

天弘中证 500 指数增强型证券投资基金

2021 年中期报告

2021 年 06 月 30 日

基金管理人:天弘基金管理有限公司

基金托管人:招商证券股份有限公司

送出日期:2021 年 08 月 31 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2021年01月01日起至2021年06月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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	15
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	16
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	16
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	16
§5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	17
§6 中期财务会计报告(未经审计)	17
6.1 资产负债表	17
6.2 利润表	19
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	20
6.4 报表附注	22
§7 投资组合报告	57
7.1 期末基金资产组合情况	57
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	58
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细	59
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	69
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	72
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	73
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	73
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	73
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	73
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	73
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	73
7.12 投资组合报告附注	74
§8 基金份额持有人信息	75
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	75
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	75

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	76
§9 开放式基金份额变动	76
§10 重大事件揭示	76
10.1 基金份额持有人大会决议	76
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	76
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	77
10.4 基金投资策略的改变	77
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	77
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	77
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	77
10.8 其他重大事件	79
§11 影响投资者决策的其他重要信息	83
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况	83
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	83
§12 备查文件目录	84
12.1 备查文件目录	84
12.2 存放地点	84
12.3 查阅方式	84

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	天弘中证500指数增强型证券投资基金	
基金简称	天弘中证500指数增强	
基金主代码	001556	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2019年08月12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	1,336,206,134.41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500指数增强A	天弘中证500指数增强C
下属分级基金的交易代码	001556	001557
报告期末下属分级基金的份额总额	850,189,003.37份	486,017,131.04份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金为股票型指数增强基金，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。
投资策略	本基金采用指数增强型投资策略，以中证500指数作为基金投资组合的标的指数，结合深入的宏观面、基本面研究及数量化投资技术，在指数化投资基础上优化调整投资组合，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，年跟踪误差不超过7.75%，以实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。 主要投资策略有：资产配置策略、股票投资策略、存托凭证投资策略、债券投资策略、其他类型资产投资策略。
业绩比较基准	中证500指数收益率×95%+银行活期存款(税后)利率×5%

风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。
--------	--

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	天弘基金管理有限公司	招商证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	童建林
	联系电话	022-83310208
	电子邮箱	service@thfund.com.cn
客户服务电话	95046	95565
传真	022-83865569	0755-82960794
注册地址	天津自贸区（中心商务区）响螺湾旷世国际大厦A座1704-241号	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	胡晓明	霍达

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

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.thfund.com.cn
基金中期报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	天弘基金管理有限公司	天津市河西区马场道59号天津国际

		经济贸易中心A座16层
--	--	-------------

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期 (2021年01月01日-2021年06月30日)	
	天弘中证500指数增强A	天弘中证500指数增强C
本期已实现收益	92,573,369.51	45,128,171.71
本期利润	140,746,453.68	69,591,096.54
加权平均基金份额本期利润	0.1996	0.1946
本期加权平均净值利润率	15.52%	15.40%
本期基金份额净值增长率	14.63%	14.46%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末 (2021年06月30日)	
	天弘中证500指数增强A	天弘中证500指数增强C
期末可供分配利润	223,174,919.71	116,412,410.93
期末可供分配基金份额利润	0.2625	0.2395
期末基金资产净值	1,197,177,276.51	671,439,980.39
期末基金份额净值	1.4081	1.3815
3.1.3 累计期末指标	报告期末 (2021年06月30日)	
	天弘中证500指数增强A	天弘中证500指数增强C
基金份额累计净值增长率	95.95%	94.85%

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500指数增强A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	5.09%	0.77%	1.12%	0.69%	3.97%	0.08%
过去三个月	14.57%	0.75%	8.41%	0.65%	6.16%	0.10%
过去六个月	14.63%	1.06%	6.61%	0.94%	8.02%	0.12%
过去一年	41.21%	1.27%	15.35%	1.19%	25.86%	0.08%
自基金转 型日起至 今	95.95%	1.32%	45.47%	1.30%	50.48%	0.02%

天弘中证500指数增强C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	5.07%	0.77%	1.12%	0.69%	3.95%	0.08%
过去三个月	14.50%	0.75%	8.41%	0.65%	6.09%	0.10%
过去六个月	14.46%	1.06%	6.61%	0.94%	7.85%	0.12%
过去一年	40.80%	1.27%	15.35%	1.19%	25.45%	0.08%
自基金转	94.85%	1.32%	45.47%	1.30%	49.38%	0.02%

型日起至 今						
-----------	--	--	--	--	--	--

3.2.2 自基金转型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500指数增强C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



注：1、本基金合同于2019年08月12日生效，本基金于2019年08月12日由天弘量化驱动股票型证券投资基金转型而成，名称相应变更为“天弘中证500指数增强型证券投资基金”。

2、本报告期内，本基金的各项投资比例达到基金合同约定的各项比例要求。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

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

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

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
杨超	指数与数量投资部副总经理、基金经理	2019年08月	—	11年	男，金融数学与计算硕士。历任建信基金管理有限责任公司基金经理助理、泰达宏利基金管理有限公司基金经理。2019年1月加盟本公司。
林心龙	基金经理助理	2021年01月	—	6年	男，光学工程专业硕士。历任南方基金管理股份有限公司研究员、新华基金管理股份有限公司基金经理助理，2019年8月加盟本公司，历任高级研究员。

注：1、上述任职日期/离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2、本基金经理助理协助基金经理进行投资、研究、头寸管理等日常工作，不具有独立决策职能。

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 公平交易制度的执行情况

公平交易的执行情况包括：建立统一的研究平台和公共信息平台，保证各组合得到公平的投资资讯；公平对待不同投资组合，禁止各投资组合之间进行以利益输送为目的的投资交易活动；在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，严格执行授权审批程序；实行集中交易制度和公平交易分配制度；建立不同投资组合投资信息的管理及保密制度，保证不同投资组合经理之间的重大非公开投资信息的相互隔离；加强对投资交易行为的监察稽核力度，建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估体系等。

报告期内，公司公平交易程序运作良好，未出现异常情况；场外、网下业务公平交易制度执行情况良好，未出现异常情况。

公司对旗下各投资组合的交易行为进行监控和分析，对各投资组合不同时间窗口（1日、3日、5日）内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验，未发现违反公平交易原则的异常交易。

本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况，公司旗下各基金不存在因非公平交易等导致的利益输送行为，公平交易制度的整体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

4.4 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

上半年市场整体经历了较大的震荡和分化，从宽基指数来看：沪深300上涨0.24%，中证500上涨6.93%，中证1000上涨6.58%，创业板指上涨17.22%，市场风格整体向中盘和成长倾斜。如果分行业和板块来看，这一趋势更加明显：上半年电力设备及新能源、电子、医药生物等行业涨幅居前，同时钢铁、化工、采掘、有色等传统周期行业在经济复苏及大宗商品涨价的背景下亦有不俗表现，相比之下，家电、非银金融、地产、农林牧渔等行业则出现了一定程度的下跌。总体而言，未来成长确定性较强或中短期景气度较高的行业在上半年实现了更大的涨幅。

报告期内，本基金的业绩比较基准指数（中证500指数收益率*95%+银行活期存款利率(税后)*5%）上涨6.61%，基金以基准指数为投资基础，并通过选股模型围绕基准进行持续优化，力争在基准的行业分布内精选基本面更为优质的标的，并在结构化风险模型和优化器的辅助下构建收益风险比更具优势的投资组合。受益于上述策略的有效性，报告期内基金在取得基准指数系统性收益的基础上，亦获得了一定程度的超额回报，实现了Beta+Alpha的双重收益。

投资策略方面，本基金作为股票型指数增强基金，在对基准指数进行有效跟踪的基础上，通过对市场结构及公司基本面的持续跟踪分析，利用量化选股模型及优化策略积极抽样组合，力争在控制跟踪误差的同时为投资者提供高于业绩比较基准的投资收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2021年06月30日，天弘中证500指数增强A基金份额净值为1.4081元，天弘中证500指数增强C基金份额净值为1.3815元。报告期内份额净值增长率天弘中证500指数增强A为14.63%，同期业绩比较基准增长率为6.61%；天弘中证500指数增强C为14.46%，同期业绩比较基准增长率为6.61%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望下半年，经济有望整体保持韧性，经过疫情后的快速恢复期，后续边际增速可能逐步向常态回归，并在较长时间内稳定在一个相对较高的水平，但也应注意到相比于出口强势叠加供给约束形成的中上游高景气而言，内需的复苏可能需要经历更加漫长的过程。流动性方面，伴随7月降准，市场对于货币环境趋紧的预期有所缓和，下半年流动性有望整体维持合理充裕，利率中枢存在下行的可能，但金融政策相对趋严可能会成为中长期趋势，权益市场依然不能排除阶段性面临信用边际收缩和流动性边际趋紧后风险偏好降低所带来的行情扰动，上半年市场的结构性行情得到充分演绎，未来成长确定性较强或中短期景气度较高的行业在过去六个月积累了较大涨幅，并反映了相对乐观的预期，短期或面临更大的波动，但从中长期的视角看，在碳中和路线下的能源生产和能源消费方式变革、在自主可控战略下的产业升级和国产替代进程、以及在健康中国和应对人口老龄化背景下的医疗消费升级和医药卫生体制改革，仍将是未来相当长一段时期内值得持续关注的投资领域。基于本基金的主要投向及业绩比较基准指数的行业分布，我们将密切关注中证500指数中医药、电子、化工、设备制造、计算机、消费等主要行业的经营状态及盈利变化，通过对基本面信息的及时跟踪和前瞻性判断，不断优化选股体系，积极把握行业内部的alpha机会。

本基金作为股票型指数增强基金，将在对标的指数进行有效跟踪的基础上，结合增强型的主动投资，在控制跟踪误差的同时力争为投资者提供高于业绩比较基准的投资收益。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构，负责制定公司所管理基金的基本估值政策，对公司旗下基金已采用的估值政策、方法、流程的执行情况进行审核监督，对因经营环境或市场变化等导致需调整已实施的估值政策、方法和流程的，负责审查批准基金估值政策、方法和流程的变更和执行。确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益。估值委员会由公司分管固定收益投资的高级管理人员、督察长、分管估值业务的IT运维总监、投资研究部负责人组成。

公司基金估值委员会下设基金估值工作小组，由具备丰富专业知识、两年以上基金行业相关领域工作经历、熟悉基金投资品种定价及基金估值法律法规、具备较强专业胜任能力的基金经理、基金会计、风险管理人员及内控合规人员组成。

基金经理作为估值工作小组的成员之一，在基金估值定价过程中，充分表达对相关问题及定价方案的意见或建议，参与估值方案提议的制定。但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。

参与估值流程的各方还包括本基金托管人和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

报告期内，本基金管理人未与任何第三方签订与估值相关的定价服务协议。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内本基金管理人无应说明预警信息。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期，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 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人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 中期财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：天弘中证500指数增强型证券投资基金

报告截止日：2021年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	105,777,689.70	75,767,734.88
结算备付金		6,944,270.51	4,627,681.37
存出保证金		564,484.39	645,460.80
交易性金融资产	6.4.7.2	1,767,267,670.72	1,037,430,592.53
其中：股票投资		1,766,807,670.72	1,037,415,592.53
基金投资		-	-
债券投资		460,000.00	15,000.00
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	6.4.7.5	48,401.73	32,399.26
应收股利		-	-

应收申购款		26,229,359.12	4,208,585.33
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		1,906,831,876.17	1,122,712,454.17
负债和所有者权益	附注号	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		18,120,239.25	8,901,324.70
应付赎回款		17,743,913.73	15,076,082.95
应付管理人报酬		842,014.05	515,470.17
应付托管费		140,335.69	85,911.71
应付销售服务费		146,223.79	69,100.10
应付交易费用	6.4.7.7	1,055,089.72	600,800.24
应交税费		0.67	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	166,802.37	238,020.17
负债合计		38,214,619.27	25,486,710.04
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	1,336,206,134.41	897,900,321.58
未分配利润	6.4.7.10	532,411,122.49	199,325,422.55
所有者权益合计		1,868,617,256.90	1,097,225,744.13
负债和所有者权益总计		1,906,831,876.17	1,122,712,454.17

注：报告截止日2021年06月30日，天弘中证500指数增强型证券投资基金A类基金份额净值1.4081元，天弘中证500指数增强型证券投资基金C类基金份额净值1.3815元；基

金份额总额1,336,206,134.41份，其中天弘中证500指数增强型证券投资基金A类基金份额850,189,003.37份，天弘中证500指数增强型证券投资基金C类基金份额486,017,131.04份。

6.2 利润表

会计主体：天弘中证500指数增强型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2021年01月01日至 2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至202 0年06月30日
一、收入		222,018,433.74	40,746,775.01
1. 利息收入		677,434.79	111,564.31
其中：存款利息收入	6.4.7.11	677,378.79	111,564.31
债券利息收入		56.00	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		146,735,002.95	31,664,837.27
其中：股票投资收益	6.4.7.12	137,439,311.24	30,337,012.73
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	132,654.74	-
资产支持证券投资 收益	6.4.7.13. 3	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	9,163,036.97	1,327,824.54
3. 公允价值变动收益（损	6.4.7.17	72,636,009.00	8,388,851.08

失以“-”号填列)			
4. 汇兑收益 (损失以“-”号填列)		-	-
5. 其他收入 (损失以“-”号填列)	6. 4. 7. 18	1, 969, 987. 00	581, 522. 35
减：二、费用		11, 680, 883. 52	2, 052, 131. 92
1. 管理人报酬		4, 025, 851. 72	636, 817. 01
2. 托管费		670, 975. 33	106, 136. 13
3. 销售服务费		667, 573. 71	138, 144. 25
4. 交易费用	6. 4. 7. 19	6, 110, 988. 93	992, 307. 18
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		0. 19	-
7. 其他费用	6. 4. 7. 20	205, 493. 64	178, 727. 35
三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)		210, 337, 550. 22	38, 694, 643. 09
减：所得税费用		-	-
四、净利润 (净亏损以“-”号填列)		210, 337, 550. 22	38, 694, 643. 09

6.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体：天弘中证500指数增强型证券投资基金

本报告期：2021年01月01日至2021年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	897, 900, 321. 58	199, 325, 422. 55	1, 097, 225, 744. 13
二、本期经营活动产生的基金净值变动	-	210, 337, 550. 22	210, 337, 550. 22

数(本期利润)			
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)	438,305,812.83	122,748,149.72	561,053,962.55
其中:1.基金申购款	1,220,940,639.21	340,778,195.45	1,561,718,834.66
2.基金赎回款	-782,634,826.38	-218,030,045.73	-1,000,664,872.11
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)	1,336,206,134.41	532,411,122.49	1,868,617,256.90
项 目	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	190,118,789.19	-32,380,047.37	157,738,741.82
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	38,694,643.09	38,694,643.09
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)	18,712,668.14	-8,070,453.62	10,642,214.52
其中:1.基金申购款	298,470,339.46	-38,190,748.55	260,279,590.91
2.基金赎回款	-279,757,671.32	30,120,294.93	-249,637,376.39
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)	208,831,457.33	-1,755,857.90	207,075,599.43

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

郭树强

薄贺龙

薄贺龙

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

天弘中证500指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)系由原天弘量化驱动股票型证券投资基金(以下简称“原基金”)转型而来,天弘量化驱动股票型证券投资基金系由原天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金转型而来。本基金合同生效日为2019年8月12日,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。

根据原基金基金份额持有人大会以通讯方式通过的《关于天弘量化驱动股票型证券投资基金转型有关事项的议案》,基金管理人天弘基金管理有限公司于2019年8月12日发布了《天弘基金管理有限公司关于天弘量化驱动股票型证券投资基金基金份额持有人大会决议生效的公告》。根据《天弘量化驱动股票型证券投资基金转型方案说明书》以及相关法律法规的规定,经与基金托管人招商证券股份有限公司协商一致,基金管理人已将《天弘量化驱动股票型证券投资基金基金合同》、《天弘量化驱动股票型证券投资基金托管协议》修订为《天弘中证500指数增强型证券投资基金基金合同》、《天弘中证500指数增强型证券投资基金托管协议》,并据此更新了《天弘中证500指数增强型证券投资基金招募说明书》,上述文件已经中国证监会变更注册。《天弘中证500指数增强型证券投资基金基金合同》和《天弘中证500指数增强型证券投资基金托管协议》自2019年8月12日起生效,原《天弘量化驱动股票型证券投资基金基金合同》、《天弘量化驱动股票型证券投资基金托管协议》自同一起失效。

根据《天弘中证500指数增强型证券投资基金基金合同》和《天弘中证500指数增强型证券投资基金招募说明书》的有关规定,本基金根据申购费用、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人申购、赎回基金时收取申购费用、赎回费用,并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为天弘中证500指数增强型证券投资基金A类(以下简称“A类基金”);在投资人申购基金时不收取申购费用、

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基金份额，称为天弘中证500指数增强型证券投资基金C类(以下简称“C类基金”)。本基金A类和C类基金份额分别设置代码，两种收费模式并存，由于基金费用的不同，本基金A类基金份额及C类基金份额分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。投资者可自行选择申购某一类别的基金份额，但各类别基金份额之间不能相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘中证500指数增强型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，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、存托凭证、债券（包括国债、金融债、地方政府债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券、央行票据、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、银行存款、债券回购、股指期货、资产支持证券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相关规定）。本基金可以根据有关法律法规的规定进行融资及转融通证券出借业务交易。如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。基金的投资组合比例为：本基金投资于股票的资产不低于基金资产的90%，投资于标的指数成份股、备选成份股的资产占非现金基金资产的比例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，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准：中证500指数收益率 $\times$ 95%+银行活期存款税后利率 $\times$ 5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《天弘中证500指数增强型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

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

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

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

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

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

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

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

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

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

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
活期存款	105,777,689.70
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	105,777,689.70

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2021年06月30日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		1,663,128,520.47	1,766,807,670.72	103,679,150.25
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—
债券	交易所市场	460,000.00	460,000.00	—
	银行间市场	—	—	—
	合计	460,000.00	460,000.00	—
资产支持证券		—	—	—

基金	-	-	-
其他	-	-	-
合计	1,663,588,520.47	1,767,267,670.72	103,679,150.25

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应收活期存款利息	45,003.07
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	3,124.50
应收债券利息	20.16
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	254.00
合计	48,401.73

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
交易所市场应付交易费用	1,055,089.72
银行间市场应付交易费用	-
合计	1,055,089.72

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	11,308.73
应付证券出借违约金	-
预提费用	94,219.55
其他应付	61,274.09
合计	166,802.37

6.4.7.9 实收基金

6.4.7.9.1 天弘中证500指数增强A

金额单位：人民币元

项目 (天弘中证500指数增强A)	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	628,308,974.48	628,308,974.48
本期申购	654,777,194.99	654,777,194.99
本期赎回(以“-”号填列)	-432,897,166.10	-432,897,166.10
本期末	850,189,003.37	850,189,003.37

6.4.7.9.2 天弘中证500指数增强C

金额单位：人民币元

项目 (天弘中证500指数增强C)	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	269,591,347.10	269,591,347.10
本期申购	566,163,444.22	566,163,444.22
本期赎回（以“-”号填列）	-349,737,660.28	-349,737,660.28
本期末	486,017,131.04	486,017,131.04

注：申购含转换转入份额；赎回含转换转出份额。

6.4.7.10 未分配利润

6.4.7.10.1 天弘中证500指数增强A

单位：人民币元

项目 (天弘中证500指数增强A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	85,114,490.74	58,409,101.35	143,523,592.09
本期利润	92,573,369.51	48,173,084.17	140,746,453.68
本期基金份额交易产生的变动数	45,487,059.46	17,231,167.91	62,718,227.37
其中：基金申购款	128,048,984.48	61,634,010.17	189,682,994.65
基金赎回款	-82,561,925.02	-44,402,842.26	-126,964,767.28
本期已分配利润	-	-	-
本期末	223,174,919.71	123,813,353.43	346,988,273.14

6.4.7.10.2 天弘中证500指数增强C

单位：人民币元

项目 (天弘中证500指数增强C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	31,451,577.97	24,350,252.49	55,801,830.46
本期利润	45,128,171.71	24,462,924.83	69,591,096.54

本期基金份额交易产生的变动数	39,832,661.25	20,197,261.10	60,029,922.35
其中：基金申购款	100,091,757.37	51,003,443.43	151,095,200.80
基金赎回款	-60,259,096.12	-30,806,182.33	-91,065,278.45
本期已分配利润	-	-	-
本期末	116,412,410.93	69,010,438.42	185,422,849.35

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
活期存款利息收入	629,012.44
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	43,459.20
其他	4,907.15
合计	677,378.79

6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
卖出股票成交总额	3,607,110,498.91
减：卖出股票成本总额	3,469,671,187.67
买卖股票差价收入	137,439,311.24

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转	132,654.74

股及债券到期兑付) 差价收入	
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	132,654.74

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	551,093.56
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	418,400.00
减：应收利息总额	38.82
买卖债券差价收入	132,654.74

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期未取得资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期未取得贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

6.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期未取得买卖权证差价收入。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

本基金本报告期未取得其他衍生工具投资收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2021年01月01日至2021年06月30日
股票投资产生的股利收益	9,163,036.97
其中：证券出借权益补偿收入	—
基金投资产生的股利收益	—
合计	9,163,036.97

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
1. 交易性金融资产	72,636,009.00
——股票投资	72,636,009.00
——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	72,636,009.00

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
基金赎回费收入	1,848,812.53
基金转换费收入	121,174.47
合计	1,969,987.00

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
交易所市场交易费用	6,110,988.93
银行间市场交易费用	—
合计	6,110,988.93

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日
审计费用	34,712.18
信息披露费	59,507.37
证券出借违约金	—
指数使用费	111,274.09
合计	205,493.64

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明**6.4.8.1 或有事项**

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系**6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况**

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
天弘基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
招商证券股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
招商证券股份有限公司	3,819,633,085.42	49.46%	1,185,761,586.89	100.00%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
招商证券股份有限公司	883,510.03	49.46%	266,520.38	25.26%
关联方名称	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日			
	当期佣金	占当期	期末应付佣金余额	占期末应

		佣金总量的比例		付佣金总额的比例
招商证券股份有限公司	274,286.52	100.00%	148,886.52	100.00%

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

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	4,025,851.72	636,817.01
其中：支付销售机构的客户维护费	1,227,370.62	93,664.49

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0.60%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值×该日适用费率/当年天数。

2、客户维护费是指基金管理人与基金销售机构在基金销售协议中约定的依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2021年01月01日至2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	670,975.33	106,136.13

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。

6.4.10.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	天弘中证500指数增强A	天弘中证500指数增强C	合计
天弘基金管理有限公司	-	158,641.12	158,641.12
招商证券股份有限公司	-	1,549.78	1,549.78
合计	-	160,190.90	160,190.90
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06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	天弘中证500指数增强A	天弘中证500指数增强C	合计
天弘基金管理有限公司	-	82,690.99	82,690.99
招商证券股份有限公司	-	160.58	160.58
合计	-	82,851.57	82,851.57

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500指数增强C按0.30%计提销售服务费。销售服务费的计算公式为:

日销售服务费=前一日各级基金资产净值×该日适用费率/当年天数。

2、天弘中证500指数增强A不收取销售服务费。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.10.4 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明

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

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

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

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

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

天弘中证500指数增强A

份额单位：份

项目	本期 2021年01月01日至 2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至 2020年06月30日
报告期初持有的基金份额	44,037,454.94	74,247,358.12
报告期间申购/买入总份额	—	2,490,096.82
报告期间因拆分变动份额	—	—
减：报告期间赎回/卖出总份额	44,037,454.94	—
报告期末持有的基金份额	—	76,737,454.94
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	—	56.66%

天弘中证500指数增强C

份额单位：份

项目	本期 2021年01月01日至 2021年06月30日	上年度可比期间 2020年01月01日至 2020年06月30日
报告期初持有的基金份额	5,000,000.00	5,000,000.00
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	5,000,000.00	-
报告期末持有的基金份额	-	5,000,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	6.81%

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

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

6.4.10.5.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.6 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2021年01月01日至2021年06月30日		上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商证券股份有限公司	105,777,689.70	629,012.44	11,504,442.97	102,304.35

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。

6.4.10.7 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06月30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
招商证券股份有限公司	688059	华锐精密	网下申购	1,023	37,943.07
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	300991	创益通	网下申购	2,535	33,107.10

证券 股份 有限 公司					
招商 证券 股份 有限 公司	688517	金冠电气	网下申购	2,892	22,297.32
上年度可比期间 2020年01月01日至2020年06月30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	688106	金宏气体	网下申购	8,120	125,697.60

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期末及上年度末无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况——按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

本基金本报告期无利润分配事项。

6.4.12 期末（2021年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券 代码	证券 名称	成功 认购 日	可流 通日	流通 受限 类型	认购 价格	期末 估值 单价	数量 （单 位：股）	期末 成本 总额	期末 估值 总额	备注
6883	之江	2021	2021	科创	43.2	63.8	5,740	248,	366,	-

17	生物	-01-08	-07-19	板打 新限售	2	2		082.80	326.80	
688665	四方光电	2021-02-02	2021-08-09	科创板打 新限售	29.53	129.46	1,687	49,817.11	218,399.02	-
300957	贝泰妮	2021-03-18	2021-09-27	创业板打 新限售	47.33	251.96	810	38,337.30	204,087.60	-
688079	美迪凯	2021-02-23	2021-09-02	科创板打 新限售	10.19	18.40	10,622	108,238.18	195,444.80	-
688059	华锐精密	2021-02-01	2021-08-09	科创板打 新限售	37.09	160.26	1,023	37,943.07	163,945.98	-
688667	菱电电控	2021-03-03	2021-09-13	科创板打 新限售	75.42	103.88	1,191	89,825.22	123,721.08	-
688323	瑞华泰	2021-04-21	2021-10-28	科创板打 新限售	5.97	22.78	4,513	26,942.61	102,806.14	-
300919	中伟股份	2020-12-15	2021-07-02	创业板打 新限售	24.60	163.00	610	15,006.00	99,430.00	-
300979	华利集团	2021-04-15	2021-10-26	创业板打 新限售	33.22	87.50	925	30,728.50	80,937.50	-

				售						
688350	富淼科技	2021-01-21	2021-07-28	科创板打新限售	13.58	22.44	2,552	34,656.16	57,266.88	-
688239	航宇科技	2021-06-25	2021-07-05	新股未上市	11.48	11.48	4,926	56,550.48	56,550.48	-
300981	中红医疗	2021-04-19	2021-10-27	创业板打新限售	48.59	90.39	601	29,202.59	54,324.39	-
688087	英科再生	2021-06-30	2021-07-09	新股未上市	21.96	21.96	2,469	54,219.24	54,219.24	-
301017	漱玉平民	2021-06-23	2021-07-05	新股未上市	8.86	8.86	5,550	49,173.00	49,173.00	-
688260	昀冢科技	2021-03-25	2021-10-08	科创板打新限售	9.63	16.41	2,990	28,793.70	49,065.90	-
301020	密封科技	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	10.64	10.64	4,210	44,794.40	44,794.40	-
300973	立高食品	2021-04-08	2021-10-15	创业板打新限售	28.28	115.71	360	10,180.80	41,655.60	-
301021	英诺激光	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	9.46	9.46	2,899	27,424.54	27,424.54	-
3009	震裕	2021	2021	创业	28.7	99.8	240	6,90	23,9	-

53	科技	-03-11	-09-22	板打 新限售	7	5		4.80	64.00	
301009	可靠股份	2021-06-08	2021-12-17	创业板打 新限售	12.54	27.89	801	10,044.54	22,339.89	-
300941	创识科技	2021-02-02	2021-08-09	创业板打 新限售	21.31	49.94	399	8,502.69	19,926.06	-
301015	N百洋	2021-06-22	2021-12-30	创业板打 新限售	7.64	38.83	462	3,529.68	17,939.46	-
688226	威腾电气	2021-06-28	2021-07-07	新股未上市	6.42	6.42	2,693	17,289.06	17,289.06	-
300932	三友联众	2021-01-15	2021-07-22	创业板打 新限售	24.69	31.71	492	12,147.48	15,601.32	-
300982	苏文电能	2021-04-19	2021-10-27	创业板打 新限售	15.83	45.29	317	5,018.11	14,356.93	-
300614	百川畅银	2021-05-18	2021-11-25	创业板打 新限售	9.19	40.38	329	3,023.51	13,285.02	-
300937	药易购	2021-01-20	2021-07-27	创业板打 新限售	12.25	53.71	244	2,989.00	13,105.24	-

300942	易瑞生物	2021-02-02	2021-08-09	创业板打新限售	5.31	28.52	443	2,352.33	12,634.36	-
300997	欢乐家	2021-05-26	2021-12-02	创业板打新限售	4.94	13.05	928	4,584.32	12,110.40	-
300933	中辰股份	2021-01-15	2021-07-22	创业板打新限售	3.37	10.44	1,112	3,747.44	11,609.28	-
301002	崧盛股份	2021-05-27	2021-12-07	创业板打新限售	18.71	57.62	201	3,760.71	11,581.62	-
605287	德才股份	2021-06-28	2021-07-06	新股未上市	31.56	31.56	349	11,014.44	11,014.44	-
300955	嘉亨家化	2021-03-16	2021-09-24	创业板打新限售	16.53	46.07	232	3,834.96	10,688.24	-
300996	普联软件	2021-05-26	2021-12-03	创业板打新限售	20.81	42.23	241	5,015.21	10,177.43	-
300956	英力股份	2021-03-16	2021-09-27	创业板打新限售	12.85	25.80	371	4,767.35	9,571.80	-
300952	恒辉安防	2021-03-03	2021-09-13	创业板打新限售	11.72	27.08	340	3,984.80	9,207.20	-

				售						
301016	N雷尔伟	2021-06-23	2021-12-30	创业板打新限售	13.75	32.98	275	3,781.25	9,069.50	-
300966	共同药业	2021-03-31	2021-10-11	创业板打新限售	8.24	31.54	286	2,356.64	9,020.44	-
300945	曼卡龙	2021-02-03	2021-08-10	创业板打新限售	4.56	18.88	474	2,161.44	8,949.12	-
300948	冠中生态	2021-02-18	2021-08-25	创业板打新限售	13.00	27.42	324	2,808.00	8,884.08	-
300931	通用电梯	2021-01-13	2021-07-21	创业板打新限售	4.31	13.11	672	2,896.32	8,809.92	-
300961	深水海纳	2021-03-23	2021-09-30	创业板打新限售	8.48	22.07	394	3,341.12	8,695.58	-
300950	德固特	2021-02-24	2021-09-03	创业板打新限售	8.41	39.13	219	1,841.79	8,569.47	-
605162	新中港	2021-06-29	2021-07-07	新股未上市	6.07	6.07	1,377	8,358.39	8,358.39	-
300958	建工修复	2021-03-	2021-09-	创业板打	8.53	27.22	300	2,559.00	8,166.00	-

		18	29	新限售						
300986	志特新材	2021-04-21	2021-11-01	创业板打新限售	14.79	30.57	264	3,904.56	8,070.48	-
300987	川网传媒	2021-04-28	2021-11-11	创业板打新限售	6.79	26.81	301	2,043.79	8,069.81	-
300978	东箭科技	2021-04-15	2021-10-26	创业板打新限售	8.42	13.60	593	4,993.06	8,064.80	-
300926	博俊科技	2020-12-29	2021-07-12	创业板打新限售	10.76	22.20	359	3,862.84	7,969.80	-
300993	玉马遮阳	2021-05-17	2021-11-24	创业板打新限售	12.10	19.29	410	4,961.00	7,908.90	-
300930	屹通新材	2021-01-13	2021-07-21	创业板打新限售	13.11	24.48	322	4,221.42	7,882.56	-
300985	致远新能	2021-04-21	2021-10-29	创业板打新限售	24.90	24.81	295	7,345.50	7,318.95	-
301004	C嘉益	2021-06-18	2021-12-27	创业板打新限售	7.81	21.94	312	2,436.72	6,845.28	-

300991	创益通	2021-05-12	2021-11-22	创业板打新限售	13.06	26.51	254	3,317.24	6,733.54	-
300927	江天化学	2020-12-29	2021-07-07	创业板打新限售	13.39	30.10	217	2,905.63	6,531.70	-
300975	商络电子	2021-04-14	2021-10-21	创业板打新限售	5.48	13.03	492	2,696.16	6,410.76	-
300963	中洲特材	2021-03-30	2021-10-11	创业板打新限售	12.13	22.49	283	3,432.79	6,364.67	-
301011	华立科技	2021-06-09	2021-12-17	创业板打新限售	14.20	33.84	175	2,485.00	5,922.00	-
300943	春晖智控	2021-02-03	2021-08-10	创业板打新限售	9.79	23.01	255	2,496.45	5,867.55	-
300967	晓鸣股份	2021-04-02	2021-10-13	创业板打新限售	4.54	11.54	507	2,301.78	5,850.78	-
300972	万辰生物	2021-04-08	2021-10-19	创业板打新限售	7.19	12.65	430	3,091.70	5,439.50	-
300929	华骐环保	2021-01-	2021-07-	创业板打	13.87	29.55	183	2,538.21	5,407.65	-

		12	21	新限售						
300960	通业科技	2021-03-22	2021-09-29	创业板打新限售	12.08	23.06	234	2,826.72	5,396.04	-
300995	奇德新材	2021-05-17	2021-11-26	创业板打新限售	14.72	23.32	191	2,811.52	4,454.12	-
301007	德迈仕	2021-06-04	2021-12-16	创业板打新限售	5.29	14.44	303	1,602.87	4,375.32	-
300998	宁波方正	2021-05-25	2021-12-02	创业板打新限售	6.02	21.32	201	1,210.02	4,285.32	-
301012	扬电科技	2021-06-15	2021-12-22	创业板打新限售	8.05	24.26	170	1,368.50	4,124.20	-
300992	泰福泵业	2021-05-17	2021-11-25	创业板打新限售	9.36	20.32	200	1,872.00	4,064.00	-
301010	晶雪节能	2021-06-09	2021-12-20	创业板打新限售	7.83	17.61	218	1,706.94	3,838.98	-
6.4.12.1.2 受限证券类别：债券										
证券代码	证券名称	成功认购日	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

113051	节能环保	2021-06-21	2021-07-22	新债未上市	100.00	100.00	4,600	460,000.00	460,000.00	-
--------	------	------------	------------	-------	--------	--------	-------	------------	------------	---

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、创业板新股漱玉平民（证券代码：301017）于2021年07月05日起上市流通，本基金获配的股数中555股根据《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》于上市后进入限售期，可流通日为2022年01月05日。

5、创业板新股密封科技（证券代码：301020）于2021年07月06日起上市流通，本基金获配的股数中421股根据《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》于上市后进入限售期，可流通日为2022年01月06日。

6、创业板新股英诺激光（证券代码：301021）于2021年07月06日起上市流通，本基金获配的股数中290股根据《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》于上市后进入限售期，可流通日为2022年01月06日。

7、以上“可流通日”的日期，最终以上市公司公告为准。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
------	------	------	------	--------	------	--------	-------	--------	--------	----

600 460	士 兰 微	202 1-0 6-3 0	因 刊 登 重 要 事 项 公 告	56. 35	202 1-0 7-0 1	59. 49	493, 50 0	17, 335, 77 6. 19	27, 808, 72 5. 00	-
600 811	东 方 集 团	202 1-0 6-3 0	拟 筹 划 重 大 资 产 重 组	3. 0 5	202 1-0 7-1 4	3. 3 6	321, 10 0	1, 011, 44 3. 12	979, 355. 0 0	-

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

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型指数基金，采用指数复制投资策略，按照个股在标的指数中的基准权重构建股票组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应地调整，以复制和跟踪标的指数。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。

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

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

6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人招商证券股份有限公司开立于具有基金托管人资格的交通银行股份有限公司的托管账户，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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

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

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级的债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有短期信用评级的同业存单。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
AAA	-	-
AAA以下	460,000.00	15,000.00
未评级	-	-
合计	460,000.00	15,000.00

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本基金本报告期末及上年度末均未持有长期信用评级的同业存单。

6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

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

于2021年06月30日，本基金所承担的全部金融负债的合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。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短时间内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。

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

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了交易对手管理制度：根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2021年06月30日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	105,777,689.70	-	-	-	105,777,689.70
结算备付金	6,943,269.51	-	-	1,001.00	6,944,270.51
存出保证金	564,484.39	-	-	-	564,484.39
交易性金融资产	-	-	460,000.00	1,766,807,670.72	1,767,267,670.72
应收利息	-	-	-	48,401.73	48,401.73
应收申购款	-	-	-	26,229,359.12	26,229,359.12
资产总计	113,285,443.60	-	460,000.00	1,793,086,432.57	1,906,831,876.17

负债					
应付证券清算款	-	-	-	18,120,239.25	18,120,239.25
应付赎回款	-	-	-	17,743,913.73	17,743,913.73
应付管理人报酬	-	-	-	842,014.05	842,014.05
应付托管费	-	-	-	140,335.69	140,335.69
应付销售服务费	-	-	-	146,223.79	146,223.79
应付交易费用	-	-	-	1,055,089.72	1,055,089.72
应交税费	-	-	-	0.67	0.67
其他负债	-	-	-	166,802.37	166,802.37
负债总计	-	-	-	38,214,619.27	38,214,619.27
利率敏感度缺口	113,285,443.60	-	460,000.00	1,754,871,813.30	1,868,617,256.90
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	75,767,734.88	-	-	-	75,767,734.88
结算备付金	4,626,680.37	-	-	1,001.00	4,627,681.37
存出保证金	645,460.80	-	-	-	645,460.80
交易性金融资产	-	-	15,000.00	1,037,415,592.53	1,037,430,592.53
应收利息	-	-	-	32,399.26	32,399.26
应收申购款	-	-	-	4,208,585.33	4,208,585.33
资产总计	81,039,876.05	-	15,000.00	1,041,657,578.12	1,122,712,454.17
负债					
应付证券清算款	-	-	-	8,901,324.70	8,901,324.70
应付赎回款	-	-	-	15,076,082.95	15,076,082.95
应付管理人报酬	-	-	-	515,470.17	515,470.17
应付托管费	-	-	-	85,911.71	85,911.71
应付销售服务费	-	-	-	69,100.10	69,100.10
应付交易费用	-	-	-	600,800.24	600,800.24
其他负债	-	-	-	238,020.17	238,020.17
负债总计	-	-	-	25,486,710.04	25,486,710.04
利率敏感度缺口	81,039,876.05	-	15,000.00	1,016,170,868.08	1,097,225,744.13

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2021年06月30日，本基金持有的交易性债券投资占基金资产净值的比例为0.02%(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)。

6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市的股票，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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于股票的资产不低于基金资产的90%，投资于标的指数成份股、备选成份股的资产占非现金基金资产的比例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，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2021年06月30日		上年度末 2020年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)

交易性金融资产—股票投资	1,766,807,670.72	94.55	1,037,415,592.53	94.55
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	1,766,807,670.72	94.55	1,037,415,592.53	94.55

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2021年06月30日	上年度末 2020年12月31日
	业绩比较基准上升5%	82,219,159.30	55,409,900.08
	业绩比较基准下降5%	-82,219,159.30	-55,409,900.08

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2021年06月30日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为1,735,547,896.41元，属于第二层次的余额为

31,719,774.31元，无属于第三层次的余额(2020年12月31日：第一层次1,031,214,687.16元，第二层次6,215,905.37元，无属于第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

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

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	1,766,807,670.72	92.66
	其中：股票	1,766,807,670.72	92.66
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	460,000.00	0.02
	其中：债券	460,000.00	0.02
	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	112,721,960.21	5.91
8	其他各项资产	26,842,245.24	1.41
9	合计	1,906,831,876.17	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	27,896,329.19	1.49
B	采矿业	51,148,965.00	2.74
C	制造业	1,106,730,827.44	59.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	29,571,703.00	1.58
E	建筑业	37,243,383.00	1.99
F	批发和零售业	39,261,275.88	2.10
G	交通运输、仓储和邮政业	34,184,446.45	1.83
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	122,480,007.43	6.55
J	金融业	68,704,002.50	3.68
K	房地产业	58,694,662.00	3.14
L	租赁和商务服务业	5,175,617.70	0.28
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	21,444,420.00	1.15
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	35,960,505.00	1.92

S	综合	7,912,079.28	0.42
	合计	1,646,408,223.87	88.11

7.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	11,290.28	0.00
B	采矿业	15,413,684.00	0.82
C	制造业	63,279,697.50	3.39
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	13,020.39	0.00
E	建筑业	25,371.37	0.00
F	批发和零售业	95,577.58	0.01
G	交通运输、仓储和邮政业	13,089,444.00	0.70
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	38,173.30	0.00
J	金融业	16,475,264.10	0.88
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	10,233,410.00	0.55
M	科学研究和技术服务业	1,680,076.00	0.09
N	水利、环境和公共设施管理业	44,438.33	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	-	-
S	综合	-	-
	合计	120,399,446.85	6.44

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000830	鲁西化工	1,830,500	34,285,265.00	1.83
2	002603	以岭药业	1,160,531	33,841,083.96	1.81
3	601005	重庆钢铁	12,187,300	32,540,091.00	1.74
4	300251	光线传媒	2,926,500	31,635,465.00	1.69
5	600216	浙江医药	1,971,534	31,564,259.34	1.69
6	688321	微芯生物	677,122	31,276,265.18	1.67
7	300223	北京君正	303,100	30,588,852.00	1.64
8	600549	厦门钨业	1,461,200	30,436,796.00	1.63
9	002281	光迅科技	1,234,986	30,380,655.60	1.63
10	600718	东软集团	3,086,036	30,181,432.08	1.62
11	601233	桐昆股份	1,246,200	30,020,958.00	1.61
12	600409	三友化工	2,960,798	29,933,667.78	1.60
13	600188	兖州煤业	1,947,100	29,907,456.00	1.60
14	601598	中国外运	5,764,900	29,112,745.00	1.56
15	688099	晶晨股份	257,428	28,883,421.60	1.55
16	002092	中泰化学	2,734,401	28,082,298.27	1.50
17	600418	江淮汽车	2,254,389	28,022,055.27	1.50
18	601512	中新集团	2,804,100	27,928,836.00	1.49
19	002458	益生股份	2,798,027	27,896,329.19	1.49
20	600460	士兰微	493,500	27,808,725.00	1.49
21	000630	铜陵有色	10,054,200	27,347,424.00	1.46
22	002030	达安基因	1,219,636	25,905,068.64	1.39
23	000039	中集集团	1,353,693	24,610,138.74	1.32
24	600089	特变电工	1,895,700	24,359,745.00	1.30
25	600642	申能股份	3,904,400	23,973,016.00	1.28
26	600039	四川路桥	3,668,100	22,998,987.00	1.23
27	002648	卫星石化	563,500	22,083,565.00	1.18

28	000012	南 玻 A	2,130,850	21,819,904.00	1.17
29	002056	横店东磁	1,659,800	21,577,400.00	1.15
30	002839	张家港行	3,804,400	20,695,936.00	1.11
31	300271	华宇软件	1,068,208	20,563,004.00	1.10
32	002078	太阳纸业	1,514,851	20,223,260.85	1.08
33	000519	中兵红箭	1,879,500	20,148,240.00	1.08
34	000050	深天马 A	1,415,600	20,073,208.00	1.07
35	002266	浙富控股	4,016,100	20,040,339.00	1.07
36	600649	城投控股	4,081,400	19,427,464.00	1.04
37	600095	湘财股份	1,636,300	19,161,073.00	1.03
38	000807	云铝股份	1,543,800	18,371,220.00	0.98
39	600779	水井坊	145,300	18,358,655.00	0.98
40	601689	拓普集团	478,097	17,895,170.71	0.96
41	601615	明阳智能	1,072,890	17,370,089.10	0.93
42	600038	XD中直股	326,327	17,210,485.98	0.92
43	603444	吉比特	32,300	17,119,000.00	0.92
44	002156	通富微电	711,116	17,095,228.64	0.91
45	603225	新凤鸣	822,900	16,704,870.00	0.89
46	002382	蓝帆医疗	800,119	16,682,481.15	0.89
47	002557	洽洽食品	379,200	16,343,520.00	0.87
48	600782	新钢股份	2,839,700	15,845,526.00	0.85
49	000400	许继电气	1,233,877	15,620,882.82	0.84
50	300474	景嘉微	159,016	15,570,846.72	0.83
51	600884	杉杉股份	656,905	15,319,024.60	0.82
52	600060	海信视像	905,397	15,301,209.30	0.82
53	600988	赤峰黄金	1,004,200	15,052,958.00	0.81
54	603486	科沃斯	60,540	13,807,963.20	0.74
55	600271	航天信息	1,020,100	13,291,903.00	0.71
56	600729	重庆百货	471,520	12,943,224.00	0.69
57	300316	晶盛机电	255,200	12,887,600.00	0.69
58	300146	汤臣倍健	377,600	12,423,040.00	0.66

59	002563	森马服饰	1,039,000	12,416,050.00	0.66
60	601456	国联证券	794,700	12,238,380.00	0.65
61	600998	九州通	794,774	12,215,676.38	0.65
62	600801	华新水泥	675,400	11,866,778.00	0.64
63	600895	张江高科	620,600	11,338,362.00	0.61
64	300253	卫宁健康	627,400	10,207,798.00	0.55
65	000799	酒鬼酒	39,331	10,053,003.60	0.54
66	002180	纳思达	305,397	9,833,783.40	0.53
67	600498	烽火通信	495,500	9,231,165.00	0.49
68	600867	通化东宝	769,950	9,193,203.00	0.49
69	688208	道通科技	105,200	9,151,348.00	0.49
70	000513	丽珠集团	180,317	9,019,456.34	0.48
71	600755	厦门国贸	1,027,050	8,432,080.50	0.45
72	600808	马钢股份	1,956,700	8,394,243.00	0.45
73	002572	索菲亚	333,037	8,059,495.40	0.43
74	600066	宇通客车	642,800	8,028,572.00	0.43
75	000009	中国宝安	433,064	7,912,079.28	0.42
76	002048	宁波华翔	350,545	6,835,627.50	0.37
77	002268	卫 士 通	336,400	6,553,072.00	0.35
78	002081	金 螳 螂	769,900	6,097,608.00	0.33
79	600166	福田汽车	1,699,400	5,862,930.00	0.31
80	002375	亚厦股份	673,700	5,335,704.00	0.29
81	603355	莱克电气	85,000	5,289,550.00	0.28
82	600643	爱建集团	754,275	5,264,839.50	0.28
83	300058	蓝色光标	855,474	5,175,617.70	0.28
84	603786	科博达	65,200	4,922,600.00	0.26
85	603888	新华网	232,450	4,920,966.50	0.26
86	002709	天赐材料	45,860	4,887,758.80	0.26
87	600827	百联股份	240,500	4,846,075.00	0.26
88	600201	生物股份	264,500	4,615,525.00	0.25
89	002948	青岛银行	865,800	4,303,026.00	0.23

90	002340	格林美	439,400	4,108,390.00	0.22
91	300009	安科生物	272,320	4,057,568.00	0.22
92	601699	潞安环能	340,300	4,018,943.00	0.22
93	002690	美亚光电	65,100	3,629,976.00	0.19
94	603712	七一二	100,000	3,610,000.00	0.19
95	000528	柳 工	436,000	3,575,200.00	0.19
96	600839	四川长虹	1,209,425	3,519,426.75	0.19
97	600582	天地科技	868,000	3,385,200.00	0.18
98	000681	视觉中国	255,200	3,299,736.00	0.18
99	600377	宁沪高速	329,600	3,216,896.00	0.17
100	601717	郑煤机	271,700	3,159,871.00	0.17
101	300463	迈克生物	73,200	3,080,988.00	0.16
102	601016	节能风电	768,700	2,874,938.00	0.15
103	600901	江苏租赁	543,600	2,826,720.00	0.15
104	601117	中国化学	320,900	2,811,084.00	0.15
105	600008	首创环保	904,900	2,723,749.00	0.15
106	600737	中粮糖业	260,500	2,607,605.00	0.14
107	002701	奥瑞金	485,800	2,497,012.00	0.13
108	000738	航发控制	117,000	2,437,110.00	0.13
109	603893	瑞芯微	16,900	2,356,874.00	0.13
110	002625	光启技术	107,100	2,228,751.00	0.12

11 1	600348	华阳股份	292,400	2,169,608.00	0.12
11 2	002423	中粮资本	232,400	2,103,220.00	0.11
11 3	600928	西安银行	404,800	1,886,368.00	0.10
11 4	000488	晨鸣纸业	219,300	1,785,102.00	0.10
11 5	000869	张裕A	39,500	1,467,030.00	0.08
11 6	601200	上海环境	117,300	1,404,081.00	0.08
11 7	000825	太钢不锈	173,800	1,301,762.00	0.07
11 8	300315	掌趣科技	284,200	1,207,850.00	0.06
11 9	000723	美锦能源	159,300	1,204,308.00	0.06
12 0	002368	太极股份	57,200	1,147,432.00	0.06
12 1	000898	鞍钢股份	239,300	1,064,885.00	0.06
12 2	601928	凤凰传媒	143,600	1,025,304.00	0.05
12 3	600811	东方集团	321,100	979,355.00	0.05
12 4	002745	木林森	71,700	960,780.00	0.05
12 5	002439	启明星辰	30,000	870,300.00	0.05
12 6	603719	良品铺子	18,316	824,220.00	0.04
12	002532	天山铝业	97,300	816,347.00	0.04

7					
12 8	688088	虹软科技	14,195	791,371.25	0.04
12 9	600717	天津港	186,419	730,762.48	0.04
13 0	601880	辽港股份	417,400	713,754.00	0.04
13 1	600580	卧龙电驱	39,900	530,670.00	0.03
13 2	000089	深圳机场	52,800	410,256.00	0.02
13 3	000717	韶钢松山	75,100	344,709.00	0.02
13 4	000877	天山股份	22,700	295,781.00	0.02
13 5	600141	兴发集团	14,600	274,918.00	0.01
13 6	603198	迎驾贡酒	5,900	261,370.00	0.01
13 7	601128	常熟银行	36,200	224,440.00	0.01
13 8	002465	海格通信	21,900	207,174.00	0.01
13 9	002249	大洋电机	29,500	154,875.00	0.01
14 0	601636	旗滨集团	4,500	83,520.00	0.00
14 1	002124	天邦股份	7,780	54,537.80	0.00
14 2	603927	中科软	800	34,360.00	0.00
14 3	603056	德邦股份	3	32.97	0.00

7.3.2 期末积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000425	徐工机械	3,275,200	20,863,024.00	1.12
2	600958	东方证券	1,645,700	16,440,543.00	0.88
3	601919	中远海控	428,600	13,089,444.00	0.70
4	601857	中国石油	2,309,600	12,217,784.00	0.65
5	000725	京东方 A	1,756,400	10,959,936.00	0.59
6	000100	TCL科技	1,394,000	10,664,100.00	0.57
7	601888	中国中免	34,100	10,233,410.00	0.55
8	300750	宁德时代	17,600	9,412,480.00	0.50
9	600583	海油工程	710,200	3,195,900.00	0.17
10	603267	鸿远电子	21,200	2,711,904.00	0.15
11	601238	广汽集团	132,300	1,713,285.00	0.09
12	300012	华测检测	52,700	1,680,076.00	0.09
13	000683	远兴能源	340,300	1,589,201.00	0.09
14	600132	重庆啤酒	5,300	1,049,135.00	0.06
15	000157	中联重科	92,000	850,080.00	0.05
16	002706	良信股份	30,000	676,200.00	0.04
17	002179	中航光电	6,400	505,728.00	0.03
18	688317	之江生物	5,740	366,326.80	0.02
19	688665	四方光电	1,687	218,399.02	0.01
20	300957	贝泰妮	810	204,087.60	0.01

21	688079	美迪凯	10,622	195,444.80	0.01
22	688059	华锐精密	1,023	163,945.98	0.01
23	688667	菱电电控	1,191	123,721.08	0.01
24	688323	瑞华泰	4,513	102,806.14	0.01
25	300919	中伟股份	610	99,430.00	0.01
26	300979	华利集团	925	80,937.50	0.00
27	688350	富淼科技	2,552	57,266.88	0.00
28	688239	航宇科技	4,926	56,550.48	0.00
29	300981	中红医疗	601	54,324.39	0.00
30	688087	英科再生	2,469	54,219.24	0.00
31	301017	漱玉平民	5,550	49,173.00	0.00
32	688260	昀冢科技	2,990	49,065.90	0.00
33	301020	密封科技	4,210	44,794.40	0.00
34	300973	立高食品	360	41,655.60	0.00
35	601528	瑞丰银行	2,230	34,721.10	0.00
36	301021	英诺激光	2,899	27,424.54	0.00
37	300953	震裕科技	240	23,964.00	0.00
38	001207	联科科技	682	22,581.02	0.00
39	301009	可靠股份	801	22,339.89	0.00
40	300941	创识科技	399	19,926.06	0.00
41	301015	N百洋	462	17,939.46	0.00
42	688226	威腾电气	2,693	17,289.06	0.00
43	300932	三友联众	492	15,601.32	0.00
44	300982	苏文电能	317	14,356.93	0.00
45	001208	华菱线缆	1,754	13,558.42	0.00
46	300614	百川畅银	329	13,285.02	0.00
47	300937	药易购	244	13,105.24	0.00
48	300942	易瑞生物	443	12,634.36	0.00
49	300997	欢乐家	928	12,110.40	0.00
50	300933	中辰股份	1,112	11,609.28	0.00
51	301002	崧盛股份	201	11,581.62	0.00

52	605287	德才股份	349	11,014.44	0.00
53	300955	嘉亨家化	232	10,688.24	0.00
54	300996	普联软件	241	10,177.43	0.00
55	300956	英力股份	371	9,571.80	0.00
56	300952	恒辉安防	340	9,207.20	0.00
57	301016	N雷尔伟	275	9,069.50	0.00
58	300966	共同药业	286	9,020.44	0.00
59	300945	曼卡龙	474	8,949.12	0.00
60	300948	冠中生态	324	8,884.08	0.00
61	300931	通用电梯	672	8,809.92	0.00
62	300961	深水海纳	394	8,695.58	0.00
63	300950	德固特	219	8,569.47	0.00
64	605162	新中港	1,377	8,358.39	0.00
65	300958	建工修复	300	8,166.00	0.00
66	300986	志特新材	264	8,070.48	0.00
67	300987	川网传媒	301	8,069.81	0.00
68	300978	东箭科技	593	8,064.80	0.00
69	300926	博俊科技	359	7,969.80	0.00
70	300993	玉马遮阳	410	7,908.90	0.00
71	300930	屹通新材	322	7,882.56	0.00
72	300985	致远新能	295	7,318.95	0.00
73	301004	C嘉益	312	6,845.28	0.00
74	300991	创益通	254	6,733.54	0.00
75	300927	江天化学	217	6,531.70	0.00
76	300975	商络电子	492	6,410.76	0.00
77	300963	中洲特材	283	6,364.67	0.00
78	301011	华立科技	175	5,922.00	0.00
79	300943	春晖智控	255	5,867.55	0.00
80	300967	晓鸣股份	507	5,850.78	0.00
81	300972	万辰生物	430	5,439.50	0.00
82	300929	华骐环保	183	5,407.65	0.00

83	300960	通业科技	234	5,396.04	0.00
84	605011	N杭热	525	4,662.00	0.00
85	300995	奇德新材	191	4,454.12	0.00
86	301007	德迈仕	303	4,375.32	0.00
87	300998	宁波方正	201	4,285.32	0.00
88	301012	扬电科技	170	4,124.20	0.00
89	300992	泰福泵业	200	4,064.00	0.00
90	301010	晶雪节能	218	3,838.98	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600549	厦门钨业	63,588,442.07	5.80
2	600132	重庆啤酒	55,402,933.29	5.05
3	300223	北京君正	44,152,863.09	4.02
4	000050	深天马 A	40,987,796.88	3.74
5	600782	新钢股份	39,598,237.00	3.61
6	688321	微芯生物	39,091,533.15	3.56
7	600188	兖州煤业	38,954,570.52	3.55
8	600089	特变电工	36,822,099.43	3.36
9	002092	中泰化学	36,687,280.20	3.34
10	601598	中国外运	36,514,619.54	3.33
11	000807	云铝股份	34,122,308.00	3.11
12	600426	华鲁恒升	34,016,963.64	3.10
13	600884	杉杉股份	33,989,868.49	3.10
14	000039	中集集团	33,909,713.64	3.09
15	601005	重庆钢铁	33,480,478.00	3.05
16	600718	东软集团	33,293,045.12	3.03
17	300251	光线传媒	32,864,289.86	3.00

18	002156	通富微电	32,600,933.64	2.97
19	000012	南玻A	32,482,214.02	2.96
20	002056	横店东磁	32,464,150.00	2.96
21	601615	明阳智能	32,422,322.10	2.95
22	000830	鲁西化工	31,754,441.00	2.89
23	600039	四川路桥	31,601,260.82	2.88
24	600143	金发科技	31,436,655.81	2.87
25	002603	以岭药业	31,276,665.64	2.85
26	002281	光迅科技	30,828,841.31	2.81
27	601689	拓普集团	30,587,094.05	2.79
28	601512	中新集团	30,298,404.43	2.76
29	002030	达安基因	30,218,609.70	2.75
30	002648	卫星石化	29,356,708.13	2.68
31	601233	桐昆股份	27,665,413.00	2.52
32	002458	益生股份	27,595,803.02	2.52
33	300168	万达信息	27,573,321.51	2.51
34	000630	铜陵有色	27,558,683.00	2.51
35	600216	浙江医药	27,464,111.37	2.50
36	600649	城投控股	27,333,792.51	2.49
37	600038	中直股份	26,736,711.26	2.44
38	002064	华峰化学	25,772,085.00	2.35
39	688099	晶晨股份	25,422,180.07	2.32
40	600460	士兰微	25,386,632.20	2.31
41	600418	江淮汽车	25,383,464.07	2.31
42	000898	鞍钢股份	25,275,478.79	2.30
43	600958	东方证券	25,247,613.00	2.30
44	300474	景嘉微	24,611,723.68	2.24
45	002078	太阳纸业	24,573,088.04	2.24
46	600642	申能股份	24,395,998.25	2.22
47	600219	南山铝业	23,375,503.75	2.13
48	000488	晨鸣纸业	22,939,477.00	2.09

49	300618	寒锐钴业	22,855,919.92	2.08
50	000959	首钢股份	22,768,518.55	2.08
51	600808	马钢股份	22,503,310.98	2.05
52	002568	百润股份	22,317,097.00	2.03
53	600409	三友化工	22,199,886.64	2.02
54	600171	上海贝岭	22,116,444.00	2.02
55	000725	京东方 A	22,023,870.00	2.01
56	300271	华宇软件	21,978,764.96	2.00

注：本项的“买入金额”均按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600132	重庆啤酒	59,947,812.68	5.46
2	603486	科沃斯	40,797,233.71	3.72
3	000807	云铝股份	40,785,739.37	3.72
4	300274	阳光电源	40,692,084.02	3.71
5	600549	厦门钨业	39,757,484.54	3.62
6	002064	华峰化学	39,536,999.98	3.60
7	600426	华鲁恒升	39,373,888.57	3.59
8	002709	天赐材料	37,940,251.24	3.46
9	000898	鞍钢股份	37,080,371.23	3.38
10	000039	中集集团	35,735,498.24	3.26
11	300115	长盈精密	35,371,789.56	3.22
12	601799	星宇股份	35,344,479.72	3.22
13	001914	招商积余	34,394,498.92	3.13
14	603882	金域医学	33,756,130.35	3.08
15	000488	晨鸣纸业	32,859,620.62	2.99
16	000983	山西焦煤	32,620,037.08	2.97

17	600039	四川路桥	32,016,400.00	2.92
18	300474	景嘉微	31,520,303.60	2.87
19	600143	金发科技	29,888,603.99	2.72
20	300618	寒锐钴业	29,721,073.82	2.71
21	000725	京东方 A	29,349,904.00	2.67
22	000932	华菱钢铁	28,824,263.56	2.63
23	600282	南钢股份	26,840,595.00	2.45
24	300168	万达信息	25,523,925.67	2.33
25	002124	天邦股份	25,406,529.50	2.32
26	000959	首钢股份	25,226,136.43	2.30
27	600782	新钢股份	25,204,758.00	2.30
28	601615	明阳智能	24,814,820.21	2.26
29	000636	风华高科	24,798,959.34	2.26
30	600171	上海贝岭	24,716,474.83	2.25
31	600517	国网英大	24,548,236.00	2.24
32	603260	合盛硅业	23,286,023.80	2.12
33	600011	华能国际	23,235,994.47	2.12
34	600755	厦门国贸	23,035,081.86	2.10
35	300496	中科创达	22,902,510.31	2.09
36	002027	分众传媒	22,674,862.91	2.07
37	002156	通富微电	21,968,614.02	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。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	4,126,427,256.86
卖出股票收入（成交）总额	3,607,110,498.91

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位：人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债(可交换债)	460,000.00	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	460,000.00	0.02

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113051	节能转债	4,600	460,000.00	0.02

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 本报告期内未发现基金投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查，未发现在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

7.12.2 基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	564,484.39
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	48,401.73
5	应收申购款	26,229,359.12
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	26,842,245.24

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票不存在流通受限情况。

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额 级别	持有 人户 数 (户)	户均持有的 基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总 份额 比例	持有份额	占总份 额比例
天弘 中证5 00指 数增 强A	121, 853	6,977.17	82,462,414.02	9.70%	767,726,589.35	90.30%
天弘 中证5 00指 数增 强C	191, 389	2,539.42	153,656,126.58	31.6 2%	332,361,004.46	68.38%
合计	313, 242	4,265.73	236,118,540.60	17.6 7%	1,100,087,593. 81	82.33%

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

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比 例
基金管理人所有从业人员 持有本基金	天弘中证500指数 增强A	4,522,718.48	0.53%
	天弘中证500指数 增强C	720,602.64	0.15%
	合计	5,243,321.12	0.39%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	天弘中证500指数增强A	50~100
	天弘中证500指数增强C	0
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	天弘中证500指数增强A	>100
	天弘中证500指数增强C	0
	合计	>100

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	天弘中证500指数增强A	天弘中证500指数增强C
基金合同生效日(2019年08月12日)基金份额总额	14,408,757.35	39,141,988.78
本报告期期初基金份额总额	628,308,974.48	269,591,347.10
本报告期基金总申购份额	654,777,194.99	566,163,444.22
减：本报告期基金总赎回份额	432,897,166.10	349,737,660.28
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	850,189,003.37	486,017,131.04

注：总申购份额含转换转入份额；总赎回份额含转换转出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

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。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内，未发生影响基金管理人经营或基金运营业务的诉讼。

本报告期内，无涉及公募基金托管业务的诉讼事项。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略没有改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生变化。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人、托管人及其高级管理人员没有发生受稽查或处罚的情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
安信证券	1	-	-	-	-	-
渤海证券	1	2,469,526,209.35	31.98%	571,212.96	31.98%	-
长江证券	1	-	-	-	-	-
东方	2	-	-	-	-	-

财富证券						
方正证券	3	257,638,585.56	3.34%	59,592.48	3.34%	-
光大证券	3	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华泰证券	1	-	-	-	-	-
开源证券	2	1,176,158,442.02	15.23%	272,031.42	15.23%	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	-	-	-	-	-
招商证券	5	3,819,633,085.42	49.46%	883,510.03	49.46%	-
中金财富	1	-	-	-	-	-
中金公司	1	-	-	-	-	-

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。

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、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：无。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
渤海证券	530,657.56	37.52%	-	-	-	-	-	-
长江证券	-	-	-	-	-	-	-	-
东方财富证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
华泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
开源证券	460,000.00	32.52%	-	-	-	-	-	-
天风证券	-	-	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
招商证券	423,836.00	29.96%	-	-	-	-	-	-
中金财富	-	-	-	-	-	-	-	-
中金公司	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	天弘基金管理有限公司关于终止深圳盈信基金销售有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定媒介	2021-01-01
2	天弘基金管理有限公司关于增加交通银行股份有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投、转换业务以及参加其费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2021-01-13
3	天弘中证500指数增强型证券投资基金2020年第四季度报告	中国证监会指定媒介	2021-01-22

4	天弘基金管理有限公司关于增加广东顺德农村商业银行股份有限公司为天弘中证500指数增强型证券投资基金销售机构并开通申购、赎回、定投、转换业务的公告	中国证监会指定媒介	2021-01-22
5	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会指定媒介	2021-01-25
6	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会指定媒介	2021-01-27
7	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会指定媒介	2021-01-30
8	天弘基金管理有限公司关于增加中信银行股份有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投、转换业务的公告	中国证监会指定媒介	2021-02-01
9	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会指定媒介	2021-02-03
10	关于注意防范冒用天弘创新相关名义进行诈骗活动的风险提示	中国证监会指定媒介	2021-02-24
11	天弘基金管理有限公司关于防范不法分子冒用公司名义进行诈骗活动的风险提示	中国证监会指定媒介	2021-03-04
12	天弘基金管理有限公司关于增加湘财证券有限责任公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投、转换业务以及参加其费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2021-03-12
13	天弘基金管理有限公司关于增加兴业银行股份有限公司（钱大掌柜）为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回业务以及参加其费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2021-03-22

14	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会指定媒介	2021-03-24
15	天弘基金管理有限公司关于增加招商银行股份有限公司（招赢通平台）为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回业务以及参加其费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2021-03-25
16	天弘中证500指数增强型证券投资基金2020年年度报告	中国证监会指定媒介	2021-03-31
17	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金修订基金合同等法律文件的公告	中国证监会指定媒介	2021-03-31
18	天弘中证500指数增强型证券投资基金基金合同	中国证监会指定媒介	2021-03-31
19	天弘中证500指数增强型证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会指定媒介	2021-03-31
20	天弘中证500指数增强型证券投资基金托管协议	中国证监会指定媒介	2021-03-31
21	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	中国证监会指定媒介	2021-04-02
22	天弘中证500指数增强型证券投资基金产品资料概要（更新）	中国证监会指定媒介	2021-04-06
23	天弘创新资产管理有限公司关于防范不法分子冒用公司名义进行诈骗活动的风险提示	中国证监会指定媒介	2021-04-07
24	天弘基金管理有限公司关于	中国证监会指定媒介	2021-04-12

	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		
25	天弘中证500指数增强型证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会指定媒介	2021-04-14
26	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会指定媒介	2021-04-19
27	天弘中证500指数增强型证券投资基金2021年第一季度报告	中国证监会指定媒介	2021-04-22
28	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	中国证监会指定媒介	2021-05-06
29	天弘基金管理有限公司关于增加华龙证券有限责任公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投、转换业务以及参加其费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2021-05-12
30	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会指定媒介	2021-05-14
31	天弘基金管理有限公司关于增加爱建证券有限责任公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投、转换业务以及参加其费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2021-05-31
32	天弘基金管理有限公司关于董事长离任及总经理代行董事长职务的公告	中国证监会指定媒介	2021-06-02
33	天弘基金管理有限公司关于	中国证监会指定媒介	2021-06-02

	高级管理人员变更的公告		
34	天弘基金管理有限公司关于增加国信证券股份有限公司为天弘中证500指数增强型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	中国证监会指定媒介	2021-06-10
35	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会指定媒介	2021-06-12
36	天弘基金管理有限公司关于天弘中证500指数增强型证券投资基金增加销售机构并开通申购、赎回、定投、转换业务以及参加其费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2021-06-18
37	天弘基金管理有限公司关于增加长城华西银行股份有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投、转换业务以及参加其费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2021-06-30

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

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

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金募集的文件
- 2、天弘中证500指数增强型证券投资基金基金合同
- 3、天弘中证500指数增强型证券投资基金托管协议
- 4、天弘中证500指数增强型证券投资基金招募说明书
- 5、报告期内在指定报刊上披露的各项公告
- 6、中国证监会规定的其他文件

12.2 存放地点

天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层

12.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公场所及网站或基金托管人的办公场所免费查阅备查文件，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

公司网站：www.thfund.com.cn

天弘基金管理有限公司
二〇二一年八月三十一日