

天弘中证红利低波动 100 指数型发起式证券投资基金

2021 年年度报告

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

送出日期:2022 年 03 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。本年度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。

基金托管人国泰君安证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2022年03月29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。

本报告期自2021年01月01日起至2021年12月31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、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	12
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	15
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	16
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	17
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	17
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	18
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	19
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	20
4.9 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	20
§5 托管人报告	20
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	20
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	20
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	20
§6 审计报告	20
6.1 审计报告基本信息	21
6.2 审计报告的基本内容	21
§7 年度财务报表	23
7.1 资产负债表	23
7.2 利润表	25
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	27
7.4 报表附注	28
§8 投资组合报告	64
8.1 期末基金资产组合情况	64
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	64
8.3 期末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	66
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	70
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	80
8.6 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	80
8.7 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	80
8.8 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	80
8.9 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	80
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	80

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	80
8.12 投资组合报告附注.....	80
§9 基金份额持有人信息.....	82
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	82
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	82
9.3 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.....	83
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	83
§10 开放式基金份额变动.....	84
§11 重大事件揭示.....	84
11.1 基金份额持有人大会决议.....	84
11.2 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.....	84
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	85
11.4 基金投资策略的改变.....	85
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	85
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	85
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	85
11.8 其他重大事件.....	87
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	94
12.1 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.....	94
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	94
§13 备查文件目录.....	94
13.1 备查文件目录.....	94
13.2 存放地点.....	94
13.3 查阅方式.....	95

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	天弘中证红利低波动100指数型发起式证券投资基金	
基金简称	天弘中证红利低波动100	
基金主代码	008114	
基金运作方式	契约型开放式、发起式	
基金合同生效日	2019年12月10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	
报告期末基金份额总额	141,041,362.66份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	天弘中证红利低波动100A	天弘中证红利低波动100C
下属分级基金的交易代码	008114	008115
报告期末下属分级基金的份额总额	39,291,308.69份	101,750,053.97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。本基金产品投资策略仍包括大类资产配置、股票投资策略、存托凭证投资策略、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、其他金融工具投资策略等策略。
业绩比较基准	中证红利低波动100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。
--	---

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	国泰君安证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	童建林	帅芳
	联系电话	022-83310208	021-38031815
	电子邮箱	service@thfund.com.cn	shuaifang@gtjas.com
客户服务电话		95046	021-38917599-5
传真		022-83865569	021-38677819
注册地址		天津自贸试验区(中心商务区)新华路3678号宝风大厦23层	中国(上海)自由贸易试验区商城路618号
办公地址		天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层	上海市静安区新闻路669号博华广场19楼
邮政编码		300203	200041
法定代表人		韩歆毅	贺青

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.thfund.com.cn
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	中国上海市浦东新区东育路588号前滩中心42楼

注册登记机关	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、基金净值表现及利润分配情况

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	2021年		2020年		2019年12月10日（基金 合同生效日）-2019年12 月31日	
	天弘中证 红利低波 动100A	天弘中证 红利低波 动100C	天弘中证 红利低波 动100A	天弘中证 红利低波 动100C	天弘中证 红利低波 动100A	天弘中证 红利低波 动100C
本期已 实现收 益	3,919,937.98	25,781,353.15	2,538,987.76	3,321,079.80	51,946.96	46,875.99
本期利 润	6,516,411.47	27,726,571.25	2,026,921.49	1,483,841.11	51,946.96	46,875.99
加权平 均基金 份额本 期利润	0.1976	0.1248	0.0525	0.0429	0.0011	0.0009
本期加 权平均 净值利 润率	17.09%	10.90%	5.41%	4.31%	0.11%	0.09%
本期基 金份额 净值增 长率	22.54%	22.30%	4.31%	4.09%	0.11%	0.09%
3.1.2 期末数 据和指 标	2021年末		2020年末		2019年末	

期末可供分配利润	8,178,837.32	20,663,988.66	1,105,311.60	2,225,204.95	51,946.96	46,875.99
期末可供分配基金份额利润	0.2082	0.2031	0.0442	0.0418	0.0011	0.0009
期末基金资产净值	50,277,905.45	129,643,247.84	26,108,699.09	55,429,524.93	48,359,375.01	50,377,186.89
期末基金份额净值	1.2796	1.2741	1.0442	1.0418	1.0011	1.0009
3.1.3 累计期末指标	2021年末		2020年末		2019年末	
基金份额累计净值增长率	27.96%	27.41%	4.42%	4.18%	0.11%	0.09%

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

天弘中证红利低波动100A

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	①-③	②-④
----	----------	-------------	------------	--------------	-----	-----

				④		
过去三个月	3.45%	0.70%	3.00%	0.71%	0.45%	-0.01%
过去六个月	10.72%	0.82%	5.25%	0.84%	5.47%	-0.02%
过去一年	22.54%	0.80%	13.23%	0.81%	9.31%	-0.01%
自基金合同 生效日起至 今	27.96%	0.96%	14.91%	0.98%	13.05%	-0.02%

天弘中证红利低波动100C

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
过去三个月	3.40%	0.70%	3.00%	0.71%	0.40%	-0.01%
过去六个月	10.61%	0.82%	5.25%	0.84%	5.36%	-0.02%
过去一年	22.30%	0.80%	13.23%	0.81%	9.07%	-0.01%
自基金合同 生效日起至 今	27.41%	0.96%	14.91%	0.98%	12.50%	-0.02%

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

天弘中证红利低波动100A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12月10日-2021年12月31日)

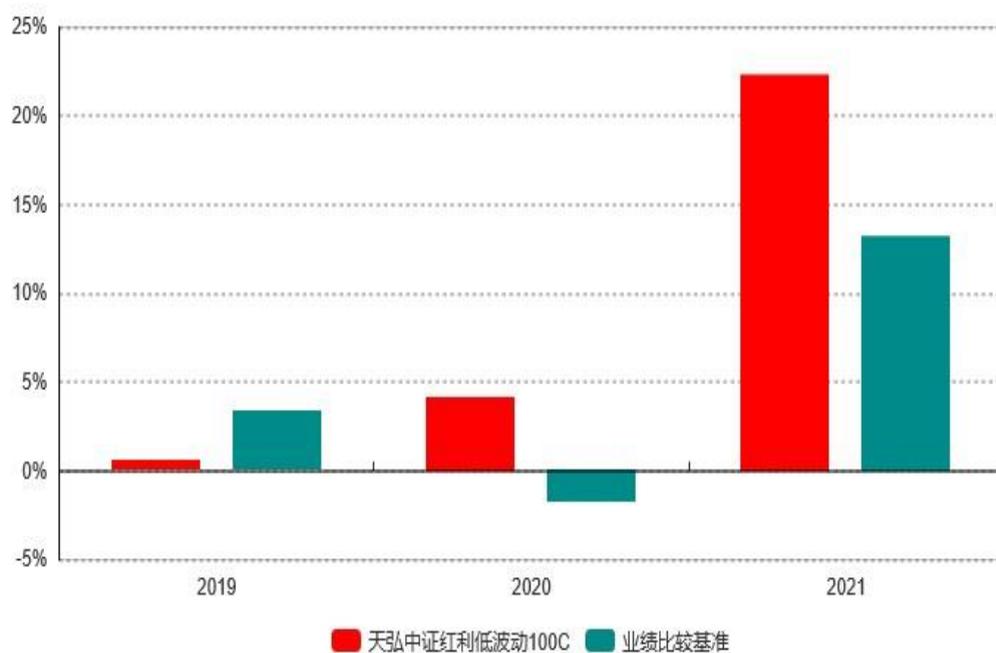
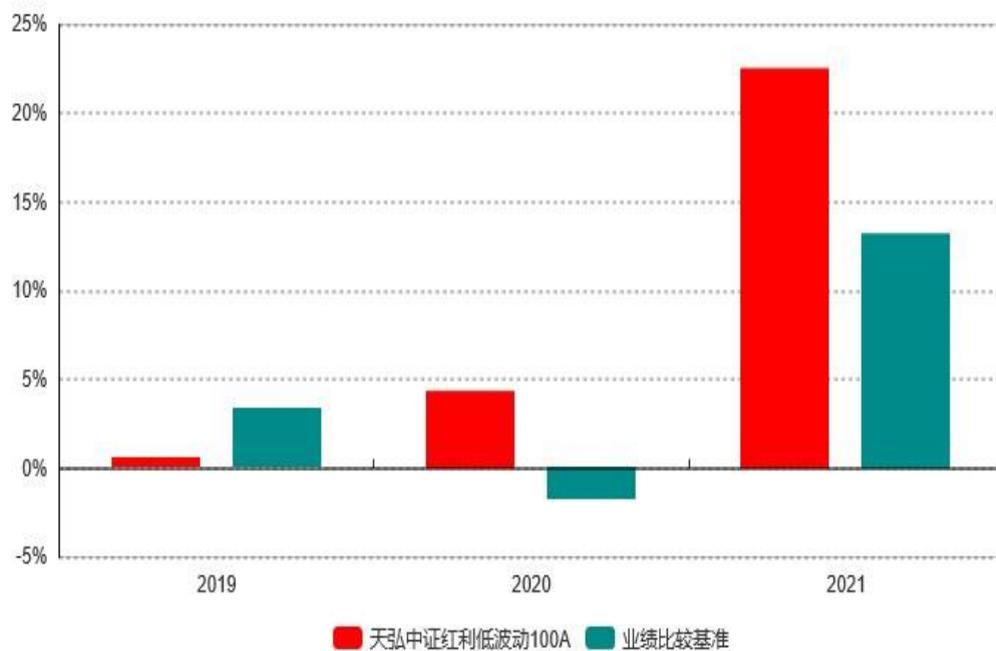


天弘中证红利低波动100C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2019年12月10日-2021年12月31日)



注：1、本基金合同于2019年12月10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。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金合同于2019年12月10日生效。基金合同生效当年2019年的净值增长率按照基金合同生效后当年的实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金于2019年12月10日成立，自基金合同生效以来未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

截至2021年12月31日，本基金管理人共管理144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、天弘中证食品饮料交易型开放式指数证券投资基金联接基金、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交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、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、天弘国证生物医药交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、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交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、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交易型开放式指数证券投资基金发起式联接基金、天弘恒生科技指数型发起式证券投资基金（QDII）、天弘上海金交易型开放式证券投资基金、天弘恒新混合型证券投资基金、天弘高端制造混合型证券投资基金、天弘中证科创创业50指数证券投资基金、天弘中证芯片产业指数型发起式证券投资基金、天弘恒生沪深港创新药精选50交易型开放式指数证券投资基金、天弘安悦90天滚动持有短债债券型发起式证券投资基金、天弘宁弘六个月持有期混合型证券投资基金、天弘齐享债券型发起式证券投资基金、天弘睿选利率债债券型发起式证券投资基金、天弘永利优佳混合型证券投资基金、天弘裕新混合型证券投资基金、天弘中证沪港深科技龙头指数型发起式证券投资基金、天弘中证沪港深物联网主题交易型开放式指数证券投资基金、天弘中证机器人交易型开放式指数证券投资基金、天弘中证人工智能主题指数型发起式证券投资基金、天弘中证食品饮料交易型开放式指数证券投资基金、天弘中证医药主题指数增强型证券投资基金、天弘国证建筑材料指数型发起式证券投资基金、天弘旗舰精选3个月持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、天弘新享一年定期开放债券型发起式证券投资基金、天弘鑫悦成长混合型证券投资基金、天弘永丰稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、天弘中证高端装备制造指数增强型证券投资基金、天弘中证沪港深线上消费主题交易型开放式指数证券投资基金、天弘中证沪港深云计算产业交易型开放式指数证券投资基金、天弘中证新材料主题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		
刘笑明	本基金基金经理	2021 年06 月	-	7 年	男，运筹学硕士。历任建信基金管理有限责任公司量化研究员、北京极至投资管理有限公司投资经理、中国人保资产管理有限公司基金经理，2020年4月加盟本公司。
张子法	本基金基金经理	2019 年12 月	2021 年08 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。
陈瑶	本基金基金经理	2019 年12 月	2021 年06 月	10 年	女，金融学硕士。2011年7月加盟本公司，历任交易员、交易主管，从事交易管理、程序化交易策略、基差交易策略、融资融券交易策略等研究工作。

注：1、上述任职日期/离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2、在本报告截止日至报告批准送出日之间，本基金管理人增聘祁世超先生为本基金基金经理助理。

3、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 公平交易制度和控制方法

基金管理人一直坚持公平对待旗下所有基金的原则，严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，在研究分析、投资决策和交易执行等各个环节落实公平交易原则。公平交易范围包括各类投资组合、所有投资交易品种、以及一级市场申购、二级市场交易等所有投资交易管理活动及授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

针对公司旗下所有投资组合的交易所公开竞价交易，通过交易系统内的公平交易程序，对于不同投资组合同日同向买卖同一证券的指令自动进行比例分配。针对场外网下交易业务，依照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部场外、网下交易业务的相关规定，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。对于以公司名义进行的交易严格按照发行分配的原则或价格优先、比例分配的原则在各投资组合间进行分配。

4.3.2 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。

4.3.3 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 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，市场整体震荡上行，同时结构及风格存在不小的分化。在结构上，新能源、科技等高景气产业相关标的产生了较大的超额收益，而消费、医药等板块则遭遇回撤，在风格上，中小市值及成长风格跑赢大盘价值风格。具体来说：中证全指上涨6.19%，沪深300下跌5.20%，中证500上涨15.58%，创业板指上涨12.02%，中证1000上涨20.52%。本基金投资策略所跟踪的中证红利低波动100指数上涨13.90%。报告期内，基金管理人根据基金合同约定，以坚持被动指数化投资为原则进行基金的投资运作，并通过部门自研的指数基金投资管理系统对基金的投资流程进行持续监控及优化，将基金的跟踪误差及跟踪偏离度控制在了合理水平。报告期内基金跟踪误差及偏离度来源主要是：1) 基金申购赎回；2) 基准指数样本股调整；3) 新股申购；4) 成分股分红。

投资策略方面，本基金作为一只跟踪中证红利低波动100指数的被动指数产品，基金管理人将运用指数化投资策略，紧密跟踪基准，在严格控制基金的日均跟踪偏离度和年化跟踪误差的前提下，力争获取与业绩基准相似的投资收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2021年12月31日，天弘中证红利低波动100A基金份额净值为1.2796元，天弘中证红利低波动100C基金份额净值为1.2741元。报告期内份额净值增长率天弘中证红利低波动100A为22.54%，同期业绩比较基准增长率为13.23%；天弘中证红利低波动100C为22.30%，同期业绩比较基准增长率为13.23%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2022年，我们认为经济存在一定下行压力，但国内流动性将相对宽裕。宏观经济方面，如中央经济工作会议所述，我国经济发展面临需求收缩、供给冲击、预期转弱三重压力，同时外部环境更趋复杂严峻和不确定。在此背景下，一系列稳增长措施有望持续发力并靠前发力，同时货币政策亦有望边际趋于宽松。尽管面临短期困难，但基于国内巨大的消费市场、完善的产业链配套、持续的科技创新以及较大的政策发力空间，我们仍对中国经济的中长期韧性和发展潜力抱有信心。

证券市场方面，主流宽基指数在过去两年内经历了较大幅度的上涨，多数行业的估值修复过程已经完成，市场可能进入波动率逐渐加大的运行区间，不排除阶段性面临盈利增速放缓或海外流动性冲击所带来的行情扰动，但全年来看，积极的政策以及国内

相对宽松的流动性仍将对权益市场形成一定支撑。同时，高景气产业与众多传统产业的相对估值亦不断发生变化，我们认为在2022年行业层面继续演绎极致分化走势的概率有所减小，可能出现一定程度的均值回复与再平衡。但应注意到若市场整体运行在波动率较大的区间，且在盈利增速、国内货币政策、海外流动性等多种因素向不同方向变化的复杂背景之下，无论是宽基指数还是细分行业指数，预测其变化的幅度、速率以及时机的难度在增大，机遇与风险并存。当未知因素变多时，一套以概率思维为指导的行之有效的应对方法，也许比更依赖单一结果的押注式预测更加具有现实意义，因此，我们亦鼓励投资者一方面以更长期的视角进行基金配置，更多考虑业绩与估值的匹配程度以及收益风险比，同时另一方面在投资时机以及投资品种上进行一定的分散化处理，以更好的进行风险对冲，有望最终实现收益的长期积累并更充分的发挥复利效应。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人的监察稽核工作一切从合规运作、防范和控制风险、保障基金份额持有人利益出发，由独立的内控合规部门按照规定的权限和程序，认真履行职责，对公司、基金运作及员工行为的合法性、合规性进行定期和不定期监督和检查。发现问题及时提出建议并督促相关部门改进完善，及时与有关人员沟通，并定期制作监察稽核报告报公司董事会。公司经理层面成立了风险管理委员会，根据公司总体风险控制目标，分配各业务和各环节风险控制目标和要求；落实公司重大风险管理的决定或决议；听取并讨论会议成员的报告；对会议成员提出的或发现的已经存在的风险点，在充分讨论、协调基础上形成具体的风险控制措施；对潜在风险点分析讨论，拟定应对措施；对发生的风险事件和重大差错，分析原因、总结经验教训、风险定级、划分责任，向总经理办公会报告。

同时，本基金管理人根据全面性原则、独立性原则、相互制约原则、定性和定量相结合原则、重要性原则建立了一套比较完整的内部控制体系，该内部控制体系由一系列业务管理制度及相应的业务处理、控制程序组成，具体包括控制环境、风险评估、控制活动、信息和沟通、监控等要素。本基金管理人已通过了ISAE3402（《国际鉴证业务准则第3402号》）认证，获得无保留意见的控制设计适当性报告。

本报告期，本基金管理人全面开展基金运作监察稽核工作，确保基金投资、营销及后台运作等各环节的合法合规。通过定期检查、不定期抽查等工作方法，完善内部控制，基金运作没有出现违规行为。本报告期内，本基金管理人有关本基金的监察稽核主要工作如下：

- 1、在研究环节，加强研究业务独立性，注重程序合规和质量控制；在关注研究报告形式与内容的合法性基础上，跟踪检查投资备选库的入选、维护依据；进一步规范新股、新债询价、申购流程；定期检查关联方关系以及关联交易的日常维护；定期评估研究对投资的支持程度，对投资业绩的贡献度；

2、在投资交易环节，对投资运作过程中的风险点进行识别和监控，预防和控制由内部或外部流程、人员和系统失控而造成的损失；根据法律法规要求、基金合同约定、投资决策委员会的决定，适时提出增加或优化交易系统风控指标的建议，通过投资交易系统控制投资风险；跟踪每日的交易行为和交易结果，发现预警信息通过电话、邮件及合规提示及时提醒，保障投资环节的合规运作；监督检查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合规执行情况，保证各投资组合场外交易的事中合规控制；

3、投资管理人员管理环节，加强对投资管理人员即时聊天工具、办公电话、移动电话、终端设备网上交易的合规监控，监督投资管理人员直系亲属账户及股票交易申报制度、交易时间移动电话集中保管制度的有效执行，采取各种有效方式杜绝老鼠仓、非公平交易及各种形式的利益输送行为；

4、基金募集与营销环节，对基金宣传推介材料及定投、费率优惠等基金销售业务活动进行事前合规检查，做到事前防范风险，保障基金营销合法合规。在基金利用互联网平台营销方面，对各类新兴业务的活动方案进行事前合规评估，保证业务开展的同时注重事前风险防范；

5、基金运营环节，加强对注册登记、会计核算、基金清算、估值业务的稽核力度，保证基金运营安全、准确；

6、信息披露环节，严格按照信息披露管理办法的规定，认真做好本基金的信息披露工作，保证信息披露的真实、准确、完整、及时。

报告期内，本基金整体运作合法合规，内部控制和风险防范措施逐步完善，保障了基金份额持有人的利益。本基金管理人将继续以合规运作、防范和控制风险、保障基金份额持有人利益出发，提高内部控制和风险管理的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

4.7 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。估值委员会成员由公司分管投资的高级管理人员、督察长、首席风控官、分管估值业务高级管理人员以及研究管理人员组成。

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（投资经理）、股票/债券研究员、基金运营部、风险管理部和内控合规部的相关人员组成。

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。

4.8 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。

4.9 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，国泰君安证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在天弘中证红利低波动100指数型发起式证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况（如有）、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2022)第22454号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	天弘中证红利低波动100指数型发起式证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一)我们审计的内容 我们审计了天弘中证红利低波动100指数型发起式证券投资基金(以下简称“天弘中证红利低波动100基金”)的财务报表,包括2021年12月31日的资产负债表,2021年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。(二)我们的意见 我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了天弘中证红利低波动100基金2021年12月31日的财务状况以及2021年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于天弘中证红利低波动100基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>
强调事项	无
其他事项	无

其他信息	无
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>天弘中证红利低波动100基金的基金管理人天弘基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估天弘中证红利低波动100基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算天弘中证红利低波动100基金、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督天弘中证红利低波动100基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:(一)识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。(二)了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的</p>

	<p>有效性发表意见。(三)评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。(四)对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能导致对天弘中证红利低波动100基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而,未来的事项或情况可能导致天弘中证红利低波动100基金不能持续经营。(五)评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容,并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通,包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	张振波、林佳璐
会计师事务所的地址	中国上海市浦东新区东育路588号前滩中心42楼
审计报告日期	2022-03-28

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：天弘中证红利低波动100指数型发起式证券投资基金

报告截止日：2021年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	11,651,191.58	4,611,916.89

结算备付金		-	27,004.01
存出保证金		232,426.40	30,490.70
交易性金融资产	7.4.7.2	170,173,702.10	77,389,241.08
其中：股票投资		170,173,702.10	76,746,241.08
基金投资		-	-
债券投资		-	643,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	754,895.97
应收利息	7.4.7.5	5,647.42	2,405.00
应收股利		-	-
应收申购款		1,890,196.71	1,177,585.50
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		183,953,164.21	83,993,539.15
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年12月31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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		753,868.16	-
应付赎回款		2,949,312.29	2,245,331.19
应付管理人报酬		72,965.34	32,310.48
应付托管费		14,593.08	6,462.12
应付销售服务费		21,430.08	8,509.77
应付交易费用	7.4.7.7	80,057.52	24,610.43

应交税费		1,050.33	1.61
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	138,734.12	138,089.53
负债合计		4,032,010.92	2,455,315.13
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	141,041,362.66	78,207,707.47
未分配利润	7.4.7.10	38,879,790.63	3,330,516.55
所有者权益合计		179,921,153.29	81,538,224.02
负债和所有者权益总计		183,953,164.21	83,993,539.15

注：报告截止日2021年12月31日，天弘中证红利低波动100指数型发起式证券投资基金A类基金份额净值1.2796元，天弘中证红利低波动100指数型发起式证券投资基金C类基金份额净值1.2741元；基金份额总额141,041,362.66份，其中天弘中证红利低波动100指数型发起式证券投资基金A类基金份额39,291,308.69份，天弘中证红利低波动100指数型发起式证券投资基金C类基金份额101,750,053.97份。

7.2 利润表

会计主体：天弘中证红利低波动100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12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2021年01月01日至 2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至202 0年12月31日
一、收入		38,979,028.02	4,444,810.86
1. 利息收入		502,645.11	148,224.96
其中：存款利息收入	7.4.7.11	367,615.87	121,546.75
债券利息收入		2,128.62	49.30
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产		-	26,628.91

收入			
证券出借利息收入		132,900.62	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		33,713,507.30	6,598,062.42
其中：股票投资收益	7.4.7.12	22,512,835.07	3,672,551.94
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	101,802.83	-
资产支持证券投资 收益	7.4.7.13. 3	-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	11,098,869.40	2,925,510.48
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	4,541,691.59	-2,349,304.96
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	221,184.02	47,828.44
减：二、费用		4,736,045.30	934,048.26
1. 管理人报酬		1,467,348.77	359,719.29
2. 托管费		293,469.76	71,943.91
3. 销售服务费		510,756.16	73,948.79
4. 交易费用	7.4.7.19	2,271,633.55	268,704.08
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 税金及附加		4,143.00	0.17
7. 其他费用	7.4.7.20	188,694.06	159,732.02
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		34,242,982.72	3,510,762.60
减：所得税费用		-	-

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		34,242,982.72	3,510,762.60
-------------------	--	---------------	--------------

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：天弘中证红利低波动100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12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2021年01月01日至2021年12月31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)	78,207,707.47	3,330,516.55	81,538,224.02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	34,242,982.72	34,242,982.72
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)	62,833,655.19	1,306,291.36	64,139,946.55
其中：1. 基金申购款	1,299,177,325.75	178,659,075.42	1,477,836,401.17
2. 基金赎回款	-1,236,343,670.56	-177,352,784.06	-1,413,696,454.62
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)	141,041,362.66	38,879,790.63	179,921,153.29
项 目	上年度可比期间		

	2020年01月01日至2020年12月31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)	98,637,738.95	98,822.95	98,736,561.90
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	3,510,762.60	3,510,762.60
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)	-20,430,031.48	-279,069.00	-20,709,100.48
其中：1. 基金申购款	170,585,083.54	3,193,680.54	173,778,764.08
2. 基金赎回款	-191,015,115.02	-3,472,749.54	-194,487,864.56
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)	78,207,707.47	3,330,516.55	81,538,224.02

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4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

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

天弘中证红利低波动100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[2019]1808号《关于准予天弘中证红利低波动100指数型发起式证券投资基金注册的批复》准予注册,由天弘基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘中证红利低波动100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,首次设立募集不包括认购资金利息共募集98,606,855.52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(2019)第0654号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《天弘中证红利低波动100指数型发起式证券投资基金基金合同》于2019年12月10日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为98,637,738.95份基金份额,其中认购资金利息折合30,883.43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,基金托管人为国泰君安证券股份有限公司。

根据《天弘中证红利低波动100指数型发起式证券投资基金基金合同》和《天弘中证红利低波动100指数型发起式证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金根据所收取认购/申购费用、赎回费用、销售服务费用方式的差异,将基金份额分为不同的类别。收取认购/申购费用、赎回费用,并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为天弘中证红利低波动100指数型发起式证券投资基金A类基金份额(以下简称“A类基金份额”);不收取认购/申购费用、赎回时收取赎回费用,且从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为天弘中证红利低波动100指数型发起式证券投资基金C类基金份额(以下简称“C类基金份额”)。本基金A类基金份额和C类基金份额两种收费模式并存,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。投资者可自行选择认购/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,发起资金认购部分为10,000,444.49份基金份额,发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于3年。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘中证红利低波动100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,以中证红利低波动100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)、银行存款、债券、债券回购、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。基金的投资组合比例为:本基金投资于中证红利低波动100指数成份股和备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%;本基金每个交易日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值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、存出保证金和应收申购

款等。本基金的业绩比较基准：中证红利低波动100指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。

本财务报表由本基金的基金管理人天弘基金管理有限公司于2022年3月28日批准报出。

7.4.2 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》、《天弘中证红利低波动100指数型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4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。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，发起式基金的基金合同生效三年后，若基金资产净值低于人民币两亿元的，基金合同自动终止。于2021年12月31日，本基金的基金资产净值为179,921,153.29，且本基金的基金合同将于未来12个月内生效满三年，本基金的管理人预计基金资产净值届时将高于人民币两亿元，故本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2021年度的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12月31日的财务状况以及2021年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对

金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率或票面利率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和可交换债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券和可交换债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

财政部于2017年颁布了修订后的《企业会计准则第14号-收入》，本基金于2021年1月1日起执行。本基金在编制2021年度财务报表时已采用该准则，该准则的采用未对本基金财务报表产生重大影响。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
活期存款	11,651,191.58	4,611,916.89
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	11,651,191.58	4,611,916.89

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	167,981,315.47	170,173,702.10	2,192,386.63
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	-	-
	银行间市场	-	-
	合计	-	-

资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	167,981,315.47	170,173,702.10	2,192,386.63
项目	上年度末 2020年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	79,095,546.04	76,746,241.08	-2,349,304.96
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	643,000.00	643,000.00
	银行间市场	-	-
	合计	643,000.00	643,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	79,738,546.04	77,389,241.08	-2,349,304.96

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应收活期存款利息	5,532.36	2,325.88

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	-	13.31
应收债券利息	-	50.74
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	115.06	15.07
合计	5,647.42	2,405.00

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
交易所市场应付交易费用	80,057.52	24,610.43
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	80,057.52	24,610.43

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日	上年度末 2020年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	28.85	89.53
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	130,000.00	130,000.00
其他应付	8,705.27	8,000.00

合计	138,734.12	138,089.53
----	------------	------------

7.4.7.9 实收基金

7.4.7.9.1 天弘中证红利低波动100A

金额单位：人民币元

项目 (天弘中证红利低波动100A)	本期 2021年01月01日至2021年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	25,003,387.49	25,003,387.49
本期申购	61,970,289.74	61,970,289.74
本期赎回(以“-”号填列)	-47,682,368.54	-47,682,368.54
本期末	39,291,308.69	39,291,308.69

7.4.7.9.2 天弘中证红利低波动100C

金额单位：人民币元

项目 (天弘中证红利低波动100C)	本期 2021年01月01日至2021年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	53,204,319.98	53,204,319.98
本期申购	1,237,207,036.01	1,237,207,036.01
本期赎回(以“-”号填列)	-1,188,661,302.02	-1,188,661,302.02
本期末	101,750,053.97	101,750,053.97

注：申购含转换转入份额；赎回含转换转出份额。

7.4.7.10 未分配利润

7.4.7.10.1 天弘中证红利低波动100A

单位：人民币元

项目 (天弘中证红利低波动100A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	2,289,744.60	-1,184,433.00	1,105,311.60
本期利润	3,919,937.98	2,596,473.49	6,516,411.47

本期基金份额交易产生的变动数	1,969,154.74	1,395,718.95	3,364,873.69
其中：基金申购款	9,336,737.00	1,257,814.51	10,594,551.51
基金赎回款	-7,367,582.26	137,904.44	-7,229,677.82
本期已分配利润	-	-	-
本期末	8,178,837.32	2,807,759.44	10,986,596.76

7.4.7.10.2 天弘中证红利低波动100C

单位：人民币元

项目 (天弘中证红利低波动100C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,744,740.18	-2,519,535.23	2,225,204.95
本期利润	25,781,353.15	1,945,218.10	27,726,571.25
本期基金份额交易产生的变动数	-9,862,104.67	7,803,522.34	-2,058,582.33
其中：基金申购款	149,655,472.42	18,409,051.49	168,064,523.91
基金赎回款	-159,517,577.09	-10,605,529.15	-170,123,106.24
本期已分配利润	-	-	-
本期末	20,663,988.66	7,229,205.21	27,893,193.87

7.4.7.11 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 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
活期存款利息收入	347,717.98	106,573.63
定期存款利息收入	-	11,637.50
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	12,651.80	2,596.10
其他	7,246.09	739.52
合计	367,615.87	121,546.75

7.4.7.12 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 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
卖出股票成交总额	1,085,344,858.86	125,955,371.44
减：卖出股票成本总额	1,062,832,023.79	122,282,819.50
买卖股票差价收入	22,512,835.07	3,672,551.94

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 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 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31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	101,802.83	-
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	101,802.83	-

7.4.7.13.2 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12月 31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月 31日
卖出债券(、债转 股及债券到期兑 付)成交总额	20,550,662.75	-

减：卖出债券（、 债转股及债券到期 兑付）成本总额	20,243,664.70	-
减：应收利息总额	205,195.22	-
买卖债券差价收入	101,802.83	-

7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间未取得资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间未取得贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间未取得买卖权证差价收入。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间未取得其他衍生工具投资收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021 年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020 年12月31日
股票投资产生的股利收益	11,098,869.40	2,925,510.48
其中：证券出借权益补偿收入	1,017,832.08	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	11,098,869.40	2,925,510.48

7.4.7.17 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12 月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12 月31日

1. 交易性金融资产	4,541,691.59	-2,349,304.96
——股票投资	4,541,691.59	-2,349,304.96
——债券投资	-	-
——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	4,541,691.59	-2,349,304.96

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
基金赎回费收入	217,058.64	42,428.62
基金转换费收入	4,125.38	5,399.82
合计	221,184.02	47,828.44

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
交易所市场交易费用	2,271,633.55	268,704.08
银行间市场交易费用	-	-
合计	2,271,633.55	268,704.08

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年 12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年 12月31日
审计费用	50,000.00	47,732.02
信息披露费	80,000.00	80,000.00
证券出借违约金	-	-
指数使用费	58,694.06	32,000.00
合计	188,694.06	159,732.02

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

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
国泰君安证券股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
蚂蚁科技集团股份有限公司	基金管理人的股东
天津信托有限责任公司	基金管理人的股东
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
芜湖高新投资有限公司	基金管理人的股东
新疆天瑞博丰股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
新疆天惠新盟股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
新疆天阜恒基股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东

新疆天聚宸兴股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
天弘创新资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 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12月31日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31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
国泰君安证券股份有限公司	-	-	136,931,217.54	42.09%

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 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12月31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
-	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31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
国泰君安证券股份有限公司	31,667.26	28.04%	-	-

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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,467,348.77	359,719.29
其中：支付销售机构的客户维护费	549,386.15	124,268.84

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	293,469.76	71,943.91

注:支付基金托管人国泰君安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。

7.4.10.2.3 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12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	天弘中证红利低波动100A	天弘中证红利低波动100C	合计
天弘基金管理有限公司	-	14,534.02	14,534.02
国泰君安证券股份有限公司	-	92.71	92.71
合计	-	14,626.73	14,626.73
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	天弘中证红利低波动100A	天弘中证红利低波动100C	合计
天弘基金管理有限公司	-	16,188.54	16,188.54
国泰君安证券股份有限公司	-	19.71	19.71
合计	-	16,208.25	16,208.25

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。天弘中证红利低波动100C按0.25%/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、自2020年05月18日起，天弘中证红利低波动100C按0.20%计提销售服务费。销售服务费费率调整公告详见官网。

3、天弘中证红利低波动100A不收取销售服务费。

7.4.10.3 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。

7.4.10.4 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

7.4.10.4.1 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

单位：人民币元

本期 2021年01月01日至2021年12月31日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
国泰君安证券股份有 限公司	1,608,589. 00	1,032. 48	-	-
上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日				
关联方名称	交易金额	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
-	-	-	-	-

7.4.10.4.2 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

单位：人民币元

本期 2021年01月01日至2021年12月31日										
关联方名称	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量(股)	出借期限(天)	费率	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额

国泰君安证券股份有限公司	2021073 0000007 58	温氏股份	2021-07 -30	31,450. 00	2,500	14	3.40%	40.37	-	-
上年度可比期间										
2020 年 01 月 01 日至 2020 年 12 月 31 日										
关联方名称	合约编号	证券名称	成交时间	交易金额	交易数量(股)	出借期限(天)	费率	利息收入	期末证券出借业务余额	期末应收利息余额
-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

天弘中证红利低波动100A

份额单位：份

项目	本期 2021年01月01日至 2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至 2020年12月31日
报告期初持有的基金份额	5,000,222.27	5,000,222.27
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	-	-
报告期末持有的基金份额	5,000,222.27	5,000,222.27
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	12.73%	20.00%

天弘中证红利低波动100C

份额单位：份

项目	本期 2021年01月01日至 2021年12月31日	上年度可比期间 2020年01月01日至 2020年12月31日
报告期初持有的基金份额	5,000,222.22	5,000,222.22
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	-	-
报告期末持有的基金份额	5,000,222.22	5,000,222.22
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	4.91%	9.40%

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。

7.4.10.5.2 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。

7.4.10.6 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12月31日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
国泰君安证券股份有限公司	11,651,191.58	347,717.98	4,611,916.89	106,573.63

注：本基金由基金托管人国泰君安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。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2021年01月01日至2021年12月31日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张/股）	总金额
国泰君安证券股份有限公司	605005	合兴股份	网下申购	634	4,044.92

有限公司					
国泰君安 证券股份 有限公司	688070	纵横股份	网下申购	1,037	24,016.92
国泰君安 证券股份 有限公司	688677	海泰新光	网下申购	580	20,740.80
国泰君安 证券股份 有限公司	605089	味知香	网下申购	370	10,556.10
国泰君安 证券股份 有限公司	605180	华生科技	网下申购	384	8,593.92
国泰君安 证券股份 有限公司	688395	正弦电气	网下申购	1,627	25,950.65
国泰君安 证券股份 有限公司	605319	无锡振华	网下申购	764	8,572.08
国泰君安 证券股份 有限公司	301009	可靠股份	网下申购	8,007	100,407.78
国泰君安 证券股份 有限公司	688276	百克生物	网下申购	2,359	85,749.65
国泰君安 证券股份 有限公司	688087	英科再生	网下申购	2,469	54,219.24
国泰君安 证券股份 有限公司	688718	唯赛勃	网下申购	3,145	18,398.25
国泰君安 证券股份	605507	国邦医药	网下申购	1,202	39,149.14

有限公司					
国泰君安 证券股份 有限公司	605589	圣泉集团	网下申购	1,750	42,017.50
国泰君安 证券股份 有限公司	601825	沪农商行	网下申购	15,480	137,772.00
国泰君安 证券股份 有限公司	688187	时代电气	网下申购	2,709	85,008.42
国泰君安 证券股份 有限公司	688767	博拓生物	网下申购	1,237	42,738.35
国泰君安 证券股份 有限公司	688262	国芯科技	网下申购	1,362	57,176.76
上年度可比期间 2020年01月01日至2020年12月31日					
关联方名 称	证券代 码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张/ 股）	总金额
国泰君安 证券股份 有限公司	600956	新天绿能	网下申购	2,067	6,573.06
国泰君安 证券股份 有限公司	688981	中芯国际	网上申购	500	13,730.00
国泰君安 证券股份 有限公司	688339	亿华通	网下申购	387	29,663.55
国泰君安 证券股份 有限公司	688286	敏芯股份	网下申购	337	21,119.79

国泰君安证券股份有限公司	605066	天正电气	网下申购	1,278	12,805.56
国泰君安证券股份有限公司	605388	均瑶健康	网下申购	1,230	16,518.90
国泰君安证券股份有限公司	603112	华翔股份	网下申购	895	6,998.90
国泰君安证券股份有限公司	003003	天元股份	网下申购	756	7,930.44

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 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。

7.4.12 期末（2021年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
688733	壹石通	2021-08-10	2022-02-17	科创板打新限售	15.49	75.36	2,525	39,122.5	190,284.00	-
688285	高铁电气	2021-10-12	2022-04-20	科创板打新限售	7.18	9.14	11,544	82,885.92	105,512.16	-

688718	唯赛勃	2021-07-20	2022-01-28	科创板打新限售	5.85	27.71	3,145	18,398.25	87,147.95	-
688110	东芯股份	2021-12-03	2022-06-10	科创板打新限售	30.18	40.37	1,826	55,108.68	73,715.62	-
688262	国芯科技	2021-12-28	2022-01-06	新股未上市	41.98	41.98	1,362	57,176.76	57,176.76	-
301039	中集车辆	2021-07-01	2022-01-10	创业板打新限售	6.96	12.51	1,143	7,955.28	14,298.93	-
301017	漱玉平民	2021-06-23	2022-01-05	创业板打新限售	8.86	23.80	555	4,917.30	13,209.00	-
301020	密封科技	2021-06-28	2022-01-06	创业板打新限售	10.64	30.44	421	4,479.44	12,815.24	-
301026	浩通科技	2021-07-08	2022-01-17	创业板打新限售	18.03	62.73	203	3,660.09	12,734.19	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2022-01-06	创业板打新限售	9.46	41.43	290	2,743.40	12,014.70	-
301025	读客文化	2021-07-06	2022-01-24	创业板打新限售	1.55	20.88	403	624.65	8,414.64	-

				售						
001234	泰慕士	2021-12-31	2022-01-11	新股未上市	16.53	16.53	333	5,504.49	5,504.49	-
301027	华蓝集团	2021-07-08	2022-01-19	创业板打新限售	11.45	16.65	286	3,274.70	4,761.90	-

注：1、根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期为自发行人股票上市之日起6个月。根据《上海证券交易所科创板上市公司股东以向特定机构投资者询价转让和配售方式减持股份实施细则》，基金通过询价转让受让的股份，在受让后6个月内不得转让。

2、根据《深圳证券交易所创业板首次公开发行证券发行与承销业务实施细则》，发行人和主承销商可以采用摇号限售方式或比例限售方式，安排基金通过网下发行获配的部分创业板股票设置不低于6个月的限售期。

3、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。

4、以上“可流通日”的日期，最终以上市公司公告为准。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2021年12月31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。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2021年12月31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。

7.4.12.4 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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。

7.4.13.2 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国泰君安证券股份有限公司开立于具有基金托管人资格的银行的托管账户，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，本基金以非约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过证券交易所综合业务平台向中国证券金融股份有限公司出借证券，本基金以约定申报方式参与的转融通证券出借业务为通过该方式向证券公司出借证券，本基金的基金管理人对借券证券公司的偿付能力等进行了必要的尽职调查与严格的准入管理，对不同的借券证券公司实施交易额度管理并进行动态调整，且借券证券公司最近1年的分类结果为A类，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。

7.4.13.2.1 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。

7.4.13.2.2 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。

7.4.13.2.3 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。

7.4.13.2.4 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12月31日	上年度末 2020年12月31日
AAA	-	643,000.00
AAA以下	-	-

未评级	-	-
合计	-	643,000.00

7.4.13.2.5 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。

7.4.13.2.6 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。

7.4.13.3 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12月31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。

7.4.13.3.1 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股票，不得超过该上市公司可流通股股票的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7.4.12。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%。于2021年12月31日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例符合法律法规的相关要求。

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。于2021年12月31日，本基金组合资产中7个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

本基金的管理人定期对组合中债券投资和资产支持证券投资部分面临的利率风险进行监控，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和存出保证金等。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021 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	11,651,191.58	-	-	-	11,651,191.58
存出保证金	232,426.40	-	-	-	232,426.40
交易性金融资产	-	-	-	170,173,702.10	170,173,702.10
应收利息	-	-	-	5,647.42	5,647.42
应收申购款	-	-	-	1,890,196.71	1,890,196.71
资产总计	11,883,617.98	-	-	172,069,546.23	183,953,164.21
负债					
应付证券清算款	-	-	-	753,868.16	753,868.16
应付赎回款	-	-	-	2,949,312.29	2,949,312.29
应付管理人报酬	-	-	-	72,965.34	72,965.34
应付托管费	-	-	-	14,593.08	14,593.08
应付销售服务费	-	-	-	21,430.08	21,430.08
应付交易费用	-	-	-	80,057.52	80,057.52
应交税费	-	-	-	1,050.33	1,050.33
其他负债	-	-	-	138,734.12	138,734.12
负债总计	-	-	-	4,032,010.92	4,032,010.92
利率敏感度缺口	11,883,617.98	-	-	168,037,535.31	179,921,153.29
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	4,611,916.89	-	-	-	4,611,916.89
结算备付金	27,004.01	-	-	-	27,004.01
存出保证金	30,490.70	-	-	-	30,490.70
交易性金融资产	-	-	643,000.00	76,746,241.08	77,389,241.08
应收证券清算款	-	-	-	754,895.97	754,895.97
应收利息	-	-	-	2,405.00	2,405.00
应收申购款	-	-	-	1,177,585.50	1,177,585.50
资产总计	4,669,411.60	-	643,000.00	78,681,127.55	83,993,539.15
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,245,331.19	2,245,331.19
应付管理人报酬	-	-	-	32,310.48	32,310.48

应付托管费	-	-	-	6,462.12	6,462.12
应付销售服务费	-	-	-	8,509.77	8,509.77
应付交易费用	-	-	-	24,610.43	24,610.43
应交税费	-	-	-	1.61	1.61
其他负债	-	-	-	138,089.53	138,089.53
负债总计	-	-	-	2,455,315.13	2,455,315.13
利率敏感度缺口	4,669,411.60	-	643,000.00	76,225,812.42	81,538,224.02

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2021年12月31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0.00%(2020年12月31日：0.79%)，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)。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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红利低波动100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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年12月31日		上年度末 2020年12月31日	
	公允价值	占基金	公允价值	占基金

		资产净 值比例 (%)		资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	170,173,702.10	94.58	76,746,241.08	94.12
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	170,173,702.10	94.58	76,746,241.08	94.12

7.4.13.4.3.2 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12月31日	上年度末 2020年12月31日
	业绩比较基准上升5%	9,024,830.85	3,098,452.51
	业绩比较基准下降5%	-9,024,830.85	-3,098,452.51

7.4.14 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12月31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169,576,112.52元，属于第二层次的余额为62,681.25元，属于第三层次的余额为534,908.33元(2020年12月31日：第一层次76,574,902.14元，第二层次814,338.94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

于2021年12月31日，本基金持有公允价值归属于第三层次的金融工具534,908.33元(2020年12月31日：无)。本基金本年度购买第三层次的金融工具223,159.96元(2020年度：无)，计入损益的第三层次的金融工具公允价值变动或当期投资收益311,748.37元(2020年度：无)。

于2021年12月31日，本基金持有的第三层级的交易性金融资产(均为股票投资)公允价值为534,908.33元，采用平均价格亚式期权模型进行估值，不可观察输入值为预期波动率，与公允价值之间为负相关关系。(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2021年12月31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) 根据财政部发布的《企业会计准则第22号—金融工具确认计量》、《企业会计准则第23号—金融资产转移》、《企业会计准则第24号—套期会计》和《企业会计准则第37号—金融工具列报》(以下合称“新金融工具准则”)相关衔接规定，以及财政部、银保监会于2020年12月30日发布的《关于进一步贯彻落实新金融工具相关会计准则的通知》，公募证券投资基金应当自2022年1月1日起执行新金融工具准则。截至2021年12月31日，本基金已完成了执行新金融工具准则对财务报表潜在影响的评估。鉴于本基金业务的性质，新金融工具准则预期不会对本基金的财务状况和经营成果产生重大影响。

本基金将自2022年1月1日起追溯执行相关新规定，并采用准则允许的实务简便方法，调整期初所有者权益，2021年的比较数据将不作重述。

(3)除公允价值和执行新金融工具准则外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	170,173,702.10	92.51
	其中：股票	170,173,702.10	92.51
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	11,651,191.58	6.33
8	其他各项资产	2,128,270.53	1.16
9	合计	183,953,164.21	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	915,824.00	0.51
B	采矿业	3,495,453.00	1.94
C	制造业	43,560,666.02	24.21
D	电力、热力、燃气及水生	5,879,638.00	3.27

	产和供应业		
E	建筑业	14,410,188.00	8.01
F	批发和零售业	12,369,357.00	6.87
G	交通运输、仓储和邮政业	13,825,725.40	7.68
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,107,350.00	1.17
J	金融业	41,303,466.48	22.96
K	房地产业	20,806,372.20	11.56
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	2,297,456.50	1.28
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	8,552,007.65	4.75
S	综合	-	-
	合计	169,523,504.25	94.22

8.2.2 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	532,404.08	0.30
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	13,209.00	0.01
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	57,176.76	0.03
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	4,761.90	0.00
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	37,932.31	0.02
S	综合	-	-
	合计	650,197.85	0.36

8.3 期末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

8.3.1 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	601006	大秦铁路	849,186	5,434,790.40	3.02
2	600479	千金药业	308,800	3,875,440.00	2.15
3	601988	中国银行	1,148,500	3,502,925.00	1.95
4	002146	荣盛发展	744,300	3,237,705.00	1.80
5	600566	济川药业	109,900	3,114,566.00	1.73
6	601328	交通银行	649,300	2,993,273.00	1.66
7	600016	民生银行	759,300	2,961,270.00	1.65
8	600153	建发股份	322,300	2,923,261.00	1.62
9	600377	宁沪高速	336,200	2,898,044.00	1.61
10	601098	中南传媒	299,400	2,865,258.00	1.59

11	601169	北京银行	633,400	2,812,296.00	1.56
12	601288	农业银行	938,700	2,759,778.00	1.53
13	600177	雅戈尔	380,078	2,618,737.42	1.46
14	600325	华发股份	431,500	2,597,630.00	1.44
15	600028	中国石化	580,500	2,455,515.00	1.36
16	600606	绿地控股	565,200	2,452,968.00	1.36
17	603858	步长制药	114,600	2,416,914.00	1.34
18	000090	天健集团	389,800	2,288,126.00	1.27
19	600901	江苏租赁	442,700	2,253,343.00	1.25
20	600823	世茂股份	683,400	2,241,552.00	1.25
21	001979	招商蛇口	167,500	2,234,450.00	1.24
22	600729	重庆百货	85,100	2,214,302.00	1.23
23	600820	隧道股份	399,500	2,149,310.00	1.19
24	002367	康力电梯	266,900	2,143,207.00	1.19
25	600637	东方明珠	223,000	2,107,350.00	1.17
26	002443	金洲管道	266,100	2,104,851.00	1.17
27	600064	南京高科	224,380	2,095,709.20	1.16
28	601928	凤凰传媒	249,085	2,015,097.65	1.12
29	600350	山东高速	388,800	2,006,208.00	1.12
30	000651	格力电器	54,100	2,003,323.00	1.11
31	000671	阳光城	658,400	1,988,368.00	1.11
32	601298	青岛港	345,700	1,967,033.00	1.09
33	600261	阳光照明	444,500	1,946,910.00	1.08
34	600565	迪马股份	794,500	1,938,580.00	1.08
35	601668	中国建筑	383,500	1,917,500.00	1.07
36	600023	浙能电力	467,500	1,888,700.00	1.05
37	600373	中文传媒	152,500	1,884,900.00	1.05
38	000156	华数传媒	211,200	1,786,752.00	0.99
39	002381	双箭股份	218,000	1,761,440.00	0.98
40	601398	工商银行	378,300	1,751,529.00	0.97
41	000006	深振业 A	387,800	1,729,588.00	0.96

42	601998	中信银行	365,569	1,688,928.78	0.94
43	000989	九芝堂	154,200	1,674,612.00	0.93
44	600502	安徽建工	396,800	1,646,720.00	0.92
45	600056	中国医药	136,600	1,613,246.00	0.90
46	002582	好想你	183,600	1,597,320.00	0.89
47	601229	上海银行	219,400	1,564,322.00	0.87
48	600900	长江电力	67,700	1,536,790.00	0.85
49	601000	唐山港	552,600	1,519,650.00	0.84
50	600062	华润双鹤	113,600	1,518,832.00	0.84
51	000778	新兴铸管	348,300	1,508,139.00	0.84
52	603458	勘设股份	112,570	1,491,552.50	0.83
53	600015	华夏银行	265,300	1,485,680.00	0.83
54	603368	柳药股份	77,600	1,477,504.00	0.82
55	600668	尖峰集团	80,820	1,477,389.60	0.82
56	601158	重庆水务	230,300	1,476,223.00	0.82
57	600390	五矿资本	273,600	1,455,552.00	0.81
58	002440	闰土股份	149,700	1,435,623.00	0.80
59	600266	城建发展	313,340	1,410,030.00	0.78
60	002746	仙坛股份	133,200	1,397,268.00	0.78
61	600527	江南高纤	576,500	1,383,600.00	0.77
62	600000	浦发银行	159,100	1,357,123.00	0.75
63	601318	中国平安	26,600	1,340,906.00	0.75
64	002244	滨江集团	286,000	1,332,760.00	0.74
65	000401	冀东水泥	111,000	1,327,560.00	0.74
66	600755	厦门国贸	180,800	1,303,568.00	0.72
67	600643	爱建集团	187,100	1,264,796.00	0.70
68	601992	金隅集团	442,600	1,256,984.00	0.70
69	601939	建设银行	209,600	1,228,256.00	0.68
70	600894	广日股份	162,000	1,221,480.00	0.68
71	002020	京新药业	127,100	1,208,721.00	0.67
72	601818	光大银行	350,600	1,163,992.00	0.65

73	000617	中油资本	220,600	1,142,708.00	0.64
74	002406	远东传动	179,500	1,100,335.00	0.61
75	601186	中国铁建	141,000	1,099,800.00	0.61
76	601997	贵阳银行	165,400	1,076,754.00	0.60
77	601390	中国中铁	180,200	1,043,358.00	0.58
78	601857	中国石油	211,800	1,039,938.00	0.58
79	002441	众业达	101,800	1,038,360.00	0.58
80	002489	浙江永强	283,300	1,011,381.00	0.56
81	600705	中航产融	253,500	1,006,395.00	0.56
82	600928	西安银行	229,000	984,700.00	0.55
83	002807	江阴银行	255,700	984,445.00	0.55
84	601607	上海医药	49,500	983,565.00	0.55
85	601800	中国交建	114,300	980,694.00	0.55
86	000685	中山公用	110,500	977,925.00	0.54
87	601688	华泰证券	51,700	918,192.00	0.51
88	600598	北大荒	62,900	915,824.00	0.51
89	000541	佛山照明	157,900	892,135.00	0.50
90	600284	浦东建设	131,600	831,712.00	0.46
91	600713	南京医药	166,100	815,551.00	0.45
92	600477	杭萧钢构	196,600	811,958.00	0.45
93	603018	华设集团	96,400	805,904.00	0.45
94	002958	青农商行	205,500	793,230.00	0.44
95	600612	老凤祥	16,400	751,940.00	0.42
96	601860	紫金银行	204,100	683,735.00	0.38
97	600919	江苏银行	114,490	667,476.70	0.37
98	601577	长沙银行	70,000	546,700.00	0.30
99	002839	张家港行	86,700	499,392.00	0.28
100	601128	常熟银行	62,900	415,769.00	0.23

8.3.2 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	688733	壹石通	2,525	190,284.00	0.11
2	688285	高铁电气	11,544	105,512.16	0.06
3	688718	唯赛勃	3,145	87,147.95	0.05
4	688110	东芯股份	1,826	73,715.62	0.04
5	688262	国芯科技	1,362	57,176.76	0.03
6	603230	内蒙新华	1,141	29,517.67	0.02
7	001296	长江材料	310	18,376.80	0.01
8	301039	中集车辆	1,143	14,298.93	0.01
9	301017	漱玉平民	555	13,209.00	0.01
10	301020	密封科技	421	12,815.24	0.01
11	301026	浩通科技	203	12,734.19	0.01
12	301021	英诺激光	290	12,014.70	0.01
13	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00
14	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
15	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00
16	603176	N汇通	1,924	4,713.80	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	600028	中国石化	29,387,127.40	36.04
2	601006	大秦铁路	27,534,285.87	33.77
3	002110	三钢闽光	26,003,441.10	31.89
4	601328	交通银行	21,283,261.00	26.10
5	000036	华联控股	21,172,065.30	25.97
6	601988	中国银行	18,618,903.00	22.83

7	601288	农业银行	18,259,927.00	22.39
8	601003	柳钢股份	17,874,402.26	21.92
9	600377	宁沪高速	17,201,593.71	21.10
10	002146	荣盛发展	16,739,747.00	20.53
11	600376	首开股份	16,042,454.26	19.67
12	601169	北京银行	15,526,043.00	19.04
13	600016	民生银行	15,172,501.00	18.61
14	600023	浙能电力	14,961,743.23	18.35
15	600808	马钢股份	14,878,336.42	18.25
16	600565	迪马股份	14,322,986.58	17.57
17	601098	中南传媒	14,305,081.00	17.54
18	601398	工商银行	14,252,611.84	17.48
19	600170	上海建工	13,442,641.72	16.49
20	001979	招商蛇口	13,221,762.68	16.22
21	600566	济川药业	13,015,357.46	15.96
22	601088	中国神华	12,666,277.51	15.53
23	600325	华发股份	12,347,181.98	15.14
24	000402	金融街	12,273,618.38	15.05
25	600153	建发股份	11,773,072.00	14.44
26	600177	雅戈尔	11,468,119.78	14.06
27	000778	新兴铸管	11,354,353.00	13.93
28	600479	千金药业	11,281,123.12	13.84
29	000989	九芝堂	11,257,005.52	13.81
30	601857	中国石油	11,048,912.00	13.55
31	600019	宝钢股份	10,735,407.00	13.17
32	600398	海澜之家	10,616,536.00	13.02
33	601318	中国平安	10,593,181.00	12.99
34	600642	申能股份	10,572,540.54	12.97
35	601668	中国建筑	10,339,994.00	12.68
36	601229	上海银行	10,305,119.33	12.64
37	600820	隧道股份	10,176,484.44	12.48

38	603328	依顿电子	10,091,364.67	12.38
39	601998	中信银行	9,786,538.39	12.00
40	600900	长江电力	9,732,670.00	11.94
41	600704	物产中大	9,685,412.70	11.88
42	601928	凤凰传媒	9,670,936.00	11.86
43	600466	蓝光发展	9,445,857.93	11.58
44	600901	江苏租赁	9,347,748.12	11.46
45	600266	城建发展	9,096,402.39	11.16
46	000898	鞍钢股份	9,033,500.78	11.08
47	601939	建设银行	8,893,881.30	10.91
48	600000	浦发银行	8,607,972.96	10.56
49	600123	兰花科创	8,408,244.42	10.31
50	000825	太钢不锈	8,344,333.00	10.23
51	600919	江苏银行	8,272,654.94	10.15
52	600637	东方明珠	8,213,854.63	10.07
53	600782	新钢股份	8,191,980.00	10.05
54	600663	陆家嘴	7,826,100.51	9.60
55	600755	厦门国贸	7,796,777.20	9.56
56	601333	广深铁路	7,770,536.00	9.53
57	601818	光大银行	7,739,973.00	9.49
58	600048	保利发展	7,716,175.00	9.46
59	600025	华能水电	7,713,182.27	9.46
60	600015	华夏银行	7,404,212.25	9.08
61	600674	川投能源	7,388,041.79	9.06
62	600585	海螺水泥	7,183,705.00	8.81
63	603458	勘设股份	7,140,466.64	8.76
64	002233	塔牌集团	7,070,370.00	8.67
65	000002	万科 A	7,056,104.18	8.65
66	002440	闰土股份	7,054,366.24	8.65
67	601000	唐山港	7,032,236.00	8.62
68	601800	中国交建	6,997,739.00	8.58

69	600064	南京高科	6,791,738.34	8.33
70	002443	金洲管道	6,671,053.00	8.18
71	600018	上港集团	6,659,484.00	8.17
72	601992	金隅集团	6,602,519.00	8.10
73	601009	南京银行	6,579,888.00	8.07
74	600795	国电电力	6,579,111.00	8.07
75	002051	中工国际	6,517,122.00	7.99
76	601186	中国铁建	6,389,564.00	7.84
77	000537	广宇发展	6,351,310.50	7.79
78	000685	中山公用	6,249,753.25	7.66
79	600688	上海石化	6,096,597.00	7.48
80	601997	贵阳银行	5,983,219.40	7.34
81	601225	陕西煤业	5,977,691.00	7.33
82	601390	中国中铁	5,867,842.00	7.20
83	600284	浦东建设	5,734,960.44	7.03
84	600643	爱建集团	5,541,881.00	6.80
85	600886	国投电力	5,535,701.00	6.79
86	600277	亿利洁能	5,384,058.00	6.60
87	600649	城投控股	5,345,667.00	6.56
88	000651	格力电器	5,334,286.79	6.54
89	600027	华电国际	5,132,292.00	6.29
90	601828	美凯龙	5,120,961.00	6.28
91	601958	金钼股份	5,015,238.00	6.15
92	600308	华泰股份	4,987,656.00	6.12
93	600846	同济科技	4,950,208.00	6.07
94	600535	天士力	4,801,084.21	5.89
95	002807	江阴银行	4,672,093.20	5.73
96	000031	大悦城	4,573,914.40	5.61
97	601139	深圳燃气	4,246,967.94	5.21
98	600582	天地科技	4,181,133.00	5.13
99	601618	中国中冶	4,127,032.00	5.06

100	600373	中文传媒	4,103,780.00	5.03
101	601166	兴业银行	4,101,788.00	5.03
102	603323	苏农银行	3,985,078.21	4.89
103	601766	中国中车	3,945,584.00	4.84
104	000156	华数传媒	3,867,653.48	4.74
105	300498	温氏股份	3,741,807.66	4.59
106	601117	中国化学	3,737,417.00	4.58
107	600056	中国医药	3,486,877.00	4.28
108	600606	绿地控股	3,393,896.10	4.16
109	600021	上海电力	3,280,643.00	4.02
110	601886	江河集团	3,235,655.00	3.97
111	600863	内蒙华电	3,171,724.00	3.89
112	600390	五矿资本	2,862,783.00	3.51
113	601567	三星医疗	2,844,154.00	3.49
114	600908	无锡银行	2,804,935.00	3.44
115	600801	华新水泥	2,737,999.00	3.36
116	600261	阳光照明	2,717,903.00	3.33
117	002391	长青股份	2,597,058.00	3.19
118	600210	紫江企业	2,562,193.50	3.14
119	600729	重庆百货	2,456,190.00	3.01
120	600502	安徽建工	2,409,566.00	2.96
121	600823	世茂股份	2,304,756.00	2.83
122	000090	天健集团	2,164,710.78	2.65
123	603858	步长制药	2,159,461.10	2.65
124	002376	新北洋	2,149,285.23	2.64
125	600350	山东高速	2,110,738.45	2.59
126	601985	中国核电	2,110,011.00	2.59
127	600639	浦东金桥	2,067,837.67	2.54
128	000671	阳光城	2,063,060.00	2.53
129	002367	康力电梯	2,040,046.96	2.50
130	600062	华润双鹤	2,033,117.28	2.49

131	600068	葛洲坝	2,031,007.00	2.49
132	002039	黔源电力	1,983,144.00	2.43
133	601298	青岛港	1,982,603.00	2.43
134	000401	冀东水泥	1,950,612.00	2.39
135	600252	中恒集团	1,912,709.00	2.35
136	002244	滨江集团	1,892,288.00	2.32
137	002061	浙江交科	1,848,509.00	2.27
138	601933	永辉超市	1,750,613.00	2.15
139	601688	华泰证券	1,749,775.00	2.15
140	600388	龙净环保	1,725,619.00	2.12
141	002406	远东传动	1,718,893.41	2.11
142	002381	双箭股份	1,717,664.55	2.11
143	600894	广日股份	1,715,224.77	2.10
144	603368	柳药股份	1,690,761.44	2.07
145	600668	尖峰集团	1,676,678.05	2.06
146	000006	深振业A	1,665,742.00	2.04

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。

8.4.2 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	600028	中国石化	30,574,278.40	37.50
2	002110	三钢闽光	29,505,967.59	36.19
3	601006	大秦铁路	23,803,280.16	29.19
4	000036	华联控股	20,783,782.50	25.49
5	601328	交通银行	20,172,580.00	24.74
6	601003	柳钢股份	19,948,256.23	24.46
7	600808	马钢股份	19,424,913.74	23.82
8	601288	农业银行	15,949,977.00	19.56

9	601988	中国银行	15,894,809.00	19.49
10	600377	宁沪高速	15,669,234.06	19.22
11	600376	首开股份	15,153,574.51	18.58
12	601088	中国神华	14,747,130.63	18.09
13	600170	上海建工	14,471,034.54	17.75
14	600023	浙能电力	14,358,865.00	17.61
15	601169	北京银行	13,660,427.44	16.75
16	600123	兰花科创	13,655,797.15	16.75
17	600704	物产中大	13,453,530.00	16.50
18	000402	金融街	13,290,695.86	16.30
19	601398	工商银行	12,823,209.00	15.73
20	000825	太钢不锈	12,782,500.98	15.68
21	600019	宝钢股份	12,594,288.00	15.45
22	600642	申能股份	12,409,833.07	15.22
23	002146	荣盛发展	12,407,021.21	15.22
24	601857	中国石油	12,145,238.00	14.90
25	600398	海澜之家	12,136,576.77	14.88
26	001979	招商蛇口	11,409,516.67	13.99
27	601098	中南传媒	11,386,112.00	13.96
28	600016	民生银行	11,373,152.63	13.95
29	000898	鞍钢股份	11,224,048.40	13.77
30	600565	迪马股份	10,849,769.76	13.31
31	600325	华发股份	10,831,151.59	13.28
32	000778	新兴铸管	10,816,858.12	13.27
33	000989	九芝堂	10,540,209.64	12.93
34	600566	济川药业	10,267,453.64	12.59
35	603328	依顿电子	9,959,514.00	12.21
36	600479	千金药业	9,571,177.40	11.74
37	600663	陆家嘴	9,443,031.05	11.58
38	600919	江苏银行	9,441,994.50	11.58
39	601928	凤凰传媒	9,436,521.10	11.57

40	600782	新钢股份	9,386,363.00	11.51
41	600153	建发股份	9,340,081.18	11.45
42	600900	长江电力	9,205,597.00	11.29
43	601229	上海银行	9,089,181.72	11.15
44	600025	华能水电	8,863,969.68	10.87
45	601318	中国平安	8,857,052.99	10.86
46	600177	雅戈尔	8,703,560.97	10.67
47	601668	中国建筑	8,628,551.80	10.58
48	600820	隧道股份	8,441,252.42	10.35
49	601998	中信银行	8,429,370.00	10.34
50	600674	川投能源	8,283,793.00	10.16
51	600795	国电电力	8,178,528.00	10.03
52	600266	城建发展	8,171,918.79	10.02
53	601333	广深铁路	7,988,338.20	9.80
54	600755	厦门国贸	7,830,222.92	9.60
55	601939	建设银行	7,743,018.28	9.50
56	600018	上港集团	7,682,076.00	9.42
57	601009	南京银行	7,324,473.26	8.98
58	600901	江苏租赁	7,316,944.52	8.97
59	600466	蓝光发展	7,282,450.00	8.93
60	600000	浦发银行	7,275,883.00	8.92
61	601225	陕西煤业	7,150,477.00	8.77
62	600048	保利发展	6,752,560.00	8.28
63	002233	塔牌集团	6,528,544.00	8.01
64	601818	光大银行	6,455,671.00	7.92
65	600688	上海石化	6,382,676.64	7.83
66	000537	广宇发展	6,368,985.88	7.81
67	000002	万科 A	6,324,322.00	7.76
68	600585	海螺水泥	6,293,312.00	7.72
69	002051	中工国际	6,187,172.36	7.59
70	601800	中国交建	6,158,022.00	7.55

71	600015	华夏银行	6,139,706.32	7.53
72	601958	金钼股份	6,130,668.40	7.52
73	601000	唐山港	6,010,091.60	7.37
74	600886	国投电力	6,003,393.00	7.36
75	600637	东方明珠	5,986,129.22	7.34
76	002440	闰土股份	5,964,156.98	7.31
77	600308	华泰股份	5,935,932.48	7.28
78	601828	美凯龙	5,926,009.02	7.27
79	600284	浦东建设	5,846,764.32	7.17
80	000685	中山公用	5,841,781.70	7.16
81	600027	华电国际	5,781,155.36	7.09
82	601186	中国铁建	5,747,857.88	7.05
83	600649	城投控股	5,650,285.13	6.93
84	603458	勘设股份	5,551,725.66	6.81
85	601992	金隅集团	5,438,953.00	6.67
86	600277	亿利洁能	5,338,380.00	6.55
87	601390	中国中铁	5,249,751.00	6.44
88	600535	天士力	4,894,675.40	6.00
89	600064	南京高科	4,858,050.33	5.96
90	002443	金洲管道	4,793,861.49	5.88
91	601997	贵阳银行	4,786,602.20	5.87
92	600582	天地科技	4,597,433.02	5.64
93	601139	深圳燃气	4,571,483.31	5.61
94	601618	中国中冶	4,535,495.00	5.56
95	601166	兴业银行	4,512,093.00	5.53
96	601766	中国中车	4,451,879.00	5.46
97	600846	同济科技	4,386,130.03	5.38
98	000031	大悦城	4,286,389.17	5.26
99	600643	爱建集团	4,196,588.80	5.15
100	603323	苏农银行	4,148,397.70	5.09
101	601117	中国化学	4,115,355.00	5.05

102	600021	上海电力	3,965,526.02	4.86
103	300498	温氏股份	3,959,752.33	4.86
104	002807	江阴银行	3,768,894.39	4.62
105	600863	内蒙华电	3,756,219.00	4.61
106	600210	紫江企业	3,673,992.54	4.51
107	601886	江河集团	3,477,890.96	4.27
108	600188	兖矿能源	3,335,432.50	4.09
109	601985	中国核电	3,140,264.00	3.85
110	000651	格力电器	3,043,810.00	3.73
111	600908	无锡银行	2,977,918.00	3.65
112	601567	三星医疗	2,900,627.72	3.56
113	002391	长青股份	2,585,813.00	3.17
114	600068	葛洲坝	2,416,489.00	2.96
115	600373	中文传媒	2,344,131.00	2.87
116	002039	黔源电力	2,302,286.00	2.82
117	000488	晨鸣纸业	2,285,776.00	2.80
118	000156	华数传媒	2,181,959.00	2.68
119	600252	中恒集团	2,125,386.00	2.61
120	002376	新北洋	2,101,211.35	2.58
121	600801	华新水泥	2,067,010.00	2.54
122	600971	恒源煤电	2,019,251.60	2.48
123	600395	盘江股份	1,945,728.84	2.39
124	002061	浙江交科	1,809,158.00	2.22
125	600388	龙净环保	1,795,970.00	2.20
126	600639	浦东金桥	1,788,485.00	2.19
127	600056	中国医药	1,723,740.78	2.11
128	601211	国泰君安	1,680,362.00	2.06
129	600348	华阳股份	1,634,491.00	2.00

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。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	1,151,717,793.22
卖出股票收入（成交）总额	1,085,344,858.86

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 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。

8.11 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 本基金投资的前十名证券发行主体中，【交通银行股份有限公司】于2021年07月13日收到中国银行保险监督管理委员会出具公开处罚的通报，于2021年08月13日收到中国人民银行出具公开处罚的通报；【中国民生银行股份有限公司】于2021年07月05日收到银行间市场交易商协会出具通报批评、责令整改的通报，于2021年07月13日收到中国银行保险监督管理委员会出具公开处罚的通报；【中国银行股份有限公司】于2021年05月17日收到中国银行保险监督管理委员会出具公开处罚的通报。

8.12.2 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。

8.12.3 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	232,426.40
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	5,647.42
5	应收申购款	1,890,196.71
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,128,270.53

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 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。

8.12.5.2 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	688733	壹石通	190,284.00	0.11	科创板打新限售
2	688285	高铁电气	105,512.16	0.06	科创板打新限售
3	688718	唯赛勃	87,147.95	0.05	科创板打新限售
4	688110	东芯股份	73,715.62	0.04	科创板打新限售

					售
5	688262	国芯科技	57,176.76	0.03	新股未上市

8.12.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 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
天弘中证红利低波动100 A	3,410	11,522.38	13,794,417.52	35.11%	25,496,891.17	64.89%
天弘中证红利低波动100 C	134,518	756.40	5,000,222.22	4.91%	96,749,831.75	95.09%
合计	137,928	1,022.57	18,794,639.74	13.33%	122,246,722.92	86.67%

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）。

9.2 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	天弘中证红利低波 动100A	588,466.25	1.50%
	天弘中证红利低波 动100C	558,219.22	0.55%
	合计	1,146,685.47	0.81%

9.3 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	天弘中证红利低波 动100A	0
	天弘中证红利低波 动100C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基 金	天弘中证红利低波 动100A	0~10
	天弘中证红利低波 动100C	0
	合计	0~10

9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额 占基金总 份额比例	发起份额总数	发起份额 占基金总 份额比例	发起份额 承诺持有 期限
基金管理人固 有资金	10,000,444.49	7.09%	10,000,444.49	7.09%	三年
基金管理人高 级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人 员	-	-	-	-	-
基金管理人股	-	-	-	-	-

东					
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,444.49	7.09%	10,000,444.49	7.09%	-

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

	天弘中证红利低波动100A	天弘中证红利低波动100C
基金合同生效日(2019年12月10日)基金份额总额	48,307,428.05	50,330,310.90
本报告期期初基金份额总额	25,003,387.49	53,204,319.98
本报告期基金总申购份额	61,970,289.74	1,237,207,036.01
减：本报告期基金总赎回份额	47,682,368.54	1,188,661,302.02
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	39,291,308.69	101,750,053.97

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。

§ 11 重大事件揭示

11.1 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。

11.2 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，韩歆毅先生任职公司董事长，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高级管理人员变更公告》。

本报告期内，胡晓明先生不再担任公司董事长，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董事长离任及总经理代行董事长职务的公告》。

本报告期内，朱海扬先生任职公司副总经理，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高级管理人员变更的公告》。

本报告期内，天弘基金管理有限公司股东会2021年第2次会议、第4次会议审议通过，选举韩歆毅先生、周志峰先生、祖国明先生、张杰先生、孟路先生新任公司第七届董事会董事。胡晓明先生、卢信群先生、屠剑威先生、黄浩先生、魏新顺先生不再担任公司董事。

本报告期内，本基金的基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

根据《存托凭证发行与交易管理办法（试行）》等法律法规及基金合同等法律文件的规定，本基金投资策略发生变更，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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金应向普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）支付服务费 50,000.00 元。截至本报告期末，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）已为本基金提供审计服务 2 年 1 个月。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人、托管人及其高级管理人员没有发生受稽查或处罚的情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	
安信证券	3	758,134,588.47	34.02%	326,993.08	34.03%	-
东方财富证券	2	160,245,381.96	7.19%	69,119.82	7.19%	-
方正	5	95,806,282.59	4.30%	41,321.34	4.30%	-

证券						
光大证券	2	231,411,707.68	10.39%	99,810.81	10.39%	-
广发证券	2	2,479,680.42	0.11%	1,070.16	0.11%	-
国盛证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券	8	-	-	-	-	-
海通证券	3	143,402,978.49	6.44%	61,851.33	6.44%	-
开源证券	1	2,853,235.33	0.13%	1,230.65	0.13%	-
首创证券	1	-	-	-	-	-
西部证券	1	108,108,227.05	4.85%	46,628.39	4.85%	-
信达证券	1	627,042,432.80	28.14%	270,357.13	28.13%	-
银河证券	2	95,049,967.13	4.27%	40,994.62	4.27%	-
中金财富	1	-	-	-	-	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-
中信建投证券	2	3,690,511.72	0.17%	1,591.90	0.17%	-

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：安信证券上海交易单元、方正证券上海交易单元、广发证券深圳交易单元、国盛证券深圳交易单元、海通证券上海交易单元、首创

证券上海交易单元、信达证券上海交易单元、银河证券深圳交易单元、中金财富深圳交易单元。

4、本基金报告期内停止租用交易单元：无。

11.7.2 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
安信证券	37,579,834.50	94.08%	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	1,203,833.00	3.01%	-	-	-	-	-	-
方正证券	148,000.00	0.37%	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国盛证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	180,314.00	0.45%	-	-	-	-	-	-
开源证券	-	-	-	-	-	-	-	-
首创证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西部证券	-	-	-	-	-	-	-	-
信达证券	180,108.00	0.45%	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	654,188.20	1.64%	-	-	-	-	-	-

11.8 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	上海证券报、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	上海证券报、中国证监会指定媒介	2021-01-11

	换业务以及参加其费率优惠活动的公告		
3	天弘基金管理有限公司公告	上海证券报、中国证监会指定媒介	2021-01-13
4	天弘中证红利低波动100指数型发起式证券投资基金2020年第四季度报告	上海证券报、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	上海证券报、中国证监会指定媒介	2021-02-01
6	天弘基金管理有限公司公告	上海证券报、中国证监会指定媒介	2021-02-04
7	天弘基金管理有限公司公告	上海证券报、中国证监会指定媒介	2021-02-20
8	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	上海证券报、中国证监会指定媒介	2021-02-24
9	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	上海证券报、中国证监会指定媒介	2021-03-04
10	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	上海证券报、中国证监会指定媒介	2021-03-17
11	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	上海证券报、中国证监会指定媒介	2021-03-18

12	天弘基金管理有限公司关于增加上海挖财基金销售有限公司为天弘中证红利低波动100指数型发起式证券投资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	上海证券报、中国证监会指定媒介	2021-03-19
13	天弘中证红利低波动100指数型发起式证券投资基金2020年年度报告	上海证券报、中国证监会指定媒介	2021-03-31
14	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	上海证券报、中国证监会指定媒介	2021-03-31
15	天弘中证红利低波动100指数型发起式证券投资基金基金合同	上海证券报、中国证监会指定媒介	2021-03-31
16	天弘中证红利低波动100指数型发起式证券投资基金招募说明书（更新）	上海证券报、中国证监会指定媒介	2021-03-31
17	天弘中证红利低波动100指数型发起式证券投资基金托管协议	上海证券报、中国证监会指定媒介	2021-03-31
18	天弘基金管理有限公司关于增加广发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	上海证券报、中国证监会指定媒介	2021-04-02
19	天弘中证红利低波动100指数型发起式证券投资基金产品资料概要（更新）	上海证券报、中国证监会指定媒介	2021-04-06
20	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	上海证券报、中国证监会指定媒介	2021-04-07

	示		
21	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	上海证券报、中国证监会指定媒介	2021-04-12
22	天弘中证红利低波动100指数型发起式证券投资基金招募说明书（更新）	上海证券报、中国证监会指定媒介	2021-04-14
23	天弘基金管理有限公司公告	上海证券报、中国证监会指定媒介	2021-04-21
24	天弘中证红利低波动100指数型发起式证券投资基金2021年第一季度报告	上海证券报、中国证监会指定媒介	2021-04-22
25	天弘基金管理有限公司公告	上海证券报、中国证监会指定媒介	2021-04-22
26	天弘基金管理有限公司公告	上海证券报、中国证监会指定媒介	2021-04-23
27	天弘基金管理有限公司关于增加长城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	上海证券报、中国证监会指定媒介	2021-05-06
28	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	上海证券报、中国证监会指定媒介	2021-06-02
29	天弘基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	上海证券报、中国证监会指定媒介	2021-06-02
30	天弘基金管理有限公司关于增加中信建投期货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	上海证券报、中国证监会指定媒介	2021-06-07

	换业务以及参加其费率优惠活动的公告		
31	天弘基金管理有限公司公告	上海证券报、中国证监会指定媒介	2021-06-10
32	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	上海证券报、中国证监会指定媒介	2021-06-11
33	天弘基金管理有限公司公告	上海证券报、中国证监会指定媒介	2021-06-19
34	天弘基金管理有限公司关于调整天弘中证红利低波动100指数型发起式证券投资基金基金经理的公告	上海证券报、中国证监会指定媒介	2021-06-19
35	天弘基金管理有限公司关于增加上海万得基金销售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	上海证券报、中国证监会指定媒介	2021-06-22
36	天弘中证红利低波动100指数型发起式证券投资基金产品资料概要（更新）	上海证券报、中国证监会指定媒介	2021-06-22
37	天弘中证红利低波动100指数型发起式证券投资基金招募说明书（更新）	上海证券报、中国证监会指定媒介	2021-06-23
38	天弘基金管理有限公司公告	上海证券报、中国证监会指定媒介	2021-07-02
39	天弘基金管理有限公司关于增加华林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	上海证券报、中国证监会指定媒介	2021-07-05

	换业务以及参加其费率优惠活动的公告		
40	天弘基金管理有限公司关于增加国盛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	上海证券报、中国证监会指定媒介	2021-07-15
41	天弘基金管理有限公司关于增加国金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	上海证券报、中国证监会指定媒介	2021-07-19
42	天弘中证红利低波动100指数型发起式证券投资基金2021年第二季度报告	上海证券报、中国证监会指定媒介	2021-07-21
43	天弘基金管理有限公司公告	上海证券报、中国证监会指定媒介	2021-07-22
44	天弘基金管理有限公司公告	上海证券报、中国证监会指定媒介	2021-07-28
45	天弘基金管理有限公司关于增加阳光人寿保险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	上海证券报、中国证监会指定媒介	2021-08-03
46	天弘基金管理有限公司公告	上海证券报、中国证监会指定媒介	2021-08-04
47	天弘基金管理有限公司高级管理人员变更公告	上海证券报、中国证监会指定媒介	2021-08-04
48	天弘基金管理有限公司公告	上海证券报、中国证监会指定媒介	2021-08-09

49	天弘基金管理有限公司关于增加上海联泰基金销售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	上海证券报、中国证监会指定媒介	2021-08-10
50	天弘中证红利低波动100指数型发起式证券投资基金产品资料概要（更新）	上海证券报、中国证监会指定媒介	2021-08-11
51	天弘基金管理有限公司关于调整天弘中证红利低波动100指数型发起式证券投资基金基金经理的公告	上海证券报、中国证监会指定媒介	2021-08-14
52	天弘中证红利低波动100指数型发起式证券投资基金产品资料概要（更新）	上海证券报、中国证监会指定媒介	2021-08-17
53	天弘基金管理有限公司住所变更公告	上海证券报、中国证监会指定媒介	2021-08-18
54	天弘中证红利低波动100指数型发起式证券投资基金招募说明书（更新）	上海证券报、中国证监会指定媒介	2021-08-18
55	天弘中证红利低波动100指数型发起式证券投资基金2021年中期报告	上海证券报、中国证监会指定媒介	2021-08-31
56	天弘基金管理有限公司公告	上海证券报、中国证监会指定媒介	2021-09-01
57	天弘基金管理有限公司公告	上海证券报、中国证监会指定媒介	2021-09-03
58	天弘中证红利低波动100指数型发起式证券投资基金招募说明书（更新）	上海证券报、中国证监会指定媒介	2021-10-22
59	天弘中证红利低波动100指数型发起式证券投资基金20	上海证券报、中国证监会指定媒介	2021-10-27

	21年第三季度报告		
60	天弘基金管理有限公司关于董事变更的公告	上海证券报、中国证监会指定媒介	2021-11-17
61	天弘基金管理有限公司关于在网上直销系统开通邮储银行快捷支付业务并实施相关费率优惠的公告	上海证券报、中国证监会指定媒介	2021-11-25
62	天弘基金管理有限公司公告	上海证券报、中国证监会指定媒介	2021-12-30

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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。

12.2 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）》等法律法规及基金合同等法律文件的规定，本基金已于2021年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。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准天弘中证红利低波动100指数型发起式证券投资基金募集的文件
- 2、天弘中证红利低波动100指数型发起式证券投资基金基金合同
- 3、天弘中证红利低波动100指数型发起式证券投资基金托管协议
- 4、天弘中证红利低波动100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

13.2 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

13.3 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
二〇二二年三月三十一日