00	0.06
34 4	600549	厦门钨业	1,630	33,952.90	0.06
34 5	002092	中泰化学	3,300	33,891.00	0.06
34 6	000825	太钢不锈	4,500	33,705.00	0.06
34 7	300244	迪安诊断	880	33,704.00	0.06
34 8	300463	迈克生物	800	33,672.00	0.06
34 9	300482	万孚生物	520	33,638.80	0.06

350	601216	君正集团	6,600	33,594.00	0.06
351	601128	常熟银行	5,400	33,480.00	0.06
352	600171	上海贝岭	1,100	33,473.00	0.06
353	002690	美亚光电	600	33,456.00	0.06
354	600867	通化东宝	2,800	33,432.00	0.06
355	600521	华海药业	1,600	33,408.00	0.06
356	601162	天风证券	6,830	33,193.80	0.06
357	300009	安科生物	2,216	33,018.40	0.06
358	000983	山西焦煤	3,970	32,990.70	0.06
359	600489	中金黄金	3,800	32,756.00	0.06
360	600637	东方明珠	3,990	32,678.10	0.06
361	600066	宇通客车	2,600	32,474.00	0.06
362	600018	上港集团	6,800	32,436.00	0.06
363	000739	普洛药业	1,100	32,340.00	0.06
364	600879	航天电子	4,300	32,336.00	0.06
365	600418	江淮汽车	2,600	32,318.00	0.06
36	600516	方大炭素	4,333	32,237.52	0.06

6					
36 7	600118	中国卫星	1,100	32,186.00	0.06
36 8	603290	斯达半导	100	32,000.00	0.06
36 9	300070	碧水源	4,332	31,666.92	0.06
37 0	600369	西南证券	6,500	31,655.00	0.06
37 1	600038	XD中直股	600	31,644.00	0.06
37 2	600380	健康元	2,304	31,633.92	0.06
37 3	000750	国海证券	7,460	31,630.40	0.06
37 4	600487	亨通光电	2,760	31,464.00	0.06
37 5	601689	拓普集团	840	31,441.20	0.06
37 6	002152	广电运通	2,400	31,272.00	0.06
37 7	002127	南极电商	3,200	31,264.00	0.06
37 8	002156	通富微电	1,300	31,252.00	0.06
37 9	000975	银泰黄金	3,280	31,192.80	0.06
38 0	600909	华安证券	5,590	31,136.30	0.06
38 1	600166	福田汽车	9,000	31,050.00	0.06
38 2	002131	利欧股份	13,200	30,888.00	0.06

38 3	601995	中金公司	500	30,750.00	0.06
38 4	601005	重庆钢铁	11,500	30,705.00	0.06
38 5	002120	韵达股份	2,264	30,631.92	0.06
38 6	601998	中信银行	6,000	30,600.00	0.06
38 7	600529	山东药玻	900	30,555.00	0.06
38 8	601990	南京证券	2,900	30,508.00	0.06
38 9	000960	锡业股份	1,900	30,457.00	0.06
39 0	601077	渝农商行	7,600	30,324.00	0.06
39 1	000723	美锦能源	4,000	30,240.00	0.06
39 2	600827	百联股份	1,500	30,225.00	0.06
39 3	603658	安图生物	390	29,550.30	0.05
39 4	601198	东兴证券	2,700	29,511.00	0.05
39 5	600642	申能股份	4,800	29,472.00	0.05
39 6	300474	景嘉微	300	29,376.00	0.05
39 7	601866	中远海发	7,800	29,250.00	0.05
39 8	002572	索菲亚	1,200	29,040.00	0.05
39	688009	中国通号	5,098	29,007.62	0.05

9					
40 0	002673	西部证券	3,500	28,875.00	0.05
40 1	000998	隆平高科	1,800	28,872.00	0.05
40 2	300383	光环新网	2,000	28,780.00	0.05
40 3	600271	航天信息	2,200	28,666.00	0.05
40 4	002299	圣农发展	1,200	28,656.00	0.05
40 5	000623	吉林敖东	1,843	28,548.07	0.05
40 6	600988	赤峰黄金	1,900	28,481.00	0.05
40 7	002500	山西证券	4,230	28,383.30	0.05
40 8	603893	瑞芯微	200	27,892.00	0.05
40 9	600415	小商品城	5,400	27,810.00	0.05
41 0	002065	东华软件	3,500	27,755.00	0.05
41 1	300168	万达信息	1,900	27,740.00	0.05
41 2	300115	长盈精密	1,340	27,604.00	0.05
41 3	603156	养元饮品	964	27,551.12	0.05
41 4	000012	南玻 A	2,690	27,545.60	0.05
41 5	600153	建发股份	3,400	27,540.00	0.05

41 6	600895	张江高科	1,500	27,405.00	0.05
41 7	300296	利亚德	3,500	27,370.00	0.05
41 8	601699	潞安环能	2,300	27,163.00	0.05
41 9	601881	中国银河	2,500	26,950.00	0.05
42 0	000050	深天马 A	1,900	26,942.00	0.05
42 1	002739	万达电影	1,700	26,843.00	0.05
42 2	002373	千方科技	1,600	26,720.00	0.05
42 3	600535	天士力	1,800	26,658.00	0.05
42 4	600256	广汇能源	8,000	26,640.00	0.05
42 5	300630	普利制药	506	26,514.40	0.05
42 6	002372	伟星新材	1,280	26,457.60	0.05
42 7	600511	国药股份	800	26,448.00	0.05
42 8	600667	太极实业	2,900	26,390.00	0.05
42 9	002294	信立泰	800	26,320.00	0.05
43 0	600390	五矿资本	4,400	26,312.00	0.05
43 1	688126	沪硅产业	900	26,262.00	0.05
43	300418	昆仑万维	1,600	26,208.00	0.05

2					
43 3	002670	国盛金控	2,300	26,197.00	0.05
43 4	600008	首创环保	8,700	26,187.00	0.05
43 5	600188	兖州煤业	1,700	26,112.00	0.05
43 6	600848	上海临港	1,456	26,062.40	0.05
43 7	002557	洽洽食品	600	25,860.00	0.05
43 8	600208	新湖中宝	8,500	25,840.00	0.05
43 9	600155	华创阳安	2,400	25,680.00	0.05
44 0	000878	云南铜业	2,000	25,660.00	0.05
44 1	300024	机器人	2,380	25,394.60	0.05
44 2	600060	海信视像	1,500	25,350.00	0.05
44 3	603858	步长制药	1,124	25,278.76	0.05
44 4	002558	巨人网络	1,900	25,270.00	0.05
44 5	000027	深圳能源	2,740	25,125.80	0.05
44 6	002926	华西证券	2,600	25,038.00	0.05
44 7	600233	圆通速递	2,500	25,025.00	0.05
44 7	300271	华宇软件	1,300	25,025.00	0.05

449	002382	蓝帆医疗	1,200	25,020.00	0.05
450	002683	宏大爆破	900	24,993.00	0.05
451	002831	裕同科技	840	24,939.60	0.05
452	600765	中航重机	1,100	24,915.00	0.05
453	601319	中国人保	4,200	24,906.00	0.05
454	000718	苏宁环球	3,000	24,870.00	0.05
455	600372	中航电子	1,500	24,825.00	0.05
456	603338	浙江鼎力	420	24,649.80	0.05
457	603233	大参林	480	24,532.80	0.04
458	600498	烽火通信	1,312	24,442.56	0.04
459	601615	明阳智能	1,500	24,285.00	0.04
460	600409	三友化工	2,400	24,264.00	0.04
461	002966	苏州银行	3,300	24,255.00	0.04
462	002019	亿帆医药	1,401	24,167.25	0.04
463	600875	东方电气	2,200	24,134.00	0.04
464	002390	信邦制药	2,300	24,104.00	0.04
46	002174	游族网络	1,400	24,038.00	0.04

5					
46 6	600170	上海建工	8,700	24,012.00	0.04
46 7	603638	艾迪精密	560	24,007.20	0.04
46 8	600258	首旅酒店	1,000	23,860.00	0.04
46 9	300251	光线传媒	2,200	23,782.00	0.04
47 0	300618	寒锐钴业	300	23,652.00	0.04
47 1	000932	华菱钢铁	3,580	23,628.00	0.04
47 2	300058	蓝色光标	3,900	23,595.00	0.04
47 3	002958	青农商行	5,500	23,540.00	0.04
47 4	000401	冀东水泥	1,900	23,465.00	0.04
47 5	600160	巨化股份	2,650	23,426.00	0.04
47 6	601717	郑煤机	2,000	23,260.00	0.04
47 7	000997	新大陆	1,400	23,226.00	0.04
47 8	600801	华新水泥	1,320	23,192.40	0.04
47 9	600859	王府井	800	23,104.00	0.04
48 0	603260	合盛硅业	300	23,073.00	0.04
48 1	600998	九州通	1,500	23,055.00	0.04

48 2	002153	石基信息	980	23,039.80	0.04
48 3	002221	东华能源	2,100	22,995.00	0.04
48 4	002506	协鑫集成	6,600	22,968.00	0.04
48 5	300315	掌趣科技	5,400	22,950.00	0.04
48 6	000738	航发控制	1,100	22,913.00	0.04
48 7	002195	二三四五	11,279	22,896.37	0.04
48 8	002408	齐翔腾达	1,840	22,852.80	0.04
48 9	002268	卫 士 通	1,170	22,791.60	0.04
49 0	603866	桃李面包	728	22,713.60	0.04
49 1	000540	中天金融	8,300	22,659.00	0.04
49 2	601696	中银证券	1,100	22,649.00	0.04
49 3	600663	陆家嘴	1,700	22,644.00	0.04
49 4	600325	华发股份	3,300	22,242.00	0.04
49 5	601872	招商轮船	4,800	22,176.00	0.04
49 6	603198	迎驾贡酒	500	22,150.00	0.04
49 7	000060	中金岭南	4,900	22,148.00	0.04
49	688088	虹软科技	397	22,132.75	0.04

8					
49 9	600027	华电国际	6,400	22,016.00	0.04
50 0	000686	东北证券	2,600	21,970.00	0.04
50 1	000961	中南建设	3,700	21,904.00	0.04
50 2	601231	环旭电子	1,300	21,853.00	0.04
50 3	000158	常山北明	1,900	21,831.00	0.04
50 4	601992	金隅集团	8,100	21,789.00	0.04
50 5	300017	网宿科技	3,700	21,645.00	0.04
50 6	603077	和邦生物	10,400	21,632.00	0.04
50 7	600497	XD驰宏锌	5,000	21,550.00	0.04
50 8	300212	易华录	800	21,528.00	0.04
50 9	603927	中科软	500	21,475.00	0.04
51 0	000999	华润三九	800	21,400.00	0.04
51 1	600567	山鹰国际	6,200	21,390.00	0.04
51 2	600282	南钢股份	6,000	21,360.00	0.04
51 2	002595	豪迈科技	800	21,360.00	0.04
51 4	002429	兆驰股份	3,500	21,245.00	0.04

51 5	600839	四川长虹	7,300	21,243.00	0.04
51 6	600500	中化国际	2,680	21,064.80	0.04
51 7	600528	XD中铁工	2,600	21,060.00	0.04
51 8	600737	中粮糖业	2,100	21,021.00	0.04
51 9	600598	北大荒	1,400	20,944.00	0.04
52 0	600482	中国动力	1,200	20,904.00	0.04
52 1	603707	健友股份	500	20,875.00	0.04
52 2	000581	威孚高科	1,000	20,830.00	0.04
52 3	600216	浙江医药	1,300	20,813.00	0.04
52 4	002056	横店东磁	1,600	20,800.00	0.04
52 5	000709	河钢股份	8,400	20,664.00	0.04
52 6	002081	金螳螂	2,600	20,592.00	0.04
52 7	601577	长沙银行	2,300	20,562.00	0.04
52 8	600141	兴发集团	1,080	20,336.40	0.04
52 9	600025	华能水电	3,500	20,265.00	0.04
53 0	002203	海亮股份	1,900	20,216.00	0.04
53	603195	公牛集团	100	20,200.00	0.04

1					
53 2	600808	马钢股份	4,700	20,163.00	0.04
53 3	002010	传化智联	2,600	20,046.00	0.04
53 4	002939	长城证券	1,800	20,034.00	0.04
53 5	603883	XD老百姓	380	20,018.40	0.04
53 6	300182	捷成股份	4,000	19,960.00	0.04
53 7	600580	卧龙电驱	1,499	19,936.70	0.04
53 8	000930	中粮科技	2,212	19,930.12	0.04
53 9	000898	鞍钢股份	4,460	19,847.00	0.04
54 0	002925	盈趣科技	510	19,844.10	0.04
54 1	002281	光迅科技	800	19,680.00	0.04
54 2	603605	珀莱雅	100	19,671.00	0.04
54 3	600820	隧道股份	3,701	19,578.29	0.04
54 4	300166	东方国信	1,580	19,528.80	0.04
54 5	002048	宁波华翔	1,000	19,500.00	0.04
54 6	002242	九阳股份	600	19,494.00	0.04
54 7	600728	佳都科技	2,600	19,266.00	0.04

548	603650	彤程新材	400	19,240.00	0.04
549	002396	星网锐捷	900	19,215.00	0.04
550	002146	荣盛发展	3,400	19,176.00	0.04
551	000488	晨鸣纸业	2,354	19,161.56	0.04
552	002032	苏泊尔	300	19,137.00	0.03
553	002563	森马服饰	1,600	19,120.00	0.03
554	002004	华邦健康	3,068	19,052.28	0.03
555	601236	红塔证券	1,400	18,984.00	0.03
556	603000	人民网	1,100	18,909.00	0.03
557	000729	燕京啤酒	2,600	18,824.00	0.03
558	600707	彩虹股份	2,000	18,820.00	0.03
559	002745	木林森	1,400	18,760.00	0.03
560	600022	山东钢铁	10,800	18,576.00	0.03
561	000629	攀钢钒钛	8,100	18,549.00	0.03
562	688321	微芯生物	400	18,476.00	0.03
563	300002	神州泰岳	3,800	18,430.00	0.03
56	000800	一汽解放	1,700	18,394.00	0.03

4					
56 5	002705	新宝股份	700	18,375.00	0.03
56 6	600970	中材国际	2,000	18,340.00	0.03
56 7	601106	中国一重	5,400	18,306.00	0.03
56 8	600037	歌华有线	1,900	18,259.00	0.03
56 9	600881	亚泰集团	6,400	18,240.00	0.03
57 0	000598	兴蓉环境	3,500	18,235.00	0.03
57 1	600803	新奥股份	1,100	18,161.00	0.03
57 2	600398	海澜之家	2,500	18,100.00	0.03
57 3	002191	劲嘉股份	1,700	18,088.00	0.03
57 4	600755	厦门国贸	2,200	18,062.00	0.03
57 5	603712	七一二	500	18,050.00	0.03
57 6	002773	康弘药业	780	18,041.40	0.03
57 7	002124	天邦股份	2,560	17,945.60	0.03
57 8	603568	伟明环保	783	17,875.89	0.03
57 9	002867	周大生	900	17,793.00	0.03
58 0	600811	东方集团	5,800	17,690.00	0.03

58 1	000778	新兴铸管	4,700	17,484.00	0.03
58 2	000883	湖北能源	3,800	17,442.00	0.03
58 3	600260	凯乐科技	1,960	17,404.80	0.03
58 4	000690	宝新能源	3,400	17,374.00	0.03
58 5	600782	新钢股份	3,100	17,298.00	0.03
58 6	600597	光明乳业	1,200	17,292.00	0.03
58 7	601880	辽港股份	10,100	17,271.00	0.03
58 8	600348	华阳股份	2,300	17,066.00	0.03
58 9	002701	奥瑞金	3,300	16,962.00	0.03
59 0	601456	国联证券	1,100	16,940.00	0.03
59 1	600039	四川路桥	2,700	16,929.00	0.03
59 2	000887	中鼎股份	1,400	16,912.00	0.03
59 3	600329	中新药业	600	16,854.00	0.03
59 4	600908	无锡银行	2,900	16,820.00	0.03
59 5	002085	万丰奥威	3,000	16,800.00	0.03
59 6	603885	吉祥航空	1,100	16,786.00	0.03
59	600732	爱旭股份	1,200	16,704.00	0.03

7					
59 8	002387	维信诺	1,600	16,688.00	0.03
59 9	000671	阳光城	3,200	16,640.00	0.03
60 0	600026	中远海能	2,700	16,632.00	0.03
60 1	600718	东软集团	1,700	16,626.00	0.03
60 2	002183	怡亚通	2,900	16,617.00	0.03
60 3	002985	北摩高科	170	16,575.00	0.03
60 4	000528	柳工	2,010	16,482.00	0.03
60 5	601179	中国西电	4,000	16,480.00	0.03
60 6	002368	太极股份	820	16,449.20	0.03
60 7	600572	康恩贝	3,700	16,428.00	0.03
60 8	600410	华胜天成	2,100	16,296.00	0.03
60 9	601118	海南橡胶	3,200	16,288.00	0.03
61 0	000970	中科三环	1,700	16,235.00	0.03
61 1	600918	中泰证券	1,500	16,230.00	0.03
61 2	600967	内蒙一机	1,600	16,192.00	0.03
61 3	600645	中源协和	700	16,065.00	0.03

61 4	600340	华夏幸福	3,060	16,034.40	0.03
61 5	600167	联美控股	1,790	15,984.70	0.03
61 6	600446	金证股份	1,100	15,884.00	0.03
61 7	002110	三钢闽光	2,350	15,839.00	0.03
61 8	601808	中海油服	1,100	15,796.00	0.03
61 9	300072	三聚环保	2,729	15,664.46	0.03
62 0	601598	中国外运	3,100	15,655.00	0.03
62 1	000877	天山股份	1,200	15,636.00	0.03
62 2	002128	露天煤业	1,500	15,615.00	0.03
62 3	002002	鸿达兴业	3,956	15,547.08	0.03
62 4	000089	深圳机场	2,000	15,540.00	0.03
62 5	000402	金融街	2,300	15,525.00	0.03
62 6	001914	招商积余	900	15,462.00	0.03
62 7	603225	新凤鸣	756	15,346.80	0.03
62 8	601200	上海环境	1,280	15,321.60	0.03
62 9	000990	诚志股份	1,200	15,276.00	0.03
63	000400	许继电气	1,200	15,192.00	0.03

0					
63 1	600064	南京高科	1,620	15,049.80	0.03
63 2	002266	浙富控股	3,000	14,970.00	0.03
63 3	300026	红日药业	3,500	14,875.00	0.03
63 4	600158	中体产业	1,300	14,833.00	0.03
63 5	002249	大洋电机	2,800	14,700.00	0.03
63 6	600985	淮北矿业	1,200	14,652.00	0.03
63 7	600120	浙江东方	3,419	14,633.32	0.03
63 8	601016	节能风电	3,900	14,586.00	0.03
63 9	601698	中国卫通	900	14,571.00	0.03
64 0	601975	招商南油	6,800	14,552.00	0.03
64 1	300376	易事特	1,800	14,472.00	0.03
64 2	002233	塔牌集团	1,400	14,392.00	0.03
64 3	600307	酒钢宏兴	6,200	14,384.00	0.03
64 4	000090	天健集团	2,570	14,212.10	0.03
64 5	601333	广深铁路	6,700	14,204.00	0.03
64 6	000959	首钢股份	2,500	14,050.00	0.03

64 7	600376	首开股份	2,497	13,983.20	0.03
64 8	000519	中兵红箭	1,300	13,936.00	0.03
64 9	601000	唐山港	5,778	13,924.98	0.03
65 0	003035	南网能源	1,400	13,916.00	0.03
65 1	000685	中山公用	1,700	13,872.00	0.03
65 2	600195	中牧股份	1,158	13,849.68	0.03
65 3	600507	方大特钢	2,040	13,831.20	0.03
65 4	000559	万向钱潮	2,600	13,806.00	0.03
65 5	600126	杭钢股份	2,680	13,748.40	0.03
65 6	002839	张家港行	2,500	13,600.00	0.02
65 7	600804	鹏博士	2,800	13,552.00	0.02
65 8	600259	广晟有色	400	13,524.00	0.02
65 9	600435	北方导航	1,700	13,498.00	0.02
66 0	300133	华策影视	2,240	13,260.80	0.02
66 1	601860	紫金银行	3,600	13,068.00	0.02
66 2	600673	东阳光	2,900	13,021.00	0.02
66	000758	中色股份	2,700	12,825.00	0.02

3					
66 4	600373	中文传媒	1,300	12,818.00	0.02
66 5	002399	海普瑞	800	12,744.00	0.02
66 6	601608	中信重工	3,400	12,716.00	0.02
66 7	603228	景旺电子	484	12,680.80	0.02
66 8	000563	陕国投 A	3,930	12,654.60	0.02
66 9	002038	双鹭药业	1,200	12,636.00	0.02
67 0	002936	郑州银行	3,430	12,588.10	0.02
67 1	600266	城建发展	2,652	12,570.48	0.02
67 2	600582	天地科技	3,200	12,480.00	0.02
67 3	603355	莱克电气	200	12,446.00	0.02
67 4	601991	大唐发电	4,700	12,408.00	0.02
67 5	002155	湖南黄金	1,600	12,400.00	0.02
67 6	000967	盈峰环境	1,800	12,366.00	0.02
67 7	601098	中南传媒	1,400	12,348.00	0.02
67 8	601958	金钼股份	1,900	12,312.00	0.02
67 9	003022	联泓新科	400	12,280.00	0.02

68 0	600056	中国医药	1,000	12,150.00	0.02
68 1	601718	际华集团	4,300	12,126.00	0.02
68 2	600928	西安银行	2,600	12,116.00	0.02
68 3	002416	爱施德	1,200	12,036.00	0.02
68 4	600959	江苏有线	3,924	11,968.20	0.02
68 5	600901	江苏租赁	2,300	11,960.00	0.02
68 6	002440	闰土股份	1,350	11,947.50	0.02
68 7	600388	龙净环保	1,400	11,928.00	0.02
68 8	600649	城投控股	2,500	11,900.00	0.02
68 9	300180	华峰超纤	2,400	11,880.00	0.02
69 0	600648	外高桥	800	11,824.00	0.02
69 1	600094	大名城	3,100	11,687.00	0.02
69 2	600062	华润双鹤	980	11,671.80	0.02
69 3	000681	视觉中国	900	11,637.00	0.02
69 4	000501	鄂武商 A	990	11,583.00	0.02
69 5	300257	开山股份	800	11,496.00	0.02
69	601828	美凯龙	950	11,400.00	0.02

6					
69 7	600835	上海机电	700	11,375.00	0.02
69 8	000415	渤海租赁	4,700	11,374.00	0.02
69 9	000028	国药一致	300	11,352.00	0.02
70 0	002505	鹏都农牧	5,000	11,200.00	0.02
70 1	002317	众生药业	1,300	11,193.00	0.02
70 2	600643	爱建集团	1,600	11,168.00	0.02
70 3	600776	东方通信	900	11,160.00	0.02
70 4	000869	张裕 A	300	11,142.00	0.02
70 5	000717	韶钢松山	2,400	11,016.00	0.02
70 6	000062	深圳华强	650	10,991.50	0.02
70 7	600729	重庆百货	400	10,980.00	0.02
70 8	002458	益生股份	1,100	10,967.00	0.02
70 9	600006	东风汽车	1,500	10,950.00	0.02
71 0	601611	中国核建	1,500	10,830.00	0.02
71 1	600633	浙数文化	1,500	10,770.00	0.02
71 1	600546	山煤国际	1,500	10,770.00	0.02

71 3	600566	济川药业	600	10,740.00	0.02
71 4	600863	内蒙华电	4,600	10,718.00	0.02
71 5	601928	凤凰传媒	1,500	10,710.00	0.02
71 6	603087	甘李药业	100	10,658.00	0.02
71 7	600717	天津港	2,690	10,544.80	0.02
71 8	002434	万里扬	1,300	10,543.00	0.02
71 9	000078	海王生物	3,200	10,432.00	0.02
72 0	600021	上海电力	1,500	10,365.00	0.02
72 1	600968	海油发展	4,000	10,360.00	0.02
72 2	300113	顺网科技	800	10,352.00	0.02
72 3	002424	贵州百灵	1,400	10,304.00	0.02
72 4	002375	亚厦股份	1,300	10,296.00	0.02
72 5	002244	滨江集团	2,400	10,056.00	0.02
72 6	600623	华谊集团	1,100	9,691.00	0.02
72 7	600639	浦东金桥	700	9,555.00	0.02
72 8	603515	欧普照明	370	9,497.90	0.02
72	600339	中油工程	3,300	9,372.00	0.02

9					
73 0	600312	平高电气	1,600	9,344.00	0.02
73 1	601969	海南矿业	800	9,304.00	0.02
73 2	600131	国网信通	700	9,268.00	0.02
73 3	002468	申通快递	1,201	9,151.62	0.02
73 4	000826	启迪环境	1,700	9,095.00	0.02
73 5	002583	海能达	1,800	9,072.00	0.02
73 6	600787	中储股份	1,700	9,061.00	0.02
73 7	000031	大悦城	2,500	9,000.00	0.02
73 8	600823	世茂股份	2,200	8,888.00	0.02
73 9	603317	天味食品	302	8,887.86	0.02
74 0	002635	安洁科技	600	8,778.00	0.02
74 1	601778	晶科科技	1,600	8,736.00	0.02
74 1	002815	崇达技术	700	8,736.00	0.02
74 3	603708	家家悦	500	8,685.00	0.02
74 4	600466	蓝光发展	2,920	8,614.00	0.02
74 5	600764	中国海防	300	8,490.00	0.02

74 6	000156	华数传媒	1,100	8,481.00	0.02
74 7	603888	新华网	400	8,468.00	0.02
74 8	002532	天山铝业	1,000	8,390.00	0.02
74 9	000553	安道麦A	900	8,343.00	0.02
75 0	002945	华林证券	600	8,292.00	0.02
75 1	000937	冀中能源	2,100	8,253.00	0.02
75 2	600095	湘财股份	700	8,197.00	0.01
75 3	600517	国网英大	1,200	8,172.00	0.01
75 4	601298	青岛港	1,300	8,034.00	0.01
75 5	002948	青岛银行	1,600	7,952.00	0.01
75 6	002302	西部建设	1,000	7,900.00	0.01
75 7	000813	德展健康	1,700	7,718.00	0.01
75 8	601228	广州港	2,400	7,632.00	0.01
75 9	603786	科博达	100	7,550.00	0.01
76 0	600556	天下秀	700	7,392.00	0.01
76 1	600350	山东高速	1,200	7,380.00	0.01
76	300010	豆神教育	1,300	7,371.00	0.01

2					
76 3	600640	号百控股	600	7,314.00	0.01
76 4	601869	长飞光纤	300	7,308.00	0.01
76 5	600871	石化油服	3,700	7,289.00	0.01
76 5	002901	大博医疗	100	7,289.00	0.01
76 7	601139	深圳燃气	1,100	7,216.00	0.01
76 8	600299	安迪苏	600	7,176.00	0.01
76 8	000061	农产品	1,300	7,176.00	0.01
77 0	603379	三美股份	360	6,735.60	0.01
77 1	603056	德邦股份	600	6,594.00	0.01
77 2	002653	海思科	300	6,456.00	0.01
77 3	002946	新乳业	400	6,060.00	0.01
77 4	002419	天虹股份	900	5,904.00	0.01
77 5	603377	东方时尚	552	5,900.88	0.01
77 6	601003	柳钢股份	1,000	5,900.00	0.01
77 7	000537	广宇发展	1,100	5,753.00	0.01
77 8	601801	皖新传媒	1,200	5,664.00	0.01

77 9	600657	信达地产	1,600	5,568.00	0.01
78 0	603983	丸美股份	100	5,211.00	0.01
78 1	300741	华宝股份	100	5,072.00	0.01
78 2	600377	宁沪高速	500	4,880.00	0.01
78 3	600903	贵州燃气	500	4,600.00	0.01
78 4	603719	良品铺子	100	4,500.00	0.01
78 5	603868	飞科电器	100	4,206.00	0.01
78 6	000732	泰禾集团	1,900	4,104.00	0.01
78 7	601512	中新集团	400	3,984.00	0.01
78 8	002818	富森美	320	3,859.20	0.01
78 9	603256	宏和科技	400	3,656.00	0.01
79 0	002423	中粮资本	400	3,620.00	0.01
79 1	600956	新天绿能	300	3,513.00	0.01
79 2	001872	招商港口	200	3,384.00	0.01
79 3	600917	重庆燃气	400	3,268.00	0.01
79 4	000046	泛海控股	1,100	2,530.00	0.00
79	601068	中铝国际	600	2,070.00	0.00

5					
---	--	--	--	--	--

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	601528	瑞丰银行	1,771	27,574.47	0.05
2	001207	联科科技	563	18,640.93	0.03
3	001208	华菱线缆	1,532	11,842.36	0.02
4	605287	德才股份	327	10,320.12	0.02
5	605011	N杭热	415	3,685.20	0.01

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600519	贵州茅台	1,482,316.00	2.63
2	688111	金山办公	267,752.08	0.48
3	601012	隆基股份	197,170.00	0.35
4	603501	韦尔股份	179,076.00	0.32
5	601816	京沪高铁	172,517.00	0.31
6	002415	海康威视	130,036.00	0.23
7	300450	先导智能	128,034.00	0.23
8	000858	五粮液	106,642.00	0.19
9	000799	酒鬼酒	98,983.00	0.18
10	601318	中国平安	98,593.00	0.18
11	601888	中国中免	93,462.00	0.17
12	600905	三峡能源	90,100.00	0.16
13	000661	长春高新	87,733.00	0.16
14	601963	重庆银行	80,921.76	0.14
15	600036	招商银行	73,996.00	0.13

16	600900	长江电力	67,281.00	0.12
17	688396	华润微	61,464.25	0.11
18	000725	京东方 A	58,455.00	0.10
19	300677	英科医疗	57,283.00	0.10
20	300558	贝达药业	56,985.00	0.10

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	600519	贵州茅台	1,298,251.00	2.30
2	601318	中国平安	313,649.00	0.56
3	000858	五粮液	279,498.00	0.50
4	600036	招商银行	227,870.00	0.40
5	601012	隆基股份	191,821.00	0.34
6	000333	美的集团	174,073.00	0.31
7	601888	中国中免	164,635.00	0.29
8	600905	三峡能源	156,984.00	0.28
9	600276	恒瑞医药	147,461.00	0.26
10	000661	长春高新	132,442.00	0.24
11	688277	天智航	129,206.00	0.23
12	300012	华测检测	122,732.00	0.22
13	601166	兴业银行	116,411.00	0.21
14	000651	格力电器	109,181.00	0.19
15	600887	伊利股份	100,666.00	0.18
16	300496	中科创达	99,806.50	0.18
17	300059	东方财富	99,015.00	0.18
18	601963	重庆银行	94,520.80	0.17
19	600030	中信证券	90,024.90	0.16

20	600906	财达证券	89,533.44	0.16
----	--------	------	-----------	------

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	9,064,899.29
卖出股票收入（成交）总额	12,809,422.56

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	34,798.71	0.06
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	34,798.71	0.06

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113050	南银转债	240	24,000.00	0.04
2	127036	三花转债	29	3,798.71	0.01

3	127038	国微转债	20	2,000.00	0.00
4	113051	节能转债	20	2,000.00	0.00
5	113049	长汽转债	20	2,000.00	0.00

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细
本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细
本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细
本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明
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 本基金投资的前十名证券发行主体中，【兴业银行股份有限公司】于2020年08月31日收到中国银行保险监督管理委员会福建监管局出具公开处罚的通报，于2020年09月04日收到中国人民银行福州中心支行出具公开处罚、公开批评的通报；【招商银行股份有限公司】于2021年05月17日收到中国银行保险监督管理委员会出具罚款处罚的通报。

7.12.2 基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	13,489.49
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-

4	应收利息	655.15
5	应收申购款	291,043.49
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	305,188.13

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	605287	德才股份	10,320.12	0.02	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

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
天弘	4,20	3,819.19	-	-	16,044,405.27	100.0

中证800A	1					0%
天弘中证800C	3,536	6,506.42	12,890,750.89	56.03%	10,115,948.13	43.97%
合计	7,737	5,047.32	12,890,750.89	33.01%	26,160,353.40	66.99%

注：机构/个人投资者持有基金份额占总份额比例的计算中，针对分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	天弘中证800A	12,560.38	0.08%
	天弘中证800C	2,086.32	0.01%
	合计	14,646.70	0.04%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	天弘中证800A	0
	天弘中证800C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	天弘中证800A	0~10
	天弘中证800C	0
	合计	0~10

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

注：本基金成立后有10,000,000.00份为发起份额，发起份额承诺的持有期限为2015年07月16日至2018年07月16日。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	天弘中证800A	天弘中证800C
基金合同生效日(2015年07月16日)基金份额总额	5,000,000.00	5,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	17,091,316.79	24,606,899.76
本报告期基金总申购份额	9,937,464.51	17,428,396.11
减：本报告期基金总赎回份额	10,984,376.03	19,028,596.85
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	16,044,405.27	23,006,699.02

注：总申购份额含转换转入份额；总赎回份额含转换转出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

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，未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及基金托管业务的诉讼事项。

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、托管人的托管业务部门及其高级管理人员没有发生受稽查或处罚的情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东方财富证券	2	-	-	-	-	-
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	-	-	-	-	-
广发证券	3	21,272,694.03	100.00%	4,898.68	100.00%	-

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

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

3、本基金报告期内新租用交易单元：无。

4、本基金报告期内停止租用交易单元：广发证券上海交易单元。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易	债券回购交易	权证交易	基金交易
------	------	--------	------	------

	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
东方财富证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	265,530.07	100.00%	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	天弘基金管理有限公司关于终止深圳盈信基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定媒介	2021-01-01
2	天弘基金管理有限公司关于增加华泰证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投、转换业务以及参加其费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2021-01-08
3	天弘基金管理有限公司关于增加交通银行股份有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投、转换业务以及参加其费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2021-01-13
4	天弘中证800指数型发起式证券投资基金2020年第四季度报告	中国证监会指定媒介	2021-01-22
5	天弘基金管理有限公司关于增加中信银行股份有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投、转换业务的公告	中国证监会指定媒介	2021-02-01

6	关于注意防范冒用天弘创新相关名义进行诈骗活动的风险提示	中国证监会指定媒介	2021-02-24
7	天弘基金管理有限公司关于防范不法分子冒用公司名义进行诈骗活动的风险提示	中国证监会指定媒介	2021-03-04
8	天弘基金管理有限公司关于增加湘财证券有限责任公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投、转换业务以及参加其费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2021-03-12
9	天弘基金管理有限公司关于增加中国民生银行股份有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投、转换业务的公告	中国证监会指定媒介	2021-03-17
10	天弘中证800指数型发起式证券投资基金2020年年度报告	中国证监会指定媒介	2021-03-31
11	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金修订基金合同等法律文件的公告	中国证监会指定媒介	2021-03-31
12	天弘中证800指数型发起式证券投资基金基金合同	中国证监会指定媒介	2021-03-31
13	天弘中证800指数型发起式证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会指定媒介	2021-03-31
14	天弘中证800指数型发起式证券投资基金托管协议	中国证监会指定媒介	2021-03-31
15	天弘中证800指数型发起式证券投资基金产品资料概要（更新）	中国证监会指定媒介	2021-04-06

16	天弘创新资产管理有限公司关于防范不法分子冒用公司名义进行诈骗活动的风险提示	中国证监会指定媒介	2021-04-07
17	天弘基金管理有限公司关于调整旗下部分基金在基金销售机构及网上直销系统的单笔最低申购金额及单笔最低赎回份额的公告	中国证监会指定媒介	2021-04-12
18	天弘中证800指数型发起式证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会指定媒介	2021-04-14
19	天弘中证800指数型发起式证券投资基金2021年第一季度报告	中国证监会指定媒介	2021-04-22
20	天弘基金管理有限公司关于董事长离任及总经理代行董事长职务的公告	中国证监会指定媒介	2021-06-02
21	天弘基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会指定媒介	2021-06-02
22	天弘基金管理有限公司关于增加爱建证券有限责任公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投、转换业务以及参加其费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2021-06-11

§ 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	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比

		达到或者超过20%的时间区间					
机构	1	20210101-20210630	12,890,750.89	-	-	12,890,750.89	33.01%
产品特有风险							
<p>基金管理人秉承谨慎勤勉、独立决策、规范运作、充分披露原则，公平对待投资者，保障投资者合法权益。当单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%时，由此可能导致的特有风险主要包括：</p> <p>(1) 超出基金管理人允许的单一投资者持有基金份额比例的申购申请不被确认的风险；</p> <p>(2) 极端市场环境下投资者集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对赎回申请的风险；</p> <p>(3) 持有基金份额占比较高的投资者大额赎回可能引发基金净值大幅波动的风险；</p> <p>(4) 持有基金份额占比较高的投资者在召开基金份额持有人大会并对重大事项进行投票表决时，可能拥有较大话语权；</p> <p>(5) 极端情况下，持有基金份额占比较高的投资者大量赎回后，可能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。</p>							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

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

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准天弘中证800指数型发起式证券投资基金募集的文件
- 2、天弘中证800指数型发起式证券投资基金基金合同
- 3、天弘中证800指数型发起式证券投资基金托管协议

- 4、天弘中证800指数型发起式证券投资基金招募说明书
- 5、报告期内在指定报刊上披露的各项公告
- 6、中国证监会规定的其他文件

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
二〇二一年八月三十一日