
天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金

2021年第3季度报告

2021年09月30日

基金管理人:天弘基金管理有限公司

基金托管人:国泰君安证券股份有限公司

报告送出日期:2021年10月27日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人国泰君安证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年10月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2021年07月01日起至2021年09月30日止。

§ 2 基金产品概况

| | |
|------------|--|
| 基金简称 | 创业板ETF天弘 |
| 场内简称 | 创业板ETF天弘 |
| 基金主代码 | 159977 |
| 基金运作方式 | 交易型开放式 |
| 基金合同生效日 | 2019年09月12日 |
| 报告期末基金份额总额 | 1, 183, 936, 410. 00份 |
| 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。 主要产品投资策略包括：债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、参与融资及转融通证券出借业务策略、存托凭证投资策略等策略。 |
| 业绩比较基准 | 创业板指数收益率 |
| 风险收益特征 | 本基金属股票型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、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。 |
| 基金管理人 | 天弘基金管理有限公司 |
| 基金托管人 | 国泰君安证券股份有限公司 |

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 报告期（2021年07月01日 - 2021年09月30日） |
|-----------------|--------------------------------|
| 1. 本期已实现收益 | 169,016,128.73 |
| 2. 本期利润 | -223,810,102.85 |
| 3. 加权平均基金份额本期利润 | -0.2018 |
| 4. 期末基金资产净值 | 3,882,781,216.57 |
| 5. 期末基金份额净值 | 3.2796 |

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。

3.2 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

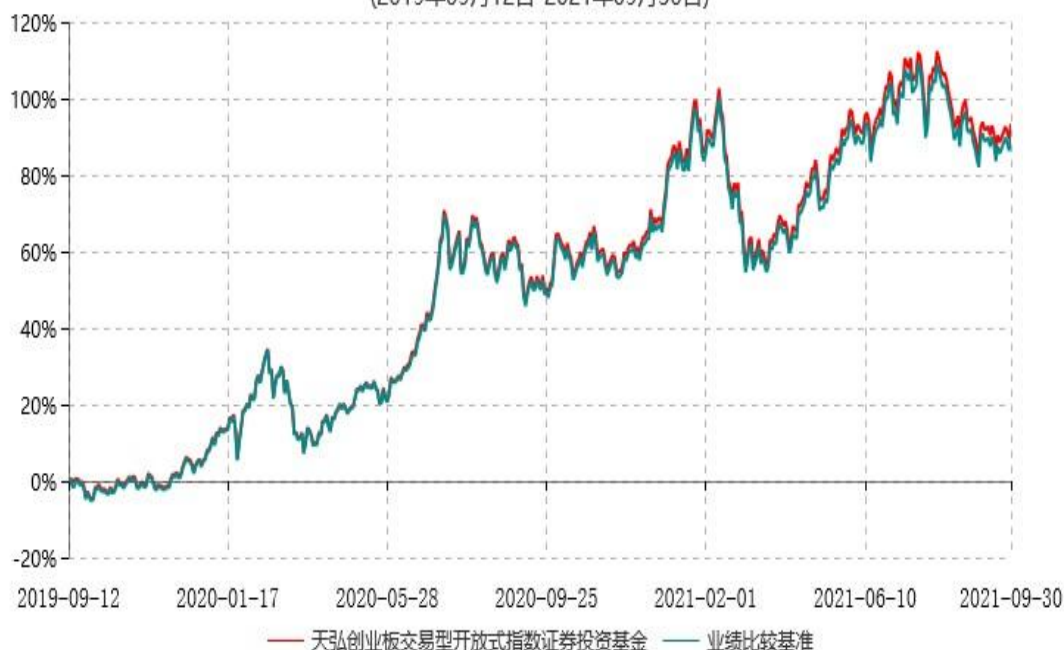
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|----|--------|-----------|------------|---------------|-----|-----|
| | | | | | | |

| | | | | | | |
|-----------------|--------|-------|--------|-------|-------|--------|
| 过去三个月 | -6.57% | 1.87% | -6.69% | 1.87% | 0.12% | 0.00% |
| 过去六个月 | 18.02% | 1.75% | 17.62% | 1.76% | 0.40% | -0.01% |
| 过去一年 | 26.98% | 1.84% | 26.02% | 1.85% | 0.96% | -0.01% |
| 自基金合同生效日起至 今 | 93.41% | 1.84% | 90.47% | 1.85% | 2.94% | -0.01% |

3.2.2 自基金合同生效以来基金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

天弘创业板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

(2019年09月12日-2021年09月30日)



注：1、本基金合同于2019年09月12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 基金经理（或基金经理小组）简介

| 姓名 | 职务 | 任本基金的基金经理期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|----|----|-------------|------|--------|----|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| | | | | | |

| | | | | | |
|-----|----------------------|----------|---|-----|---|
| 杨超 | 指数与数量投资部副总经理、本基金基金经理 | 2019年09月 | - | 11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09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。

4.3 公平交易专项说明

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

本基金作为一只被动的指数基金，以最小化跟踪误差为投资目标，紧密跟踪标的指数。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。

报告期内，本基金跟踪误差的来源主要是申购赎回导致的个股权重偏离、新股打新等方面因素。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基于流动性管理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。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2021年09月30日，本基金份额净值为3.2796元，本报告期份额净值增长率-6.57%，同期业绩比较基准增长率-6.69%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内本基金管理人无应说明预警信息。

§ 5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

| 序号 | 项目 | 金额(元) | 占基金总资产的比例 (%) |
|----|-------------|------------------|------------------|
| 1 | 权益投资 | 3,877,589,279.52 | 99.75 |
| | 其中：股票 | 3,877,589,279.52 | 99.75 |
| 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 | 9,352,217.43 | 0.24 |
| 8 | 其他资产 | 465,188.62 | 0.01 |
| 9 | 合计 | 3,887,406,685.57 | 100.00 |

注：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 376,195,855.50 元，占基金资产净值的比例为 9.69%。

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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 | 80,230,353.60 | 2.07 |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 2,758,136,734.05 | 71.04 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | - | - |
| F | 批发和零售业 | 3,978,540.00 | 0.10 |
| 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 | 253,691,011.16 | 6.53 |
| J | 金融业 | 326,555,512.26 | 8.41 |
| K | 房地产业 | - | - |
| L | 租赁和商务服务业 | 12,380,860.00 | 0.32 |
| M | 科学研究和技术服务业 | 213,271,357.03 | 5.49 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 16,732,073.40 | 0.43 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | 146,571,220.55 | 3.77 |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 65,210,799.16 | 1.68 |
| S | 综合 | - | - |

| | | | |
|--|----|------------------|-------|
| | 合计 | 3,876,758,461.21 | 99.84 |
|--|----|------------------|-------|

5.2.2 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 | 18,116.82 | 0.00 |
| B | 采矿业 | - | - |
| C | 制造业 | 632,176.42 | 0.02 |
| D | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | - | - |
| E | 建筑业 | 20,183.39 | 0.00 |
| F | 批发和零售业 | 70,022.52 | 0.00 |
| G | 交通运输、仓储和邮政业 | - | - |
| H | 住宿和餐饮业 | 3,345.12 | 0.00 |
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | 19,964.00 | 0.00 |
| 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 | 19,443.64 | 0.00 |
| N | 水利、环境和公共设施管理业 | 38,613.78 | 0.00 |
| O | 居民服务、修理和其他服务业 | - | - |
| P | 教育 | - | - |
| Q | 卫生和社会工作 | - | - |
| R | 文化、体育和娱乐业 | 8,952.62 | 0.00 |
| S | 综合 | - | - |
| | 合计 | 830,818.31 | 0.02 |

5.3 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

5.3.1 报告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前十名股票投资明细

| 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 | 300750 | 宁德时代 | 1,222,412 | 642,658,660.76 | 16.55 |
| 2 | 300059 | 东方财富 | 8,723,732 | 299,834,668.84 | 7.72 |
| 3 | 300760 | 迈瑞医疗 | 463,936 | 178,810,213.12 | 4.61 |
| 4 | 300274 | 阳光电源 | 1,051,428 | 156,010,886.64 | 4.02 |
| 5 | 300015 | 爱尔眼科 | 2,491,045 | 133,021,803.00 | 3.43 |
| 6 | 300014 | 亿纬锂能 | 1,243,820 | 123,175,494.60 | 3.17 |
| 7 | 300122 | 智飞生物 | 774,413 | 123,123,922.87 | 3.17 |
| 8 | 300124 | 汇川技术 | 1,796,608 | 113,186,304.00 | 2.92 |
| 9 | 300142 | 沃森生物 | 1,693,929 | 107,022,434.22 | 2.76 |
| 10 | 300347 | 泰格医药 | 574,124 | 99,897,576.00 | 2.57 |

5.3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

| 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 | 300979 | 华利集团 | 925 | 79,402.00 | 0.00 |
| 2 | 300973 | 立高食品 | 360 | 52,135.20 | 0.00 |
| 3 | 300981 | 中红医疗 | 601 | 50,027.24 | 0.00 |
| 4 | 301078 | 孩子王 | 7,551 | 43,569.27 | 0.00 |
| 5 | 301050 | 雷电微力 | 233 | 37,729.69 | 0.00 |

5.4 报告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。

5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 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。

5.10 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券发行主体中，【云南沃森生物技术股份有限公司】于 2021 年 07 月 02 日收到中国证券监督管理委员会云南监管局出具责令改正的通报。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

| 序号 | 名称 | 金额(元) |
|----|---------|------------|
| 1 | 存出保证金 | 222,245.55 |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收股利 | 8,220.00 |
| 4 | 应收利息 | 196,915.15 |
| 5 | 应收申购款 | - |
| 6 | 其他应收款 | - |
| 7 | 待摊费用 | 37,807.92 |
| 8 | 其他 | - |
| 9 | 合计 | 465,188.62 |

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

| 序号 | 股票代码 | 股票名称 | 流通受限部分的公允价值 (元) | 占基金资产净值比例 (%) | 流通受限情况说明 |
|----|--------|------|-----------------|---------------|----------|
| 1 | 300750 | 宁德时代 | 39,534,896.00 | 1.02 | 转融通证券出借 |
| 2 | 300760 | 迈瑞医疗 | 21,390,810.00 | 0.55 | 转融通证券出借 |
| 3 | 300059 | 东方财富 | 21,154,735.00 | 0.54 | 转融通证券出借 |
| 4 | 300274 | 阳光电源 | 17,048,862.00 | 0.44 | 转融通证券出借 |
| 5 | 300014 | 亿纬锂能 | 12,953,124.00 | 0.33 | 转融通证券出借 |
| 6 | 300015 | 爱尔眼科 | 8,463,900.00 | 0.22 | 转融通证券出借 |
| 7 | 300347 | 泰格医药 | 7,673,400.00 | 0.20 | 转融通证券出借 |
| 8 | 300122 | 智飞生物 | 7,027,358.00 | 0.18 | 转融通证券出借 |
| 9 | 300142 | 沃森生物 | 6,943,482.00 | 0.18 | 转融通证券出借 |
| 10 | 300124 | 汇川技术 | 5,128,200.00 | 0.13 | 转融通证券出借 |

5.11.5.2 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 | 300979 | 华利集团 | 79,402.00 | 0.00 | 创业板打新限售 |
| 2 | 300973 | 立高食品 | 52,135.20 | 0.00 | 创业板打新限售 |
| 3 | 300981 | 中红医疗 | 50,027.24 | 0.00 | 创业板打新限售 |

| | | | | | |
|---|--------|------|-----------|------|---------|
| 4 | 301078 | 孩子王 | 43,569.27 | 0.00 | 新股未上市 |
| 5 | 301050 | 雷电微力 | 37,729.69 | 0.00 | 创业板打新限售 |

5.11.6 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。

§ 6 开放式基金份额变动

单位：份

| | |
|---------------------------|------------------|
| 报告期期初基金份额总额 | 1,056,936,410.00 |
| 报告期期间基金总申购份额 | 410,000,000.00 |
| 减：报告期期间基金总赎回份额 | 283,000,000.00 |
| 报告期期间基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | - |
| 报告期期末基金份额总额 | 1,183,936,410.00 |

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

本报告期基金管理人未持有本基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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 | 1 | 20210701-20210930 | 1,008,358,574.00 | 319,200,000.00 | 186,000,000.00 | 1,141,558,574.00 | 96.42% |

| | | | | | | |
|--|--|--|--|--|--|--|
| 金 | | | | | | |
| 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> | | | | | | |

注：1、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。

2、份额占比精度处理方式四舍五入。

8.2 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。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

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

9.2 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

9.3 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
二〇二一年十月二十七日