

天弘中证银行交易型开放式指数证券投资基金

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:招商证券股份有限公司

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。

基金托管人招商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	5
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	6
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
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	17
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	17
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	17
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	17
§6 审计报告	18
6.1 审计报告基本信息	18
6.2 审计报告的基本内容	18
§7 年度财务报表	20
7.1 资产负债表	20
7.2 利润表	22
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	24
7.4 报表附注	26
§8 投资组合报告	65
8.1 期末基金资产组合情况	65
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	65
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	67
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	71
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	73
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	74
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	74
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	74
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	74
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	74

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	74
8.12 投资组合报告附注.....	74
§9 基金份额持有人信息.....	76
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	76
9.2 期末上市基金前十名持有人.....	77
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	77
9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	78
§10 开放式基金份额变动.....	78
§11 重大事件揭示.....	78
11.1 基金份额持有人大会决议.....	78
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.....	78
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	79
11.4 基金投资策略的改变.....	79
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	79
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.....	79
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	79
11.8 其他重大事件.....	81
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	85
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.....	85
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	86
§13 备查文件目录.....	86
13.1 备查文件目录.....	86
13.2 存放地点.....	86
13.3 查阅方式.....	86

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	天弘中证银行交易型开放式指数证券投资基金
基金简称	银行
场内简称	银行
基金主代码	515290
基金运作方式	交易型开放式
基金合同生效日	2020年12月11日
基金管理人	天弘基金管理有限公司
基金托管人	招商证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	8,470,532,937.00份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	上海证券交易所
上市日期	2020-12-28

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金力争将日均跟踪偏离度控制在0.2%以内，年化跟踪误差控制在2%以内。
投资策略	本基金的主要投资策略包括：债券投资策略、资产支持证券投资策略、股指期货投资策略、融资及转融通投资策略、存托凭证投资策略。
业绩比较基准	中证银行指数收益率
风险收益特征	本基金属于股票型基金，预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。本基金采用完全复制法跟踪标的指数的表现，具有与标的指数、以及标的指数所代表的股票市场相似的风险收益特征。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

名称	天弘基金管理有限公司		招商证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	童建林	韩鑫普
	联系电话	022-83310208	0755-82943666
	电子邮箱	service@thfund.com.cn	tgb@cmschina.com.cn
客户服务电话	95046		95565
传真	022-83865569		0755-82960794
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		深圳市福田区福田街道福华一路111号
办公地址	天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层		深圳市福田区福田街道福华一路111号
邮政编码	300203		518000
法定代表人	韩歆毅		霍达

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金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
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

§ 3 主要财务指标、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12月11日（基金合同生效日）-2020年12月31日
本期已实现收益	675,146,536.18	-9,546,355.95
本期利润	132,532,588.15	117,326,201.96
加权平均基金份额本期利润	0.0159	0.0658
本期加权平均净值利润率	1.50%	6.60%
本期基金份额净值增长率	-0.97%	1.03%
3.1.2 期末数据和指标	2021年末	2020年末
期末可供分配利润	4,062,356.95	-70,423,036.09
期末可供分配基金份额利润	0.0005	-0.0073
期末基金资产净值	8,474,595,293.95	9,697,467,968.28
期末基金份额净值	1.0005	1.0103
3.1.3 累计期末指标	2021年末	2020年末
基金份额累计净值增长率	0.05%	1.03%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.63%	0.90%	-0.42%	0.90%	-0.21%	0.00%
过去六个月	-8.01%	1.17%	-9.95%	1.17%	1.94%	0.00%

过去一年	-0.97%	1.24%	-4.41%	1.24%	3.44%	0.00%
自基金合同生效日起至今	0.05%	1.21%	-4.73%	1.22%	4.78%	-0.01%

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

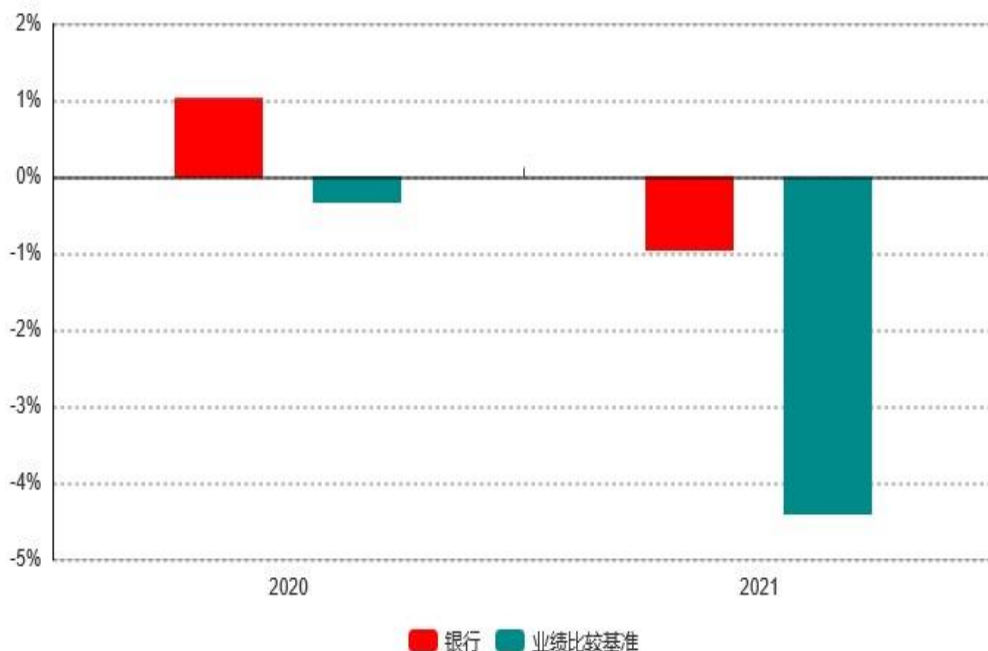
天弘中证银行交易型开放式指数证券投资基金累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



注：1、本基金合同于2020年12月11日生效。

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2020年12月11日至2021年06月10日，建仓期结束时及至报告期末，各项资产配置比例均符合基金合同的约定。

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2020年12月11日生效。基金合同生效当年2020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2020年12月11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发起式基金中基金（FOF）、天弘甄选食品饮料股票型发起式证券投资基金、天弘创新领航混合型证券投资基金、天弘聚新三个月定期开放混合型证券投资基金、天弘荣创一年持有期混合型证券投资基金、天弘中证科技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		
陈瑶	本基金基金经理	2020年12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、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、打新、成分股调整导致的权重偏离因素。当由于申赎等情况可能对指数跟踪效果带来影响时,本基金坚持既定的指数化投资策略,对指数基金采取被动复制与组合优化相结合的方式跟踪指数,同时紧密跟踪成分股的股息事件,及时有效处理,避免权重偏离造成跟踪误差的扩大。报告期内,本基金整体运行平稳。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2021年12月31日,本基金份额净值为1.0005元,本报告期份额净值增长率-0.97%,同期业绩比较基准增长率-4.41%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2021年一季度以来,受地产端信用风险的爆发、疫情反复以及大宗商品价格上涨等因素的影响,经济压力逐渐显现。2021年末中央经济工作会议确定“稳增长”的主要政策基调。2022年货币政策和财政政策将继续共同发力。货币政策更加看重“防风险”与“稳增长”,1月中旬央行下调MLF和逆回购利率,随后LPR利率调降,其中,5年期的下调体现了对房地产需求端的适度改善。随着地产端信用风险的缓释,以及地产政策的边际改善,2022年地产端的风险将逐步得到缓解。财政政策方面,资金端,地方债发行速度明显加快;项目端,“推动形成实物工作量”。我们认为伴随着财政政策的逐步发力以及低利率支撑将带来经济增长的稳步复苏。

对于股票市场而言，美国加息预期可能成为今年股票市场的不确定因素，可能将带来部分板块的估值波动。股票市场的风格分化可能继续延续，但部分板块也回落到了低估值区间，可予以关注。

对银行来说，目前是对银行比较友好的政策环境。经济压力逐渐显现，政策底日趋明朗，一般1季度处于政策和经济数据的真空期，政策目前偏暖，整个1季度应该能够有相对较好的表现。对2022年整体的银行板块，我们建议先看政策，之后看政策执行的效果。乐观情形下：（1）随着政策发力，宽信用力度稳步推进，政策底有望逐步向经济底传导，明年宏观经济将止住下滑态势，触底回升。经济景气度回暖，也将为银行业经营创造稳定的市场环境。（2）随着宽信用力度加大，房地产市场融资形势逐步好转，银行股估值水平或将会得到提升。风险点在于政策执行的效果如何以及宏观经济复苏的情况。

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

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

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

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

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

§ 6 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22465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	天弘中证银行交易型开放式指数证券投资基金 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银行交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“天弘中证银行ETF”)的财务报表,包括2021年12月31日和2020年12月31日的资产负债表,2021年度和2020年12月11日(基金合同生效日)至2020年12月31日止期间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</p> <p>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银行ETF2021年12月31日和2020年12月31日的财务状况以及2021年度和2020年12月11日(基金合同生效日)至2020年12月31日止期间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。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于</p>

	天弘中证银行ETF，并履行了职业道德方面的其他责任。
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>天弘中证银行ETF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银行ETF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银行ETF、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银行ETF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</p>

	<p>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,就可能对天弘中证银行ETF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银行ETF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：天弘中证银行交易型开放式指数证券投资基金

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	上年度末
----	-----	-----	------

		2021年12月31日	2020年12月31日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	11,623,746.56	176,759,695.58
结算备付金		1,349,314.96	-
存出保证金		999,755.74	-
交易性金融资产	7.4.7.2	8,464,424,875.76	9,617,688,466.14
其中：股票投资		8,337,340,875.76	9,617,688,466.14
基金投资		-	-
债券投资		127,084,000.00	-
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		6,502,558.56	-
应收利息	7.4.7.5	15,845.25	60,130.93
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		8,484,916,096.83	9,794,508,292.65
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		4,483,944.80	95,637,989.39
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		3,641,842.29	405,740.65

应付托管费		728,368.49	81,148.14
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	532,983.02	890,555.28
应交税费		376.17	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	933,288.11	24,890.91
负债合计		10,320,802.88	97,040,324.37
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	8,470,532,937.00	9,598,492,937.00
未分配利润	7.4.7.10	4,062,356.95	98,975,031.28
所有者权益合计		8,474,595,293.95	9,697,467,968.28
负债和所有者权益总计		8,484,916,096.83	9,794,508,292.65

注：1. 报告截止日2021年12月31日，基金份额净值1.0005元，基金份额总额8,470,532,937.00份。

2. 本财务报表的实际编制期间为2021年度和2020年12月11日(基金合同生效日)至2020年12月31日止期间(下同)。

7.2 利润表

会计主体：天弘中证银行交易型开放式指数证券投资基金

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12月11日(基金 合同生效日)至2020年 12月31日
一、收入		193,934,093.40	119,013,425.81
1. 利息收入		1,831,692.41	335,507.22
其中：存款利息收入	7.4.7.11	338,433.80	335,507.22
债券利息收入		10,741.21	-

资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		1,482,517.40	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		729,361,840.07	44,548.38
其中：股票投资收益	7.4.7.12	386,273,038.06	44,548.38
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	12,133,167.10	-
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	330,955,634.91	-
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-542,613,948.03	126,872,557.91
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	5,354,508.95	-8,239,187.70
减：二、费用		61,401,505.25	1,687,223.85
1. 管理人报酬		44,080,619.74	405,740.65
2. 托管费		8,816,123.97	81,148.14
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.19	5,408,759.01	1,162,544.15
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 税金及附加		11,165.38	-
7. 其他费用	7.4.7.20	3,084,837.15	37,790.91

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		132,532,588.15	117,326,201.96
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		132,532,588.15	117,326,201.96

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：天弘中证银行交易型开放式指数证券投资基金

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)	9,598,492,937.00	98,975,031.28	9,697,467,968.28
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	132,532,588.15	132,532,588.15
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-1,127,960,000.00	-227,445,262.48	-1,355,405,262.48
其中：1. 基金申购款	6,710,180,000.00	337,519,724.29	7,047,699,724.29
2. 基金赎回款	-7,838,140,000.00	-564,964,986.77	-8,403,104,986.77
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）	8,470,532,937.00	4,062,356.95	8,474,595,293.95
项 目	上年度可比期间		
	2020年12月11日（基金合同生效日）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）	608,092,937.00	-	608,092,937.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	117,326,201.96	117,326,201.96
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）	8,990,400,000.00	-18,351,170.68	8,972,048,829.32
其中：1. 基金申购款	9,039,600,000.00	-18,221,675.86	9,021,378,324.14
2. 基金赎回款	-49,200,000.00	-129,494.82	-49,329,494.82
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）	9,598,492,937.00	98,975,031.28	9,697,467,968.28

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

天弘中证银行交易型开放式指数证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2020]3011号《关于准予天弘中证银行交易型开放式指数证券投资基金注册的批复》准予注册,由天弘基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘中证银行交易型开放式指数证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为交易型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币608,086,853.00元(含募集股票市值),业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2020)第1097号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《天弘中证银行交易型开放式指数证券投资基金基金合同》于2020年12月11日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为608,092,937.00份基金份额,其中认购资金利息折合6,084.00份基金份额。本基金的基金管理人为天弘基金管理有限公司,基金托管人为招商证券股份有限公司。

根据《天弘中证银行交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和《天弘中证银行交易型开放式指数证券投资基金招募说明书》的有关规定,经上海证券交易所(以下简称“上交所”)自律监管决定书[2020]423号文审核同意,本基金608,092,937.00份基金份额于2020年12月28日在上交所挂牌交易。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘中证银行交易型开放式指数证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资目标是紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化。本基金力争将日均跟踪偏离度控制在0.2%以内,年化跟踪误差控制在2%以内。本基金以标的指数成份股、备选成份股为主要投资对象。此外,为更好地实现基金的投资目标,本基金还可以投资于国内依法发行上市的非成份股(包括中小板、创业板及其他经中国证监会允许上市的股票)、存托凭证、债券(包括国债、央行票据、地方政府债、金融债、企业债、公司债、次级债、可转换债券、可交换债券、分离交易可转债、中期票据、短期融资券、超短期融资券等)、货币市场工具、同业存单、债券回购、资产支持证券、银行存款、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金可根据相关法律法规和基金合同的约定,参与融资和转融通证券出借业务。基金的投资组合比例为:本基金投资于标的指数的成份股及其备选成份股的比例不低于基金资产净值的90%,且不低于非现金基金资产的80%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金,股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。本基金的业绩比较基准为:中证银行指数收益率。

本基金的基金管理人天弘基金管理有限公司以本基金为目标ETF,将原天弘中证银行指数型发起式证券投资基金转型为天弘中证银行交易型开放式指数证券投资基金联

接基金(以下简称“天弘中证银行ETF联接基金”)。天弘中证银行ETF联接基金为契约型开放式基金,投资目标与本基金类似,将绝大多数基金资产投资于本基金。

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》、《天弘中证银行交易型开放式指数证券投资基金基金合同》和在财务报表附注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。

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年度和2020年12月11日(基金合同生效日)至2020年12月31日止期间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日和2020年12月31日的财务状况以及2021年度和2020年12月11日(基金合同生效日)至2020年12月31日止期间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。本期财务报表的实际编制期间为2021年度和2020年12月11日(基金合同生效日)至2020年12月31日。

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。

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和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配。当基金份额净值增长率超过标的指数同期增长率达到1%以上时，可进行收益分配。本基金以使收益分配后基金份额净值增长率尽可能贴近标的指数同期增长率为原则进行收益分配。收益分配后有可能使除息后的基金份额净值低于面值。

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	11,623,746.56	176,759,695.58
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	11,623,746.56	176,759,695.58

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	8,753,082,265.88	8,337,340,875.76	-415,741,390.12
贵金属投资-金交所黄金合约	-	-	-
债券	交易所市场	127,084,000.00	127,084,000.00
	银行间市场	-	-
	合计	127,084,000.00	127,084,000.00
资产支持证券	-	-	-
基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	8,880,166,265.88	8,464,424,875.76	-415,741,390.12
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		9,490,815,908.23	9,617,688,466.14	126,872,557.91
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		9,490,815,908.23	9,617,688,466.14	126,872,557.91

注：股票投资的估值增值和股票投资的公允价值均包含可退替代款估值增值。

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	11,775.83	60,130.93
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	667.92	-
应收债券利息	2,785.40	-
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	121.21	-
其他	494.89	-
合计	15,845.25	60,130.93

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	532,983.02	890,555.28
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	532,983.02	890,555.28

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	-	-
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	290,546.45	546.45
其他应付	642,741.66	24,344.46
合计	933,288.11	24,890.91

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	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	9,598,492,937.00	9,598,492,937.00
本期申购	6,710,180,000.00	6,710,180,000.00
本期赎回（以“-”号填列）	-7,838,140,000.00	-7,838,140,000.00
本期末	8,470,532,937.00	8,470,532,937.00

注：本基金合同于2020年12月11日生效，基金合同生效日的基金份额总额为608,092,937.00份基金份额，其中认购资金利息折合6,084.00份基金份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-70,423,036.09	169,398,067.37	98,975,031.28
本期利润	675,146,536.18	-542,613,948.03	132,532,588.15
本期基金份额交易产生的变动数	31,501,929.28	-258,947,191.76	-227,445,262.48
其中：基金申购款	373,782,561.95	-36,262,837.66	337,519,724.29
基金赎回款	-342,280,632.67	-222,684,354.10	-564,964,986.77
本期已分配利润	-	-	-
本期末	636,225,429.37	-632,163,072.42	4,062,356.95

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12月11日（基金合同生效 日）至2020年12月31日
活期存款利息收入	251,265.27	258,776.15
定期存款利息收入	-	-
其他存款利息收入	-	-
结算备付金利息收入	60,574.26	-
其他	26,594.27	76,731.07
合计	338,433.80	335,507.22

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

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12月11日（基金合同 生效日）至2020年12月31 日
股票投资收益——买卖股票差价收入	163,248,393.20	-160,483.01
股票投资收益——赎回差价收入	223,024,644.86	205,031.39
股票投资收益——申购差价收入	-	-
股票投资收益——证券出借差价收入	-	-
合计	386,273,038.06	44,548.38

7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至 2021年12月31日	上年度可比期间 2020年12月11日（基金合同生效 日）至2020年12月31日
卖出股票成交总额	2,634,362,588.52	77,011,930.44
减：卖出股票成本总额	2,471,114,195.32	77,172,413.45
买卖股票差价收入	163,248,393.20	-160,483.01

7.4.7.12.3 股票投资收益——赎回差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至 2021年12月31日	上年度可比期间 2020年12月11日（基金合同生效 日）至2020年12月31日
赎回基金份额对价总额	8,403,104,986.77	49,329,494.82
减：现金支付赎回款总额	1,422,279,904.77	8,003,175.82
减：赎回股票成本总额	6,757,800,437.14	41,121,287.61
赎回差价收入	223,024,644.86	205,031.39

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2 021年12月31日	上年度可比期间 2020年12月11日（基金合同生效 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	12,133,167.10	-
债券投资收益——赎回差价 收入	-	-
债券投资收益——申购差价 收入	-	-
合计	12,133,167.10	-

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12月11日（基金合同生效日） 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	91,812,222.91	-
减：卖出债券（、 债转股及债券到期 兑付）成本总额	79,671,100.00	-
减：应收利息总额	7,955.81	-
买卖债券差价收入	12,133,167.10	-

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12月11日（基金合同生 效日）至2020年12月31日
股票投资产生的股利收益	330,955,634.91	-
其中：证券出借权益补偿收入	1,618,979.61	-
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	330,955,634.91	-

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20 21年12月31日	上年度可比期间 2020年12月11日（基金合同生效日） 至2020年12月31日
1. 交易性金融资产	-542,613,948.03	126,872,557.91
——股票投资	-542,613,948.03	126,872,557.91
——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	-	-

增值税		
合计	-542,613,948.03	126,872,557.91

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12月11日（基金合同生效 日）至2020年12月31日
基金赎回费收入	-	-
基金转换费收入	-	-
ETF基金替代损益	5,354,508.95	-8,239,187.70
延期合约递延费收入	-	-
合计	5,354,508.95	-8,239,187.70

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12月11日（基金合同生效 日）至2020年12月31日
交易所市场交易费用	5,408,759.01	1,162,544.15
银行间市场交易费用	-	-
合计	5,408,759.01	1,162,544.15

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12月11日（基金合同生效 日）至2020年12月31日
审计费用	120,000.00	-
信息披露费	120,000.00	-
证券出借违约金	-	-
指数使用费	2,644,837.15	24,344.46

IOPV计算发布费	50,000.00	546.45
ETF登记结算费	150,000.00	12,500.00
开户费	-	400.00
合计	3,084,837.15	37,790.91

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
招商证券股份有限公司	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
天弘中证银行交易型开放式指数证券投资基金联接基金	本基金的联接基金

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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12月11日（基金合同生效日） 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
招商证券 股份有限公司	172,620,382.49	3.28%	287,129,538.70	13.06%

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
招商证券 股份有限公司	39,928.18	1.79%	39,802.68	7.47%
关联方名称	上年度可比期间 2020年12月11日（基金合同生效日）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
招商证券 股份有限	66,411.72	7.46%	66,411.72	7.46%

公司				
----	--	--	--	--

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12月11日（基金合同 生效日）至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	44,080,619.74	405,740.65
其中：支付销售机构的客户维护费	3,004.73	1,481.86

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12月11日（基金合同生 效日）至2020年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	8,816,123.97	81,148.14

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

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**

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

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

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

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自有资金投资本基金的情况**

本基金本报告期及上年度可比期间无基金管理人运用自有资金投资本基金的情况。

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

份额单位：份

关联方名称	本期末 2021年12月31日		上年度末 2020年12月31日	
	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例	持有的基金份额	持有的基金份额占基金总份额的比例
天弘中证银行交易型开放式指数证券投资基金联接基金	8,007,708,400.00	94.54%	8,912,584,100.00	92.85%
招商证券股份有限	17,457,900.00	0.21%	26,262,800.00	0.27%

公司				
----	--	--	--	--

注：除基金管理人之外的其他关联方投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

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12月11日（基金合同生效日） 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
招商证券股份有限公司	11,623,746.56	251,265.27	176,759,695.58	258,776.15

注：本基金由基金托管人招商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
招商证券股份有限公司	605368	蓝天燃气	网下申购	1,204	18,011.84
招商证券股份有限公司	601963	重庆银行	网下申购	7,472	80,921.76
招商证券股份有限公司	003037	三和管桩	网下申购	1,274	8,128.12
招商证券	688059	华锐精密	网下申购	1,023	37,943.07

股份有限 公司					
招商证券 股份有限 公司	300960	通业科技	网下申购	2,332	28,170.56
招商证券 股份有限 公司	001201	东瑞股份	网下申购	477	30,232.26
招商证券 股份有限 公司	300991	创益通	网下申购	2,535	33,107.10
招商证券 股份有限 公司	688517	金冠电气	网下申购	2,892	22,297.32
招商证券 股份有限 公司	605069	正和生态	网下申购	608	9,199.04
招商证券 股份有限 公司	601728	中国电信	网上申购	29,000	131,370.00
招商证券 股份有限 公司	688772	珠海冠宇	网下申购	12,960	187,012.80
招商证券 股份有限 公司	688739	成大生物	网下申购	9,882	1,087,020.00
招商证券 股份有限 公司	001288	运机集团	网下申购	537	7,813.35
招商证券 股份有限 公司	301193	家联科技	网下申购	2,970	91,268.10
招商证券	688206	概伦电子	网下申购	6,000	169,680.00

股份有限 公司					
上年度可比期间 2020年12月11日（基金合同生效日）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
-	-	-	-	-	-

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
6881 87	时代 电气	2021 -08- 30	2022 -03- 07	科创 板打 新限 售	31.3 8	76.6 5	33,865	1,06 2,68 3.70	2,59 5,75 2.25	-
6883 85	复旦 微电	2021 -07- 27	2022 -02- 07	科创 板打 新限 售	6.23	48.5 8	8,986	55,98 2.78	436,5 39.88	-
6882 39	航宇 科技	2021 -06- 25	2022 -01- 05	科创 板打 新限 售	11.4 8	67.4 6	4,926	56,55 0.48	332,3 07.96	-

688262	国芯科技	2021-12-28	2022-01-06	新股未上市	41.98	41.98	7,129	299,275.42	299,275.42	-
688509	正元地信	2021-07-22	2022-02-07	科创板打新限售	1.97	6.17	15,433	30,403.01	95,221.61	-
301177	迪阿股份	2021-12-08	2022-06-15	创业板打新限售	116.88	116.08	792	92,568.96	91,935.36	-
688210	统联精密	2021-12-20	2022-06-27	科创板打新限售	42.76	39.53	2,218	94,841.68	87,677.54	-
688511	天微电子	2021-07-22	2022-02-07	科创板打新限售	28.09	54.52	1,490	41,854.10	81,234.80	-
301136	招标股份	2021-12-31	2022-01-11	新股未上市	10.52	10.52	7,172	75,449.44	75,449.44	-
688622	禾信仪器	2021-09-03	2022-03-14	科创板打新限售	17.70	56.93	1,204	21,310.80	68,543.72	-
301087	可孚医疗	2021-10-15	2022-04-25	创业板打新限售	93.09	75.34	848	78,940.32	63,888.32	-
301050	雷电微力	2021-08-17	2022-02-24	创业板打新限售	60.64	234.74	233	14,129.12	54,694.42	-

301029	怡合达	2021-07-14	2022-01-24	创业板打新限售	14.14	89.87	462	6,532.68	41,519.94	-
301035	润丰股份	2021-07-21	2022-01-28	创业板打新限售	22.04	56.28	644	14,193.76	36,244.32	-
301211	亨迪药业	2021-12-14	2022-06-22	创业板打新限售	25.80	33.65	967	24,948.60	32,539.55	-
301090	华润材料	2021-10-19	2022-04-26	创业板打新限售	10.45	11.22	2,764	28,883.80	31,012.08	-
301127	C天源	2021-12-23	2022-06-30	创业板打新限售	12.03	17.12	1,685	20,270.55	28,847.20	-
301039	中集车辆	2021-07-01	2022-01-10	创业板打新限售	6.96	12.51	2,064	14,365.44	25,820.64	-
301221	光庭信息	2021-12-15	2022-06-22	创业板打新限售	69.89	88.72	280	19,569.20	24,841.60	-
301166	C优宁维	2021-12-21	2022-06-28	创业板打新限售	86.06	94.50	253	21,773.18	23,908.50	-
301069	凯盛新材	2021-09-	2022-03-	创业板打	5.17	44.21	539	2,786.63	23,829.19	-

		16	28	新限售						
301096	百诚医药	2021-12-13	2022-06-20	创业板打新限售	79.60	78.53	272	21,651.20	21,360.16	-
301093	华兰股份	2021-10-21	2022-05-05	创业板打新限售	58.08	49.85	409	23,754.72	20,388.65	-
301149	隆华新材	2021-11-03	2022-05-10	创业板打新限售	10.07	16.76	1,214	12,224.98	20,346.64	-
300994	久祺股份	2021-08-02	2022-02-14	创业板打新限售	11.90	45.45	420	4,998.00	19,089.00	-
301100	风光股份	2021-12-10	2022-06-17	创业板打新限售	27.81	31.14	599	16,658.19	18,652.86	-
301088	戎美股份	2021-10-19	2022-04-28	创业板打新限售	33.16	24.67	704	23,344.64	17,367.68	-
301168	通灵股份	2021-12-02	2022-06-10	创业板打新限售	39.08	52.13	329	12,857.32	17,150.77	-
301101	明月镜片	2021-12-09	2022-06-16	创业板打新限售	26.91	43.36	371	9,983.61	16,086.56	-

3011 90	善水 科技	2021 -12- 17	2022 -06- 24	创业 板打 新限 售	27.8 5	27.4 6	575	16,01 3.75	15,78 9.50	-
3010 89	拓新 药业	2021 -10- 20	2022 -04- 27	创业 板打 新限 售	19.1 1	67.9 3	220	4,20 4.20	14,94 4.60	-
3010 46	能辉 科技	2021 -08- 10	2022 -02- 17	创业 板打 新限 售	8.34	48.9 9	290	2,41 8.60	14,20 7.10	-
3011 11	粤万 年青	2021 -11- 30	2022 -06- 07	创业 板打 新限 售	10.4 8	36.6 8	379	3,97 1.92	13,90 1.72	-
3011 88	力诺 特玻	2021 -11- 04	2022 -05- 11	创业 板打 新限 售	13.0 0	20.4 8	647	8,41 1.00	13,25 0.56	-
3010 17	漱玉 平民	2021 -06- 23	2022 -01- 05	创业 板打 新限 售	8.86	23.8 0	555	4,91 7.30	13,20 9.00	-
3011 99	迈赫 股份	2021 -11- 30	2022 -06- 07	创业 板打 新限 售	29.2 8	32.0 0	402	11,77 0.56	12,86 4.00	-
3010 20	密封 科技	2021 -06- 28	2022 -01- 06	创业 板打 新限 售	10.6 4	30.4 4	421	4,47 9.44	12,81 5.24	-
3011 38	华研 精机	2021 -12- 17	2022 -06- 24	创业 板打 新限 售	26.1 7	44.8 6	285	7,45 8.45	12,78 5.10	-

		08	15	新限售						
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	-
301126	达嘉维康	2021-11-30	2022-06-07	创业板打新限售	12.37	19.23	662	8,188.94	12,730.26	-
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	-
301092	争光股份	2021-10-21	2022-05-05	创业板打新限售	36.31	35.52	323	11,728.13	11,472.96	-
301048	金鹰重工	2021-08-11	2022-02-28	创业板打新限售	4.13	12.96	843	3,481.59	10,925.28	-
301028	东亚机械	2021-07-12	2022-01-20	创业板打新限售	5.31	13.50	733	3,892.23	9,895.50	-
301045	天禄科技	2021-08-06	2022-02-17	创业板打新限售	15.81	28.37	335	5,296.35	9,503.95	-
300774	倍杰特	2021-07-26	2022-02-16	创业板打新限售	4.57	21.08	444	2,029.08	9,359.52	-

301040	中环海陆	2021-07-26	2022-02-07	创业板打新限售	13.57	38.51	241	3,270.37	9,280.91	-
301078	孩子王	2021-09-30	2022-04-14	创业板打新限售	5.77	12.14	756	4,362.12	9,177.84	-
301182	凯旺科技	2021-12-16	2022-06-23	创业板打新限售	27.12	30.58	294	7,973.28	8,990.52	-
301062	上海艾录	2021-09-07	2022-03-14	创业板打新限售	3.31	17.01	523	1,731.13	8,896.23	-
301193	家联科技	2021-12-02	2022-06-09	创业板打新限售	30.73	29.14	297	9,126.81	8,654.58	-
301052	果麦文化	2021-08-23	2022-02-28	创业板打新限售	8.11	33.64	252	2,043.72	8,477.28	-
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	-
300814	中富电路	2021-08-04	2022-02-14	创业板打新限售	8.40	23.88	328	2,755.20	7,832.64	-
301133	金钟股份	2021-11-	2022-05-	创业板打	14.33	26.95	286	4,098.38	7,707.70	-

		19	26	新限售						
301030	仕净科技	2021-07-15	2022-01-24	创业板打新限售	6.10	31.52	242	1,476.20	7,627.84	-
301033	迈普医学	2021-07-15	2022-01-26	创业板打新限售	15.14	59.97	108	1,635.12	6,476.76	-
301049	超越科技	2021-08-17	2022-02-24	创业板打新限售	19.34	32.92	196	3,790.64	6,452.32	-
301032	新柴股份	2021-07-15	2022-01-24	创业板打新限售	4.97	12.51	513	2,549.61	6,417.63	-
301056	森赫股份	2021-08-27	2022-03-07	创业板打新限售	3.93	11.09	572	2,247.96	6,343.48	-
301036	双乐股份	2021-07-21	2022-02-16	创业板打新限售	23.38	29.93	205	4,792.90	6,135.65	-
301041	金百泽	2021-08-02	2022-02-11	创业板打新限售	7.31	28.21	215	1,571.65	6,065.15	-
301072	中捷精工	2021-09-22	2022-03-29	创业板打新限售	7.46	33.41	181	1,350.26	6,047.21	-

300854	中兰环保	2021-09-08	2022-03-16	创业板打新限售	9.96	27.29	203	2,021.88	5,539.87	-
301063	海锅股份	2021-09-09	2022-03-24	创业板打新限售	17.40	36.11	153	2,662.20	5,524.83	-
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	-
301038	深水规院	2021-07-22	2022-02-07	创业板打新限售	6.68	20.23	266	1,776.88	5,381.18	-
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	-
301037	保立佳	2021-07-21	2022-02-07	创业板打新限售	14.82	24.26	193	2,860.26	4,682.18	-
301073	君亭酒店	2021-09-22	2022-03-30	创业板打新限售	12.24	32.00	144	1,762.56	4,608.00	-
301053	远信工业	2021-08-25	2022-03-01	创业板打新限售	11.87	28.78	155	1,839.85	4,460.90	-
301057	汇隆新材	2021-08-31	2022-03-09	创业板打新限售	8.03	19.02	218	1,750.54	4,146.36	-

				售						
301068	大地海洋	2021-09-16	2022-03-28	创业板打新限售	13.98	28.38	144	2,013.12	4,086.72	-
301079	邵阳液压	2021-10-11	2022-04-19	创业板打新限售	11.92	24.82	140	1,668.80	3,474.80	-
7.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
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：张）	期末成本总额	期末估值总额	备注
113052	兴业转债	2021-12-27	2022-01-14	新债未上市	100.00	100.00	1,270,840	127,084.00	127,084.00	-

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，锁定期限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

金额单位：人民币元

序号	证券代码	证券名称	出借到期日	期末估值单价	数量（单位：股）	期末估值总额
1	601860	紫金银行	2022年01月10日-2022年01月14日	3.35	529,900	1,775,165.00
2	601916	浙商银行	2022年01月13日-2022年01月13日	3.50	545,200	1,908,200.00
合计					1,075,100	3,683,365.00

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

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

本基金的基金管理人奉行全面风险管理理念，建立了以审计与风险控制委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、内控合规部、风险管理部、内审部和相关业务部门

构成的风险管理架构体系。在全面风险管理体系的框架下，董事会负责监督检查公司的合法合规运营、内部控制、风险管理，从而控制公司的整体运营风险。在董事会下设立审计与风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理委员会，主要负责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招商证券股份有限公司开立于具有基金托管人资格的银行的托管账户，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，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	127,084,000.00	-
AAA以下	-	-
未评级	-	-
合计	127,084,000.00	-

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来自调整基金投资组合时，由于部分成份股流动性差，导致本基金难以及

时完成组合调整，或承受较大市场冲击成本，从而造成基金投资组合收益偏离标的指数收益的风险。

于2021年12月31日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

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、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金所持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。

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。

本基金的基金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、结算备付金、存出保证金和债券投资等。

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	11,623,746.56	-	-	-	11,623,746.56
结算备付金	1,349,314.96	-	-	-	1,349,314.96
存出保证金	999,755.74	-	-	-	999,755.74
交易性金融资产	-	-	127,084,000.00	8,337,340,875.76	8,464,424,875.76
应收证券清算款	-	-	-	6,502,558.56	6,502,558.56
应收利息	-	-	-	15,845.25	15,845.25
资产总计	13,972,817.26	-	127,084,000.00	8,343,859,279.57	8,484,916,096.83
负债					
应付证券清算款	-	-	-	4,483,944.80	4,483,944.80
应付管理人报酬	-	-	-	3,641,842.29	3,641,842.29
应付托管费	-	-	-	728,368.49	728,368.49
应付交易费用	-	-	-	532,983.02	532,983.02
应交税费	-	-	-	376.17	376.17
其他负债	-	-	-	933,288.11	933,288.11
负债总计	-	-	-	10,320,802.88	10,320,802.88
利率敏感度缺口	13,972,817.26	-	127,084,000.00	8,333,538,476.69	8,474,595,293.95
上年度末 2020 年 12 月 31 日					
资产					
银行存款	176,759,695.58	-	-	-	176,759,695.58
交易性金融资产	-	-	-	9,617,688,466.14	9,617,688,466.14
应收利息	-	-	-	60,130.93	60,130.93
资产总计	176,759,695.58	-	-	9,617,748,597.07	9,794,508,292.65

负债					
应付证券清算款	-	-	-	95,637,989.39	95,637,989.39
应付管理人报酬	-	-	-	405,740.65	405,740.65
应付托管费	-	-	-	81,148.14	81,148.14
应付交易费用	-	-	-	890,555.28	890,555.28
其他负债	-	-	-	24,890.91	24,890.91
负债总计	-	-	-	97,040,324.37	97,040,324.37
利率敏感度缺口	176,759,69 5.58	-	-	9,520,708,27 2.70	9,697,467,96 8.28

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1.50%(2020年12月31日：0.00%)，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的股票，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资组合中，本基金投资于标的指数成份股及备选成份股股票投资比例不低于基金资产净值的90%，且不低于非现金基金资产的80%；每个交易日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于交易保证金一倍的现金。股指期货及其他金融工具的投资比例依照法律法规或监管机构的规定执行。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

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 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	8,337,340,875.76	98.38	9,617,688,466.14	99.18
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	8,337,340,875.76	98.38	9,617,688,466.14	99.18

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%	408,236,772.79	480,847,133.43
	业绩比较基准下降5%	-408,236,772.79	-480,847,133.43

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8,332,245,776.91元，属于第二层次的余额为127,464,229.35元，属于第三层次的余额为4,714,869.50元(2020年12月31日：第一层次9,617,688,466.14元，无第二或第三层次)。

(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4,714,869.50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2,009,757.27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2,705,112.23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4,714,869.50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	8,337,340,875.76	98.26
	其中：股票	8,337,340,875.76	98.26
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	127,084,000.00	1.50
	其中：债券	127,084,000.00	1.50
	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	12,973,061.52	0.15
8	其他各项资产	7,518,159.55	0.09
9	合计	8,484,916,096.83	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3,683,365.00元，占基金资产净值的比例为0.04%。

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	-	-
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	-	-
J	金融业	8,332,193,168.64	98.32
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	8,332,193,168.64	98.32

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	4,332,949.77	0.05
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	168,328.64	0.00
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	324,117.02	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	216,381.39	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	50,198.91	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	46,409.59	0.00
S	综合	-	-
	合计	5,147,707.12	0.06

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	600036	招商银行	24,445,252	1,190,728,224.92	14.05
2	601166	兴业银行	53,232,680	1,013,550,227.2	11.96

				0	
3	601398	工商银行	128,280,245	593,937,534.35	7.01
4	000001	平安银行	35,435,100	583,970,448.00	6.89
5	002142	宁波银行	14,425,626	552,212,963.28	6.52
6	601328	交通银行	100,703,600	464,243,596.00	5.48
7	601288	农业银行	128,519,957	377,848,673.58	4.46
8	600000	浦发银行	42,966,204	366,501,720.12	4.32
9	600016	民生银行	90,973,825	354,797,917.50	4.19
10	601229	上海银行	36,540,749	260,535,540.37	3.07
11	600919	江苏银行	43,299,196	252,434,312.68	2.98
12	601169	北京银行	54,234,449	240,800,953.56	2.84
13	601988	中国银行	77,085,269	235,110,070.45	2.77
14	601658	邮储银行	39,883,700	203,406,870.00	2.40
15	601818	光大银行	60,621,500	201,263,380.00	2.37
16	601009	南京银行	18,382,500	164,707,200.00	1.94
17	601939	建设银行	24,505,900	143,604,574.00	1.69
18	600926	杭州银行	10,865,571	139,296,620.22	1.64
19	600015	华夏银行	22,551,400	126,287,840.00	1.49
20	601916	浙商银行	30,621,500	107,175,250.00	1.26
21	601838	成都银行	7,995,409	95,944,908.00	1.13
22	601077	渝农商行	22,682,000	87,325,700.00	1.03
23	601128	常熟银行	10,046,101	66,404,727.61	0.78
24	601997	贵阳银行	9,397,100	61,175,121.00	0.72
25	002936	郑州银行	19,150,088	60,514,278.08	0.71
26	601998	中信银行	12,876,550	59,489,661.00	0.70
27	002966	苏州银行	6,217,807	42,094,553.39	0.50
28	002958	青农商行	10,334,500	39,891,170.00	0.47
29	601577	长沙银行	4,509,423	35,218,593.63	0.42
30	600908	无锡银行	5,558,600	31,517,262.00	0.37
31	002807	江阴银行	8,092,300	31,155,355.00	0.37
32	002839	张家港行	5,399,100	31,098,816.00	0.37

33	603323	苏农银行	4,716,200	22,967,894.00	0.27
34	601860	紫金银行	6,824,500	22,862,075.00	0.27
35	600928	西安银行	4,980,711	21,417,057.30	0.25
36	002948	青岛银行	3,009,800	13,935,374.00	0.16
37	601963	重庆银行	1,385,376	12,329,846.40	0.15
38	601665	齐鲁银行	1,841,300	10,274,454.00	0.12
39	601187	厦门银行	1,060,700	7,318,830.00	0.09
40	601528	瑞丰银行	606,700	6,843,576.00	0.08

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	688187	时代电气	33,865	2,595,752.25	0.03
2	688385	复旦微电	8,986	436,539.88	0.01
3	688239	航宇科技	4,926	332,307.96	0.00
4	688262	国芯科技	7,129	299,275.42	0.00
5	688509	正元地信	15,433	95,221.61	0.00
6	301177	迪阿股份	792	91,935.36	0.00
7	688210	统联精密	2,218	87,677.54	0.00
8	688511	天微电子	1,490	81,234.80	0.00
9	301136	招标股份	7,172	75,449.44	0.00
10	688622	禾信仪器	1,204	68,543.72	0.00
11	301087	可孚医疗	848	63,888.32	0.00
12	301050	雷电微力	233	54,694.42	0.00
13	301029	怡合达	462	41,519.94	0.00
14	301035	润丰股份	644	36,244.32	0.00
15	301211	亨迪药业	967	32,539.55	0.00
16	301090	华润材料	2,764	31,012.08	0.00
17	603230	内蒙新华	1,141	29,517.67	0.00
18	301127	C天源	1,685	28,847.20	0.00

19	301039	中集车辆	2,064	25,820.64	0.00
20	301221	光庭信息	280	24,841.60	0.00
21	301166	C优宁维	253	23,908.50	0.00
22	301069	凯盛新材	539	23,829.19	0.00
23	301096	百诚医药	272	21,360.16	0.00
24	301093	华兰股份	409	20,388.65	0.00
25	301149	隆华新材	1,214	20,346.64	0.00
26	300994	久祺股份	420	19,089.00	0.00
27	301100	风光股份	599	18,652.86	0.00
28	001296	长江材料	310	18,376.80	0.00
29	301088	戎美股份	704	17,367.68	0.00
30	301168	通灵股份	329	17,150.77	0.00
31	301101	明月镜片	371	16,086.56	0.00
32	301190	善水科技	575	15,789.50	0.00
33	301089	拓新药业	220	14,944.60	0.00
34	301046	能辉科技	290	14,207.10	0.00
35	301111	粤万年青	379	13,901.72	0.00
36	301188	力诺特玻	647	13,250.56	0.00
37	301017	漱玉平民	555	13,209.00	0.00
38	301199	迈赫股份	402	12,864.00	0.00
39	301020	密封科技	421	12,815.24	0.00
40	301138	华研精机	285	12,785.10	0.00
41	301026	浩通科技	203	12,734.19	0.00
42	301126	达嘉维康	662	12,730.26	0.00
43	301021	英诺激光	290	12,014.70	0.00
44	301092	争光股份	323	11,472.96	0.00
45	301048	金鹰重工	843	10,925.28	0.00
46	301028	东亚机械	733	9,895.50	0.00
47	301045	天禄科技	335	9,503.95	0.00
48	300774	倍杰特	444	9,359.52	0.00
49	301040	中环海陆	241	9,280.91	0.00

50	301078	孩子王	756	9,177.84	0.00
51	301182	凯旺科技	294	8,990.52	0.00
52	301062	上海艾录	523	8,896.23	0.00
53	301193	家联科技	297	8,654.58	0.00
54	301052	果麦文化	252	8,477.28	0.00
55	301025	读客文化	403	8,414.64	0.00
56	300814	中富电路	328	7,832.64	0.00
57	301133	金钟股份	286	7,707.70	0.00
58	301030	仕净科技	242	7,627.84	0.00
59	301033	迈普医学	108	6,476.76	0.00
60	301049	超越科技	196	6,452.32	0.00
61	301032	新柴股份	513	6,417.63	0.00
62	301056	森赫股份	572	6,343.48	0.00
63	301036	双乐股份	205	6,135.65	0.00
64	301041	金百泽	215	6,065.15	0.00
65	301072	中捷精工	181	6,047.21	0.00
66	300854	中兰环保	203	5,539.87	0.00
67	301063	海锅股份	153	5,524.83	0.00
68	001234	泰慕士	333	5,504.49	0.00
69	301038	深水规院	266	5,381.18	0.00
70	301027	华蓝集团	286	4,761.90	0.00
71	603176	N汇通	1,924	4,713.80	0.00
72	301037	保立佳	193	4,682.18	0.00
73	301073	君亭酒店	144	4,608.00	0.00
74	301053	远信工业	155	4,460.90	0.00
75	301057	汇隆新材	218	4,146.36	0.00
76	301068	大地海洋	144	4,086.72	0.00
77	301079	邵阳液压	140	3,474.80	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	000001	平安银行	655,089,135.12	6.76
2	002142	宁波银行	480,182,854.61	4.95
3	600036	招商银行	148,025,816.94	1.53
4	601658	邮储银行	145,613,572.88	1.50
5	601166	兴业银行	94,010,625.13	0.97
6	601288	农业银行	92,855,898.00	0.96
7	600016	民生银行	77,718,121.60	0.80
8	601916	浙商银行	74,267,894.00	0.77
9	600919	江苏银行	73,540,968.48	0.76
10	601077	渝农商行	72,923,596.40	0.75
11	002936	郑州银行	71,586,738.53	0.74
12	002966	苏州银行	67,319,518.93	0.69
13	601398	工商银行	51,277,464.30	0.53
14	002839	张家港行	51,239,792.98	0.53
15	600000	浦发银行	40,825,869.93	0.42
16	002958	青农商行	39,782,424.47	0.41
17	601328	交通银行	39,260,862.00	0.40
18	601229	上海银行	38,768,083.08	0.40
19	002807	江阴银行	36,196,048.82	0.37
20	601169	北京银行	26,176,687.51	0.27

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	000001	平安银行	800,587,686.55	8.26
2	002142	宁波银行	448,728,231.65	4.63

3	600036	招商银行	374,817,923.51	3.87
4	601166	兴业银行	113,893,020.75	1.17
5	002966	苏州银行	73,852,221.44	0.76
6	601398	工商银行	61,589,645.40	0.64
7	601009	南京银行	56,575,602.49	0.58
8	002839	张家港行	51,478,281.07	0.53
9	002958	青农商行	47,039,093.30	0.49
10	601328	交通银行	45,874,324.59	0.47
11	600000	浦发银行	43,790,961.50	0.45
12	002807	江阴银行	40,814,586.72	0.42
13	002936	郑州银行	37,826,043.81	0.39
14	600919	江苏银行	36,358,801.64	0.37
15	601229	上海银行	28,908,278.51	0.30
16	600016	民生银行	27,585,839.00	0.28
17	601288	农业银行	26,954,754.99	0.28
18	601169	北京银行	26,907,159.00	0.28
19	601577	长沙银行	24,461,422.86	0.25
20	601988	中国银行	24,379,607.00	0.25

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	2,678,772,012.89
卖出股票收入（成交）总额	2,634,362,588.52

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

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-

2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	127,084,000.00	1.50
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	127,084,000.00	1.50

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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	113052	兴业转债	1,270,840	127,084,000.00	1.50

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；【宁波银行股份有限公司】分别于2021年06月10日、2021年07月30日、2021年12月29日收到中国银行保险监督管理委员会宁波监管局出具公开处罚的通报，于2021年07月14日收到中国人民银行宁波市中心支行出具公开处罚、公开批评的通报；【平安银行股份有限公司】于2021年05月28日收到中国银行保险监督管理委员会云南监管局出具公开处罚的通报；【上海浦东发展银行股份有限公司】于2021年04月23日收到中国银行保险监督管理委员会上海监管局出具公开处罚、责令改正的通报，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；【上海银行股份有限公司】分别于2021年04月25日、2021年07月02日收到中国银行保险监督管理委员会上海监管局出具公开处罚、责令改正的通报，于2021年11月19日收到中国银行保险监督管理委员会上海监管局出具公开处罚的通报；【兴业银行股份有限公司】于2021年08月13日收到中国人民银行出具公开处罚的通报；【招商银行股份有限公司】于2021年05月17日收到中国银行保险监督管理委员会出具罚款处罚的通报；【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；【中国农业银行股份有限公司】分别于2021年01月19日、2021年12月08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	999,755.74
2	应收证券清算款	6,502,558.56
3	应收股利	-
4	应收利息	15,845.25
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	7,518,159.55

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	688187	时代电气	2,595,752.25	0.03	科创板打新限售
2	688385	复旦微电	436,539.88	0.01	科创板打新限售
3	688239	航宇科技	332,307.96	0.00	科创板打新限售
4	688262	国芯科技	299,275.42	0.00	新股未上市
5	688509	正元地信	95,221.61	0.00	科创板打新限售

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

持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构					
		机构投资者		个人投资者		联接基金	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例

							例
8,897	952,066.20	199,283,917.00	2.35%	263,540,620.00	3.11%	8,007,708,400.00	94.54%

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额 (份)	占上市总 份额比例
1	招商证券股份有限公司一天弘中证银行交易型开放式指数证券投资基金联接基金	8,007,708,400.00	94.54%
2	长江养老保险股份有限公司—中国太平洋人寿权益基金型投资产品(财富管家)委托专户	40,000,000.00	0.47%
3	浦银安盛基金—上海银行—浦银安盛盛卓11号FOF集合资产管理计划	22,519,600.00	0.27%
4	招商证券股份有限公司	17,457,900.00	0.21%
5	中信证券股份有限公司	15,686,432.00	0.19%
6	招银理财有限责任公司—招银理财招睿卓远稳进两年定开6号增强型固定收益类理财计	13,392,900.00	0.16%
7	任婧	12,662,500.00	0.15%
8	招银理财有限责任公司—招银理财招睿卓远稳进两年定开7号增强型固定收益类理财计	9,948,200.00	0.12%
9	招银理财有限责任公司—招银理财招睿卓远系列一年半定开10号增强型固定收益类理财	9,660,400.00	0.11%
10	广发证券股份有限公司	9,048,500.00	0.11%

注：持有人为场内持有人。

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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	1,000.00	0.00%
------------------	----------	-------

9.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	0
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2020年12月11日)基金份额总额	608,092,937.00
本报告期期初基金份额总额	9,598,492,937.00
本报告期基金总申购份额	6,710,180,000.00
减：本报告期基金总赎回份额	7,838,140,000.00
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	8,470,532,937.00

§ 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。

2021年5月4日，本基金托管人招商证券股份有限公司聘牛中强、张志斌任托管部副总经理。

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，无涉及公募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120,000.00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1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	1	12,012,000.78	0.23%	5,180.92	0.23%	-
渤海证券	1	-	-	-	-	-
长江	1	209,468,728.75	3.96%	90,346.35	4.06%	-

证券						
东方财富证券	2	79,899,984.01	1.51%	34,459.56	1.55%	-
方正证券	3	943,117,810.45	17.84%	399,026.47	17.93%	-
光大证券	3	2,434,943,901.19	46.07%	1,050,161.39	47.19%	-
广发证券	1	65,332,058.04	1.24%	28,121.14	1.26%	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	85,691,470.77	1.62%	36,959.46	1.66%	-
开源证券	2	226,795,047.32	4.29%	97,819.14	4.40%	-
天风证券	2	-	-	-	-	-
兴业证券	1	83,989,090.70	1.59%	36,224.59	1.63%	-
银河证券	1	740,063,939.56	14.00%	319,187.28	14.34%	-
招商证券	5	199,922,148.32	3.78%	39,928.18	1.79%	-
中金财富	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	204,274,030.35	3.86%	88,103.34	3.96%	-

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：渤海证券深圳交易单元、方正证券深圳交易单元、光大证券深圳交易单元、广发证券上海交易单元、开源证券上海交易单元、天风证券深圳交易单元、银河证券上海交易单元、中金财富上海交易单元。

4、本基金报告期内停止租用交易单元：天风证券深圳交易单元。

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	-	-	-	-	-	-	-	-
渤海证券	-	-	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	101,748,148.50	34.08%	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	9,615,862.41	3.22%	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	50,952,212.00	17.07%	-	-	-	-	-	-
招商证券	9,167,100.00	3.07%	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	127,084,000.00	42.56%	-	-	-	-	-	-

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	中国证券报、中国证监会指定媒介	2021-01-01
2	天弘中证银行交易型开放式指数证券投资基金产品资料概要(更新)	中国证券报、中国证监会指定媒介	2021-01-07
3	天弘基金管理有限公司公告	中国证券报、中国证监会指定媒介	2021-01-25
4	天弘基金管理有限公司公告	中国证券报、中国证监会指	2021-01-27

		定媒介	
5	天弘基金管理有限公司公告	中国证券报、中国证监会指定媒介	2021-01-30
6	天弘基金管理有限公司公告	中国证券报、中国证监会指定媒介	2021-02-03
7	关于注意防范冒用天弘创新相关名义进行诈骗活动的风险提示	中国证券报、中国证监会指定媒介	2021-02-24
8	天弘基金管理有限公司关于防范不法分子冒用公司名义进行诈骗活动的风险提示	中国证券报、中国证监会指定媒介	2021-03-04
9	天弘基金管理有限公司关于天弘中证银行交易型开放式指数证券投资基金变更证券简称及申赎简称的公告	中国证券报、中国证监会指定媒介	2021-03-12
10	天弘中证银行交易型开放式指数证券投资基金产品资料概要（更新）	中国证券报、中国证监会指定媒介	2021-03-16
11	天弘基金管理有限公司公告	中国证券报、中国证监会指定媒介	2021-03-24
12	天弘基金管理有限公司关于天弘中证银行交易型开放式指数证券投资基金调整最小申购赎回单位的公告	中国证券报、中国证监会指定媒介	2021-03-26
13	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金修订基金合同等法律文件的公告	中国证券报、中国证监会指定媒介	2021-03-31
14	天弘中证银行交易型开放式指数证券投资基金基金合同	中国证券报、中国证监会指定媒介	2021-03-31
15	天弘中证银行交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）	中国证券报、中国证监会指定媒介	2021-03-31
16	天弘中证银行交易型开放式	中国证券报、中国证监会指	2021-03-31

	指数证券投资基金托管协议	定媒介	
17	天弘中证银行交易型开放式指数证券投资基金产品资料概要（更新）	中国证券报、中国证监会指定媒介	2021-04-06
18	天弘创新资产管理有限公司关于防范不法分子冒用公司名义进行诈骗活动的风险提示	中国证券报、中国证监会指定媒介	2021-04-07
19	天弘基金管理有限公司公告	中国证券报、中国证监会指定媒介	2021-04-19
20	天弘中证银行交易型开放式指数证券投资基金2021年第一季度报告	中国证券报、中国证监会指定媒介	2021-04-22
21	天弘基金管理有限公司公告	中国证券报、中国证监会指定媒介	2021-05-14
22	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金新增中国中金财富证券有限公司为申购赎回代办证券公司的公告	中国证券报、中国证监会指定媒介	2021-05-20
23	天弘基金管理有限公司关于董事长离任及总经理代行董事长职务的公告	中国证券报、中国证监会指定媒介	2021-06-02
24	天弘基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、中国证监会指定媒介	2021-06-02
25	天弘基金管理有限公司公告	中国证券报、中国证监会指定媒介	2021-06-12
26	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金新增国信证券股份有限公司为申购赎回代办证券公司的公告	中国证券报、中国证监会指定媒介	2021-06-16
27	天弘中证银行交易型开放式指数证券投资基金2021年第二季度报告	中国证券报、中国证监会指定媒介	2021-07-21

28	天弘基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证券报、中国证监会指定媒介	2021-08-04
29	天弘中证银行交易型开放式指数证券投资基金产品资料概要（更新）	中国证券报、中国证监会指定媒介	2021-08-11
30	天弘基金管理有限公司公告	中国证券报、中国证监会指定媒介	2021-08-11
31	天弘基金管理有限公司公告	中国证券报、中国证监会指定媒介	2021-08-13
32	天弘基金管理有限公司住所变更公告	中国证券报、中国证监会指定媒介	2021-08-18
33	天弘中证银行交易型开放式指数证券投资基金2021年中期报告	中国证券报、中国证监会指定媒介	2021-08-31
34	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金新增东方财富股份有限公司为申购赎回代办证券公司的公告	中国证券报、中国证监会指定媒介	2021-09-29
35	天弘基金管理有限公司公告	中国证券报、中国证监会指定媒介	2021-10-08
36	天弘中证银行交易型开放式指数证券投资基金招募说明书（更新）	中国证券报、中国证监会指定媒介	2021-10-22
37	天弘基金管理有限公司公告	中国证券报、中国证监会指定媒介	2021-10-23
38	天弘中证银行交易型开放式指数证券投资基金2021年第三季度报告	中国证券报、中国证监会指定媒介	2021-10-27
39	天弘基金管理有限公司关于董事变更的公告	中国证券报、中国证监会指定媒介	2021-11-17
40	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	中国证券报、中国证监会指定媒介	2021-11-25

	费率优惠的公告		
41	天弘基金管理有限公司公告	中国证券报、中国证监会指定媒介	2021-12-04
42	天弘基金管理有限公司公告	中国证券报、中国证监会指定媒介	2021-12-22

§ 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

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
联接基金	1	20210101-20211231	8,912,584,100.00	21,137,717,300.00	22,042,593,000.00	8,007,708,400.00	94.54%

产品特有风险

基金管理人秉承谨慎勤勉、独立决策、规范运作、充分披露原则，公平对待投资者，保障投资者合法权益。当单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%时，由此可能导致的特有风险主要包括：

(1) 超出基金管理人允许的单一投资者持有基金份额比例的申购申请不被确认的风险；

(2) 极端市场环境下投资者集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对赎回申请的风险；

(3) 持有基金份额占比较高的投资者大额赎回可能引发基金净值大幅波动的风险；

(4) 持有基金份额占比较高的投资者在召开基金份额持有人大会并对重大事项进行投票表决时，可能拥有较大话语权；

(5) 极端情况下，持有基金份额占比较高的投资者大量赎回后，可能导致在其赎回后本基金资产规模持续低于正常运作水平，面临转换基金运作方式、与其他基金

合并或者终止基金合同等风险。

注：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。

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银行交易型开放式指数证券投资基金募集的文件
- 2、天弘中证银行交易型开放式指数证券投资基金基金合同
- 3、天弘中证银行交易型开放式指数证券投资基金托管协议
- 4、天弘中证银行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

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