

天弘中证科创创业50指数证券投资基金

2021年第4季度报告

2021年12月31日

基金管理人:天弘基金管理有限公司

基金托管人:国泰君安证券股份有限公司

报告送出日期:2022年01月24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2022年01月20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10月01日起至2021年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称	天弘中证科创创业50指数
基金主代码	012894
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2021年07月16日
报告期末基金份额总额	2,906,056,539.59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，实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。
投资策略	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、股指期货投资策略。
业绩比较基准	中证科创创业50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。本基金为指数型基金，主要采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数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

下属分级基金的基金简称	天弘中证科创创业50指数A	天弘中证科创创业50指数C
下属分级基金的交易代码	012894	012895
报告期末下属分级基金的份额总额	547,980,184.81份	2,358,076,354.78份

§ 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10月01日 - 2021年12月31日)	
	天弘中证科创创业50指数A	天弘中证科创创业50指数C
1. 本期已实现收益	-11,033,570.27	-48,921,276.56
2. 本期利润	-13,323,355.65	-55,978,408.82
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.0230	-0.0230
4. 期末基金资产净值	492,375,446.98	2,116,854,450.05
5. 期末基金份额净值	0.8985	0.8977

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

天弘中证科创创业50指数A净值表现

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	-2.90%	1.05%	-3.25%	1.05%	0.35%	0.00%
自基金合同生效日起至至今	-10.15%	1.20%	-15.33%	1.48%	5.18%	-0.28%

天弘中证科创创业50指数C净值表现

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	-2.94%	1.05%	-3.25%	1.05%	0.31%	0.00%
自基金合同生效日起至今	-10.23%	1.20%	-15.33%	1.48%	5.10%	-0.28%

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

天弘中证科创创业50指数A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2021年07月16日-2021年12月31日)



天弘中证科创创业50指数C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2021年07月16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2021年07月16日至2022年01月15日，截止本报告期末本基金仍处于建仓期。

§ 4 管理人报告

4.1 基金经理（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	指数与数量投资部总经理、本基金基金经理	2021年07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。
林心龙	本基金基金经理	2021年07	-	6年	男，光学工程专业硕士。历任南方基金管理股份有

		月			限公司研究员、新华基金管理股份有限公司基金经理助理,2019年8月加盟本公司,历任高级研究员。
--	--	---	--	--	---

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,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10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 报告期内基金的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，本基金跟踪误差和超额收益的来源主要是申购赎回导致的仓位偏离、标的指数样本股调整导致的结构偏离和打新三方面因素。当由于申赎、成分股停牌或新股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，在保证跟踪误差可控的前提下实现了相对基准指数的正向偏离。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12月31日，天弘中证科创创业50指数A基金份额净值为0.8985元，天弘中证科创创业50指数C基金份额净值为0.8977元。报告期内份额净值增长率天弘中证科创创业50指数A为-2.90%，同期业绩比较基准增长率为-3.25%；天弘中证科创创业50指数C为-2.94%，同期业绩比较基准增长率为-3.25%。

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	2,466,419,690.26	94.10
	其中：股票	2,466,419,690.26	94.10
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,600,520.00	0.10
	其中：债券	2,600,520.00	0.10
	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	144,177,018.49	5.50
8	其他资产	7,847,084.19	0.30
9	合计	2,621,044,312.94	100.00

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,102,918,131.48	80.60
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	200,857,126.90	7.70
J	金融业	31,650,730.70	1.21
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	128,390,539.00	4.92
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,463,816,528.08	94.43

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,881,713.20	0.07
D	电力、热力、燃气及水生	-	-

	产和供应业		
E	建筑业	4,713.80	0.00
F	批发和零售业	155,119.64	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	4,608.00	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	396,674.17	0.02
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	111,016.70	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	40,839.39	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	8,477.28	0.00
S	综合	-	-
	合计	2,603,162.18	0.10

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	385,157	226,472,316.00	8.68
2	300760	迈瑞医疗	494,890	188,454,112.00	7.22
3	300274	阳光电源	1,058,058	154,264,856.40	5.91
4	300014	亿纬锂能	1,153,240	136,289,903.20	5.22
5	300124	汇川技术	1,870,600	128,323,160.00	4.92

				0	
6	688981	中芯国际	1,972,686	104,532,631.14	4.01
7	300122	智飞生物	814,166	101,445,083.60	3.89
8	300142	沃森生物	1,594,000	89,582,800.00	3.43
9	300450	先导智能	1,115,010	82,923,293.70	3.18
10	300782	卓胜微	237,660	77,667,288.00	2.98

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	688739	成大生物	9,882	694,902.24	0.03
2	688151	华强科技	12,238	413,889.16	0.02
3	688262	国芯科技	7,129	299,275.42	0.01
4	688711	宏微科技	1,865	217,309.80	0.01
5	301177	迪阿股份	792	91,935.36	0.00

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	2,600,520.00	0.10
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）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,600,520.00	0.10

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

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	019649	21国债01	26,000	2,600,520.00	0.10

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	1,338,736.08
2	应收证券清算款	162,450.54
3	应收股利	-
4	应收利息	127,733.03
5	应收申购款	6,218,164.54
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	7,847,084.19

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

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。

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	688739	成大生物	694,902.24	0.03	科创板打新限售
2	688151	华强科技	413,889.16	0.02	科创板打新限售
3	688262	国芯科技	299,275.42	0.01	新股未上市
4	688711	宏微科技	217,309.80	0.01	科创板打新限售
5	301177	迪阿股份	91,935.36	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

	天弘中证科创创业50指数A	天弘中证科创创业50指数C
报告期期初基金份额总额	636,769,715.50	2,569,022,802.88
报告期期间基金总申购份额	106,967,104.39	421,960,069.80
减：报告期期间基金总赎回份额	195,756,635.08	632,906,517.90
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	547,980,184.81	2,358,076,354.78

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。

§ 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

本报告期内，本基金未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过本基金总份额 20%的情况。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

根据《企业会计准则第22号—金融工具确认和计量》（财会〔2017〕7号）、《企业会计准则第23号—金融资产转移》（财会〔2017〕8号）、《企业会计准则第24号—套期会计》（财会〔2017〕9号）、《企业会计准则第37号—金融工具列报》（财会〔2017〕14号）和《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》（财会〔2020〕22号）等相关规定，自 2022年1月1日起，天弘基金管理有限公司旗下资产管理产品开始执行新金融工具相关会计准则。具体信息请参见基金管理人在规定媒介披露的《天弘基金管理有限公司关于旗下资产管理产品执行新金融工具相关会计准则的公告》。

§ 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中证科创创业50指数证券投资基金募集的文件
- 2、天弘中证科创创业50指数证券投资基金基金合同
- 3、天弘中证科创创业50指数证券投资基金托管协议
- 4、天弘中证科创创业50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
二〇二二年一月二十四日