

天弘中证500指数型发起式证券投资基金2017年半年度报告

2017年6月30日

基金管理人：天弘基金管理有限公司

基金托管人：国泰君安证券股份有限公司

送出日期：2017年8月28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。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人国泰君安证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年8月24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2017年1月1日起至2017年6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	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	8
4.1 基金管理人及基金经理情况	8
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	10
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	10
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	11
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	13
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	13
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	13
6.1 资产负债表	13
6.2 利润表	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	18
§7 投资组合报告	38
7.1 期末基金资产组合情况	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	39
7.3 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	40
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	58
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	59
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	60
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	60
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	60
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	60
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	60
7.12 投资组合报告附注	60
§8 基金份额持有人信息	62
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	62
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	62
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	62
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	63
§9 开放式基金份额变动	63
§10 重大事件揭示	63
10.1 基金份额持有人大会决议	63
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	63

10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	64
10.4	基金投资策略的改变	64
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	64
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	64
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	64
10.8	其他重大事件	64
§11	影响投资者决策的其他重要信息	67
§12	备查文件目录	67
12.1	备查文件目录	67
12.2	存放地点	67
12.3	查阅方式	67

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	天弘中证500指数型发起式证券投资基金
基金简称	天弘中证500
基金主代码	000962
基金运作方式	契约型开放式、发起式
基金合同生效日	2015年1月20日
基金管理人	天弘基金管理有限公司
基金托管人	国泰君安证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	686,989,277.98份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。
投资策略	本基金采用完全复制标的指数的方法，进行被动指数化投资。股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合复制标的指数，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，以复制和跟踪标的指数。本基金在严格控制基金的日均跟踪偏离度和年跟踪误差的前提下，力争获取与标的指数相似的投资收益。
业绩比较基准	本基金投资组合的业绩比较基准为：中证500指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	天弘基金管理有限公司	国泰君安证券股份有限公司
信息披露 姓名	童建林	王健

露负责人	联系电话	022-83310208	021-38676252
	电子邮箱	service@thfund.com.cn	wangj222@gtjas.com
客户服务电话		4007109999	95521
传真		022-83865569	021-38677819
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	中国(上海)自由贸易试验区 商城路618号
办公地址		天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层	上海市浦东新区银城中路68号32层
邮政编码		300203	200120
法定代表人		井贤栋	杨德红

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、上海证券报、证券时报
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.thfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	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
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(2017年1月1日至2017年6月30日)
本期已实现收益	-9,406,162.31
本期利润	-8,791,180.48

加权平均基金份额本期利润	-0.0144
本期加权平均净值利润率	-1.43%
本期基金份额净值增长率	-1.22%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年6月30日)
期末可供分配利润	-226,055,103.72
期末可供分配基金份额利润	-0.3291
期末基金资产净值	686,436,725.86
期末基金份额净值	0.9992
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年6月30日)
基金份额累计净值增长率	-0.08%

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。

4、本基金《基金合同》2015年1月20日起生效。

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
过去一个月	5.31%	0.88%	5.12%	0.89%	0.19%	-0.01%
过去三个月	-3.15%	0.96%	-3.90%	0.97%	0.75%	-0.01%
过去六个月	-1.22%	0.84%	-1.87%	0.85%	0.65%	-0.01%
过去一年	0.31%	0.84%	0.29%	0.86%	0.02%	-0.02%
自基金合同生效日起至今（2015年01月20日-2017年06月30日）	-0.08%	2.15%	16.21%	2.09%	-16.29%	0.06%

注：本基金投资组合的业绩比较基准为：中证500指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。中证500指数扣除了沪深300指数样本股及最近一年日均总市值排名前300名的股票，再按照最近

一年（新股为上市以来）的日均成交金额由高到低排名，剔除排名后20%的股票，然后将剩余股票按照日均总市值由高到低进行排名，选取排名在前500名的股票作为该指数样本股。该指数综合反映了沪深证券市场内小市值公司的整体状况，并能够作为投资业绩的评价标准，为指数化投资和指数衍生产品创新提供基础条件。本基金投资于股票的资产比例不低于基金资产的90%，投资于中证500指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的80%；本基金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，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。

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



注：1、本基金合同于2015年1月20日生效。

2、本报告期内，本基金的各项投资比例达到基金合同约定的各项比例要求。

§ 4 管理人报告

4.1 基金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、天津设有分公司。公司股权结构为：

股东名称	股权比例
浙江蚂蚁小微金融服务集团股份有限公司	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2017年6月30日，本基金管理人共管理54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、天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金、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、天弘安康养老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）、天弘瑞利分级债券型证券投资基金、天弘沪深300指数型发起式证券投资基金、天弘中证500指数型发起式证券投资基金、天弘增益宝货币市场基金、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、天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金、天弘中证医药100指数型发起式证券投资基金、天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金、天弘中证全指运输指数型发起式证券投资基金、天弘中证移动互联网指数型发起式证券投资基金、天弘中证证券保险指数型发起式证券投资基金、天弘中证银行指数型发起式证券投资基金、天弘创业板指数型发起式证券投资基金、天弘中证高端装备制造指数型发起式证券投资基金、天弘上证50指数型发起式证券投资基金、天弘中证100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、天弘中证环保产业指数型发起式证券投资基金、天弘中证电子指数型发起式证券投资基金、天弘中证休闲娱乐指数型发起式证券投资基金、天弘中证计算机指数型发起式证券投资基金、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、天弘乐享保本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、天弘安盈灵活配置混合型证券投资基金、天弘喜利灵活配置混合型证券投资基金、天弘信利债券型证券投资基金、天弘聚利灵活配置混合型证券投资基金、天弘金利灵活配置混合型证券投资基金、天弘金明灵活配置混合型证券投资基金、天弘天盈灵活配置混合型证券投资基金、天弘策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金。

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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘冬	本基金基金经理。	2016年2月	2017年4月	11年	男，经济学硕士。2007年7月至2008年10月在长江证券股份有限公司研究部任宏观策略研究员。2008年11月加盟本公司，历任本公司投资部固定收益研究员、宏观策略研究员、基金经理助理等。
张子法	本基金基金经理。	2017年4月	—	15年	男，软件工程硕士。历任华夏基金管理有限公司金融工程师量化研究员。2014年3月加盟天弘，历任股票研究员、基金经理助理。

注：1、上述任职日期为本基金管理人对外披露的任职日期。

2、上述离任日期为本基金管理人对外披露的离任日期。

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

为规范投资行为，公平对待投资组合，制定《异常交易监控和报告办法》对可能显著影响市场价格、可能导致不公平交易、可能涉嫌利益输送等交易行为异常和交易价格异常的情形进行界定，拟定相应的监控、分析和防控措施。

本报告期内，严格控制同一基金或不同基金组合之间的同日反向交易，严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易；针对非公开发行股票申购、以公司名义进行的债券一级市场申购的申购方案和分配过程进行审核和监控，保证分配结果符合公平交易原则。未发现本基金存在异常交易行为。

本基金本报告期内未发生同一基金或不同基金组合之间在同一交易日内进行反向交易及其他可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

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，本基金在运作过程中严格遵守基金合同，坚持既定的指数化投资策略，对指数基金操作采取被动复制与组合优化相结合的方式。

本基金跟踪误差的来源主要是申购赎回与成分股停牌因素，当由于申赎变动、指数成分股权重调整等原因引发组合调整时，在操作过程中坚守合规第一、风控第一的前提下，结合市场趋势预判与量化分析，应用指数复制和其他合理方法优化组合结构。在遇到巨额资金在途不可用等特殊情形时会适当配置中证500股指期货加以套保，最大限度降低冲击成本和减少跟踪误差，力争投资回报与所跟踪指数保持一致，努力为投资者提供一个良好的指数投资工具。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2017年6月30日，本基金份额净值为0.9992元，本报告期份额净值增长率-1.22%，同期业绩比较基准增长率-1.87%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年，按照全国金融工作会议的精神，经济去杠杆特别是国有企业去杠杆将被作为重点工作，在非金融企业债务偏高，楼市整体仍属偏热的情况下，货币政策预计会保持稳健，短期内难再宽松。再加上固定资产投资，工业生产和PPP在二季度出现了放缓，企业盈利增长的放缓压力可能会逐步显现，市场出现整体性机会的要素尚不充分。但市场上也有不少积极因素，6月底MSCI宣布纳入A股将为股市注入新的资金和活力，政治局会议要求实施好积极的财政政策，结构性减税政策的持续落实也将减轻企业税负，十九大的召开又将释放改革开放想象空间，故市场大概率还是以结构性机会为主。

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估值业务的高级管理人员、督察长、研究总监及监察稽核部负责人组成。

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、风险管理人员、监察稽核人员及基金运营人员组成。

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银行和会计师事务所。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定与估值相关的定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，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

本报告期内，国泰君安证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在天弘中证500指数型发起式证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告（注：财务会计报告中的“金融工具风险及管理”部分未在托管人复核范围内）、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：天弘中证500指数型发起式证券投资基金

报告截止日：2017年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	25,539,906.63	25,340,482.06
结算备付金		11,340,185.86	10,539,913.07
存出保证金		8,566,321.47	2,179,983.83
交易性金融资产	6.4.7.2	581,538,555.19	560,852,589.94
其中：股票投资		581,538,555.19	560,852,589.94
基金投资		—	—

债券投资		—	—
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	14,252.39	15,977.69
应收股利		—	—
应收申购款		70,804,826.50	2,530,831.87
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.6	—	—
资产总计		697,804,048.04	601,459,778.46
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017年6月30日	上年度末 2016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		1,485,363.25	297,071.35
应付赎回款		9,159,968.93	5,399,277.25
应付管理人报酬		256,944.36	247,963.75
应付托管费		51,388.88	49,592.75
应付销售服务费		—	—
应付交易费用	6.4.7.7	126,203.20	242,577.43
应交税费		—	—
应付利息		—	—
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	6.4.7.8	287,453.56	405,637.50
负债合计		11,367,322.18	6,642,120.03

所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	686,989,277.98	588,058,121.23
未分配利润	6.4.7.10	-552,552.12	6,759,537.20
所有者权益合计		686,436,725.86	594,817,658.43
负债和所有者权益总计		697,804,048.04	601,459,778.46

注：报告截止日2017年6月30日，基金份额净值0.9992元，基金份额总额686,989,277.98份。

6.2 利润表

会计主体：天弘中证500指数型发起式证券投资基金

本报告期：2017年1月1日至2017年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2017年1月1日至2017年6月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6月30日
一、收入		-5,945,515.61	-96,392,269.06
1. 利息收入		319,939.68	461,522.92
其中：存款利息收入	6.4.7.11	319,939.68	461,522.92
债券利息收入		—	—
资产支持证券利息收入		—	—
买入返售金融资产收入		—	—
其他利息收入		—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）		-6,880,437.12	-78,889,594.56
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-8,289,119.76	-81,930,467.76
基金投资收益		—	—
债券投资收益	6.4.7.13	—	—
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.2	—	—
贵金属投资收益	6.4.7.14	—	—
衍生工具收益	6.4.7.15	-1,962,440.00	-839,440.00

股利收益	6.4.7.16	3,371,122.64	3,880,313.20
3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	6.4.7.17	614,981.83	-17,964,197.42
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	—	—
减：二、费用		2,845,664.87	3,298,953.01
1. 管理人报酬		1,530,717.69	1,715,978.48
2. 托管费		306,143.57	343,195.71
3. 销售服务费		—	—
4. 交易费用	6.4.7.19	764,592.94	1,002,398.43
5. 利息支出		—	—
其中：卖出回购金融资产支出		—	—
6. 其他费用	6.4.7.20	244,210.67	237,380.39
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-8,791,180.48	-99,691,222.07
减：所得税费用		—	—
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-8,791,180.48	-99,691,222.07

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：天弘中证500指数型发起式证券投资基金

本报告期：2017年1月1日至2017年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6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)	588,058,121.23	6,759,537.20	594,817,658.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	-8,791,180.48	-8,791,180.48

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)	98,931,156.75	1,479,091.16	100,410,247.91
其中：1. 基金申购款	1,065,004,221.44	13,322,217.29	1,078,326,438.73
2. 基金赎回款	-966,073,064.69	-11,843,126.13	-977,916,190.82
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)	686,989,277.98	-552,552.12	686,436,725.86
项 目	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6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)	541,157,410.82	113,757,974.26	654,915,385.08
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	-99,691,222.07	-99,691,222.07
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)	189,775,290.78	-16,907,285.18	172,868,005.60
其中：1. 基金申购款	1,746,914,545.52	-70,293,837.54	1,676,620,707.98
2. 基金赎回款	-1,557,139,254.74	53,386,552.36	-1,503,752,702.38
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)	730,932,701.60	-2,840,532.99	728,092,168.61

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

韩海潮

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指数型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2015]1364号《关于准予天弘中证500指数型发起式证券投资基金注册的批复》核准，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500指数型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次募集期间为2015年1月19日，首次设立募集不包括认购资金利息共募集10,000,000.00元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第010号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《天弘中证500指数型发起式证券投资基金基金合同》于2015年1月20日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为10,000,000.00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，基金托管人为国泰君安证券股份有限公司。

本基金为发起式基金，基金募集份额总额不少于1,000万份，基金募集金额不少于1,000万元，其中基金管理人作为发起资金的提供方认购的金额为1,000万元且承诺持有期限不少于三年。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘中证500指数型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，以中证500指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于其他股票（非标的指数成份股及其备选成份股，含中小板、创业板及其他经中国证监会核准的上市股票）、银行存款、债券、债券回购、权证、股指期货、资产支持证券、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金投资于股票的资产比例不低于基金资产的90%，投资于中证500指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的80%；本基金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，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准：中证500指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×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〈年度报告和半年度报告〉》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《天弘精选混合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发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2017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2017年6月30日的财务状况以及2017上半年度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[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于2016年5月1日前，以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。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。

(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。

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 2017年6月30日
活期存款	25,539,906.63
定期存款	—
其中：存款期限1-3个月	—
其他存款	—
合计	25,539,906.63

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	597,950,301.72	581,538,555.19	-16,411,746.53
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	597,950,301.72	581,538,555.19	-16,411,746.53

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

本基金本期末未持有因买断式逆回购而取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应收活期存款利息	8,786.93
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	5,186.36
应收债券利息	—
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	—
其他	279.10
合计	14,252.39

6.4.7.6 其他资产

本基金本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 2017年6月30日
交易所市场应付交易费用	126,203.20
银行间市场应付交易费用	—
合计	126,203.20

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年6月30日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	4,579.53
预提费用	251,981.95
其他应付	30,892.08
合计	287,453.56

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2017年1月1日至2017年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	588,058,121.23	588,058,121.23
本期申购	1,065,004,221.44	1,065,004,221.44
本期赎回（以“-”号填列）	-966,073,064.69	-966,073,064.69
本期末	686,989,277.98	686,989,277.98

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

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	-185,055,961.88	191,815,499.08	6,759,537.20
本期利润	-9,406,162.31	614,981.83	-8,791,180.48
本期基金份额交易产生的变动数	-31,592,979.53	33,072,070.69	1,479,091.16
其中：基金申购款	-342,624,183.90	355,946,401.19	13,322,217.29
基金赎回款	311,031,204.37	-322,874,330.50	-11,843,126.13
本期已分配利润	—	—	—
本期末	-226,055,103.72	225,502,551.60	-552,552.12

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2017年1月1日至2017年6月30日
活期存款利息收入	213,102.99
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	95,607.50
其他	11,229.19
合计	319,939.68

6.4.7.12 股票投资收益

6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资收益——买卖股票差价收入	-8,289,119.76
股票投资收益——赎回差价收入	—
合计	-8,289,119.76

6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
卖出股票成交总额	456,808,145.88
减：卖出股票成本总额	465,097,265.64
买卖股票差价收入	-8,289,119.76

6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期未取得债券投资收益。

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

本基金本报告期无买卖权证差价收入。

6.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2017年1月1日至2017年6月30日
股指期货投资收益	-1,962,440.00

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
股票投资产生的股利收益	3,371,122.64
基金投资产生的股利收益	—
合计	3,371,122.64

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
1. 交易性金融资产	402,101.83
——股票投资	402,101.83
——债券投资	—
——资产支持证券投资	—
——基金投资	0
——贵金属投资	—
——其他	—
2. 衍生工具	212,880.00
——权证投资	—
3. 其他	—
合计	614,981.83

6.4.7.18 其他收入

本基金本报告期内无其他收入。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
交易所市场交易费用	764,592.94
银行间市场交易费用	—
合计	764,592.94

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年6月30日
审计费用	34,216.24
信息披露费	148,765.71
指数使用费	61,228.72
合计	244,210.67

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

国泰君安证券股份有限公司(“国泰君安证券”)	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 2017年1月1日至2017年6月30日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6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
国泰君安证券股份有限公司	941,158,549.46	100.00%	1,330,990,808.60	100.00%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内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 2017年1月1日至2017年6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
国泰君安证券股份有限公司	217,687.68	100.00%	126,203.20	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6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
国泰君安证券股份有限公司	307,863.70	100.00%	237,024.04	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 2017年1月1日至2017年6 月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6 月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,530,717.69	1,715,978.48
其中：支付销售机构的客户维护费	261,784.54	202,803.75

注：1、支付基金管理人天弘基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值0.5%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×0.5%/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 2017年1月1日至2017年6 月30日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年6 月30日
当期发生的基金应支付的托管费	306,143.57	343,195.71

注：支付基金托管人国泰君安证券股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值0.1%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×0.1%/当年天数。

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 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2017年1月1日至2017年6月30日	2016年1月1日至2016年6月30日
期初持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
期间申购/买入总份额	—	—
期间因拆分变动份额	—	—
减：期间赎回/卖出总份额	—	—
期末持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.46%	1.37%

注：期间申购/买入总份额含转换转入份额，期间赎回/卖出总份额含转换转出份额。

6.4.10.4.2 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。

6.4.10.5 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		上年度可比期间	
	2017年1月1日至2017年6月30日		2016年1月1日至2016年6月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
国泰君安证券活期存款	25,539,906.63	213,102.99	29,634,663.64	419,117.14

注：本基金的银行存款存放在具有基金托管资格的中国工商银行股份有限公司，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

6.4.12 期末（2017年6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	期末成本总额	期末估值总额
603305	旭升股份	2017-06-30	2017-07-10	新股尚未上市流通	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26
603331	百达精工	2017-06-27	2017-07-05	新股尚未上市流通	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37
603617	君禾股份	2017-06-23	2017-07-03	新股尚未上市流通	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76
603933	睿能科技	2017-06-28	2017-07-06	新股尚未上市流通	20.2	20.2	857	17,311.4	17,311.4
002879	长缆科技	2017-06-05	2017-07-07	新股尚未上市流通	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26
002882	金龙羽	2017-06-15	2017-07-17	新股尚未上市流通	6.2	6.2	2,966	18,389.2	18,389.2
300670	大烨智能	2017-06-26	2017-07-03	新股尚未上市流通	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87
300671	富满电子	2017-06-27	2017-07-05	新股尚未上市流通	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62
300672	国科微	2017-06-30	2017-07-12	新股尚未上市流通	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36

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	期末成本总额	期末估值总额
600468	百利电气	2017-05-16	重大资产重组	6.50		—	52,620	451,330.52	342,030.00
600277	亿利洁能	2017-03-06	重大资产重组	7.83		—	123,146	814,216.65	964,233.18
600289	亿阳信通	2017-05-10	重要事项未公告	10.94	2017-08-18	12.03	68,700	917,648.23	751,578.00
600460	士兰微	2017-05-12	重大资产重组	6.07	2017-08-15	6.68	118,460	764,424.95	719,052.20
60054	新疆	2017-	重要事项	11.96	2017-	12.44	81,50	956,114.3	974,740.0

5	城建	06-22	未公告		07-03		0	6	0
600643	爱建集团	2017-04-17	重大资产重组	14.98	2017-08-02	16.48	169,820	2,120,610.38	2,543,903.60
600655	豫园商城	2016-12-20	重大资产重组	11.32		—	142,029	1,694,510.09	1,607,768.28
600657	信达地产	2017-02-20	重大资产重组	5.76	2017-08-10	6.19	102,500	622,999.65	590,400.00
600673	东阳光科	2016-11-15	重大资产重组	7.29		—	225,700	1,524,532.68	1,645,353.00
601001	大同煤业	2017-06-22	重要事项未公告	5.25	2017-07-21	5.78	126,006	789,816.59	661,531.50
601717	郑煤机	2017-04-24	重大资产重组	7.79		—	124,556	898,054.68	970,291.24
000693	*ST华泽	2016-03-01	重大事项	12.50		—	49,788	1,135,492.48	622,350.00
002025	航天电器	2016-09-12	重大事项	24.95	2017-07-04	22.46	36,546	851,088.74	911,822.70
002168	深圳惠程	2017-01-23	重大资产重组	16.99		—	117,700	1,647,019.25	1,999,723.00
002399	海普瑞	2017-04-28	重大事项	20.23		—	56,020	1,074,183.53	1,133,284.60
000061	农产品	2017-06-28	重大事项	9.06		—	93,600	842,173.84	848,016.00
000099	中信海直	2017-05-04	重大资产重组	11.26		—	64,269	803,694.79	723,668.94
000656	金科股份	2017-05-05	重大资产重组	6.54	2017-07-05	5.92	567,204	3,088,981.79	3,709,514.16
002013	中航机电	2017-05-12	重大事项	10.33	2017-08-02	11.36	152,379	1,730,092.46	1,574,075.07
002122	天马股份	2017-04-24	重大资产重组	10.30	2017-07-24	11.15	84,000	810,499.69	865,200.00
002127	南极电商	2017-06-29	重大事项	12.08	2017-07-06	12.61	106,100	1,311,631.37	1,281,688.00
002128	露天煤业	2017-03-17	重大资产重组	8.70	2017-08-14	9.57	98,285	834,187.24	855,079.50
002358	森源电气	2017-05-12	重大资产重组	17.02	2017-07-12	16.68	58,904	1,106,623.28	1,002,546.08
002505	大康农业	2017-03-13	重大资产重组	3.50		—	244,300	868,471.97	855,050.00
002642	荣之联	2017-04-10	重大事项	25.06	2017-07-07	22.54	30,835	773,321.42	772,725.10
002681	奋达科技	2017-06-22	重大事项	12.59	2017-07-03	12.70	56,360	802,367.74	709,572.40

300088	长信科技	2016-09-12	重大资产重组	15.75	2017-08-09	14.50	113,900	1,541,769.01	1,793,925.00
300134	大富科技	2017-02-09	重大资产重组	23.36		—	55,990	1,555,904.28	1,307,926.40
300291	华录百纳	2017-04-18	重大资产重组	20.02		—	43,201	1,009,106.84	864,884.02

注：本基金截至2017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2017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2017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。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为指数型基金，采用指数复制投资策略，标的指数为中证500指数，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争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现与跟踪指数相同的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，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、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，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，主要负责根据公司总体风险控制目标，将交易、运营风险控制目标和要求分配到各部门；讨论、协调各部门之间的风险管理过程；听取各部门风险管理工作方面的汇报，确定未来一段时间各部门应重点关

注的风险点，并调整与改进相关的风险处理和控制策略；讨论向公司高级管理层提交的基金运作风险报告。在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部负责，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；监察稽核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、风险的计量和控制。

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。本基金的银行存款存放在具有基金托管资格的中国工商银行股份有限公司，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。

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。

于2017年6月30日，本基金无债券投资(2016年6月30日：同)。

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上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。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于同一机构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同一机构发行的具有投票权的证券不得超过该类证券发行总量的10%。本基金所持全部证券均在证券交易所上市，除附注6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。

于2017年6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。

6.4.13.4 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、结算备付金及存出保证金等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末 2017年6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	25,539,906 .63	—	—	—	25,539,906 .63
结算备付金	11,340,185 .86	—	—	—	11,340,185 .86

存出保证金	8,566,321.47	—	—	—	8,566,321.47
交易性金融资产	—	—	—	581,538,555.19	581,538,555.19
应收利息	—	—	—	14,252.39	14,252.39
应收申购款	—	—	—	70,804,826.50	70,804,826.50
资产总计	45,446,413.96	—	—	652,357,634.08	697,804,048.04
负债					
应付证券清算款	—	—	—	1,485,363.25	1,485,363.25
应付赎回款	—	—	—	9,159,968.93	9,159,968.93
应付管理人报酬	—	—	—	256,944.36	256,944.36
应付托管费	—	—	—	51,388.88	51,388.88
应付交易费用	—	—	—	126,203.20	126,203.20
其他负债	—	—	—	287,453.56	287,453.56
负债总计	—	—	—	11,367,322.18	11,367,322.18
利率敏感度缺口	45,446,413.96	—	—	640,990,311.90	686,436,725.86
上年度末 2016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	25,340,482.06	—	—	—	25,340,482.06
结算备付金	10,539,913.07	—	—	—	10,539,913.07
存出保证金	2,179,983.	—	—	—	2,179,983.

	83				83
交易性金融资产	—	—	—	560,852,589.94	560,852,589.94
应收利息	—	—	—	15,977.69	15,977.69
应收申购款	—	—	—	2,530,831.87	2,530,831.87
资产总计	38,060,378.96	—	—	563,399,399.50	601,459,778.46
负债					
应付证券清算款	—	—	—	297,071.35	297,071.35
应付赎回款	—	—	—	5,399,277.25	5,399,277.25
应付管理人报酬	—	—	—	247,963.75	247,963.75
应付托管费	—	—	—	49,592.75	49,592.75
应付交易费用	—	—	—	242,577.43	242,577.43
其他负债	—	—	—	405,637.50	405,637.50
负债总计	—	—	—	6,642,120.03	6,642,120.03
利率敏感度缺口	38,060,378.96	—	—	556,757,279.47	594,817,658.43

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，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2017年6月30日，本基金未持有交易性债券投资(2016年6月30日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2016年6月30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或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金采用完全复制法进行指数化投资，股票资产跟踪的标的指数为中证500指数，通过指数化分散投资降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

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 2017年6月30日		上年度末 2016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	581,538,555.19	84.72	560,852,589.94	94.29
交易性金融资产-基金投资	—	—	—	—
衍生金融资产-权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	581,538,555.19	84.72	560,852,589.94	94.29

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(附注6.4.1)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 2017年6月30日	上年度末 2016年12月31日
	1. 业绩比较基准(附注6.4.1)上升5%	33,718,530.49	30,055,095.35

	2. 业绩比较基准(附注 6. 4. 1) 下降5%	-33, 718, 530. 49	-30, 055, 095. 35
--	-------------------------------	-------------------	-------------------

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2017年6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547, 812, 940. 12元，属于第二层次的余额为33, 725, 615. 07元，无属于第三层次的余额。（2016年12月31日：第一层次518, 019, 655. 97元，第二层次42, 832, 933. 97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

对于证券交易所上市的股票，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2017年6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(2016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) 增值税

根据财政部、国家税务总局于2016年12月21日颁布的财税[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》的规定：(1) 金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益)，不征收增值税；(2) 纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；(3) 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。上述政策自2016年5月1日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于2017年1月6日颁布的财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及2017年6月30日颁布的财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，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。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

§ 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（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	581,538,555.19	83.34
	其中：股票	581,538,555.19	83.34
2	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
3	贵金属投资	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—

6	银行存款和结算备付金合计	36,880,092.49	5.29
7	其他资产	79,385,400.36	11.38
8	合计	697,804,048.04	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股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	7,194,669.67	1.05
B	采矿业	18,446,211.00	2.69
C	制造业	358,101,050.52	52.17
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	19,808,378.90	2.89
E	建筑业	13,281,548.45	1.93
F	批发和零售业	30,383,246.10	4.43
G	交通运输、仓储和邮政业	15,595,293.93	2.27
H	住宿和餐饮业	607,040.00	0.09
I	信息传输、软件和信息技术服务业	39,440,499.50	5.75
J	金融业	8,076,595.30	1.18
K	房地产业	36,253,699.67	5.28
L	租赁和商务服务业	10,809,883.93	1.57
M	科学研究和技术服务业	1,425,899.33	0.21
N	水利、环境和公共设施管理业	5,085,922.74	0.74
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	661,696.77	0.10
Q	卫生和社会工作	1,508,821.60	0.22
R	文化、体育和娱乐业	6,659,577.69	0.97
S	综合	2,672,629.80	0.39
	合计	576,012,664.90	83.91

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	622,350.00	0.09
C	制造业	4,793,007.18	0.70
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	7,639.62	—
J	金融业	102,893.49	0.01
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	5,525,890.29	0.81

注：由于指数成份股调整，上表所列示股票中，百利电气(证券代码：600468)、*ST华泽(证券代码：000693)、航天电器(证券代码：002025)、深圳惠程(证券代码：002168)、海普瑞(证券代码：002399)被调出成份股后停牌，故以积极投资股票列示(下同)。

7.3 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

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	300136	信维通信	110,000	4,402,200.00	0.64

2	000656	金科股份	567,204	3,709,514.16	0.54
3	600487	亨通光电	126,348	3,544,061.40	0.52
4	002460	赣锋锂业	76,500	3,538,125.00	0.52
5	002572	索菲亚	80,490	3,300,090.00	0.48
6	600201	生物股份	89,162	3,171,492.34	0.46
7	601012	隆基股份	173,994	2,975,297.40	0.43
8	300156	神雾环保	88,006	2,883,076.56	0.42
9	002271	东方雨虹	77,046	2,858,406.60	0.42
10	600219	南山铝业	809,000	2,742,510.00	0.40
11	600176	中国巨石	244,823	2,688,156.54	0.39
12	600525	长园集团	193,197	2,625,547.23	0.38
13	002405	四维图新	131,688	2,602,154.88	0.38
14	600079	人福医药	130,878	2,567,826.36	0.37
15	600315	上海家化	79,000	2,563,550.00	0.37
16	000661	长春高新	19,814	2,558,185.54	0.37
17	600643	爱建集团	169,820	2,543,903.60	0.37
18	603799	华友钴业	41,500	2,522,370.00	0.37
19	000050	深天马A	117,500	2,416,975.00	0.35
20	600642	申能股份	381,900	2,405,970.00	0.35
21	002092	中泰化学	188,821	2,398,026.70	0.35
22	002340	格林美	388,144	2,348,271.20	0.34
23	000998	隆平高科	105,440	2,321,788.80	0.34
24	000066	中国长城	256,985	2,315,434.85	0.34
25	300115	长盈精密	78,676	2,295,765.68	0.33
26	300266	兴源环境	74,500	2,288,640.00	0.33
27	300296	利亚德	119,405	2,244,814.00	0.33
28	600584	长电科技	138,291	2,219,570.55	0.32
29	000997	新大陆	96,190	2,182,551.10	0.32
30	600516	方大炭素	149,900	2,131,578.00	0.31
31	601168	西部矿业	276,600	2,127,054.00	0.31
32	600879	航天电子	239,300	2,103,447.00	0.31

33	002422	科伦药业	126,696	2,093,017.92	0.30
34	000786	北新建材	129,900	2,057,616.00	0.30
35	002050	三花智控	125,901	2,054,704.32	0.30
36	600056	中国医药	78,300	2,031,885.00	0.30
37	600291	西水股份	91,800	2,019,600.00	0.29
38	600266	北京城建	136,700	1,987,618.00	0.29
39	600325	华发股份	237,246	1,981,004.10	0.29
40	600426	华鲁恒升	166,219	1,951,411.06	0.28
41	600388	龙净环保	125,400	1,947,462.00	0.28
42	002407	多氟多	87,900	1,932,921.00	0.28
43	600521	华海药业	91,686	1,929,073.44	0.28
44	600166	福田汽车	678,499	1,926,937.16	0.28
45	000039	中集集团	105,900	1,909,377.00	0.28
46	600161	天坛生物	49,099	1,905,532.19	0.28
47	600022	山东钢铁	918,430	1,891,965.80	0.28
48	000581	威孚高科	73,001	1,890,725.90	0.28
49	600839	四川长虹	516,500	1,869,730.00	0.27
50	000778	新兴铸管	279,000	1,869,300.00	0.27
51	600528	中铁工业	129,140	1,845,410.60	0.27
52	002410	广联达	97,518	1,833,338.40	0.27
53	000970	中科三环	124,000	1,832,720.00	0.27
54	000999	华润三九	57,400	1,822,450.00	0.27
55	300088	长信科技	113,900	1,793,925.00	0.26
56	002179	中航光电	57,428	1,791,179.32	0.26
57	600435	北方导航	124,944	1,787,948.64	0.26
58	002366	台海核电	38,112	1,787,833.92	0.26
59	600699	均胜电子	55,702	1,787,477.18	0.26
60	600138	中青旅	84,864	1,787,235.84	0.26
61	000028	国药一致	21,811	1,764,509.90	0.26
62	002038	双鹭药业	60,191	1,754,567.65	0.26
63	600978	宜华生活	174,000	1,748,700.00	0.25

64	002573	清新环境	92,905	1,748,472.10	0.25
65	002223	鱼跃医疗	73,490	1,740,243.20	0.25
66	002217	合力泰	175,002	1,729,019.76	0.25
67	601000	唐山港	331,180	1,728,759.60	0.25
68	600600	青岛啤酒	48,621	1,706,597.10	0.25
69	603589	口子窖	43,905	1,703,074.95	0.25
70	600158	中体产业	98,942	1,691,908.20	0.25
71	600614	鹏起科技	153,700	1,690,700.00	0.25
72	002311	海大集团	92,031	1,681,406.37	0.24
73	000488	晨鸣纸业	129,438	1,669,750.20	0.24
74	300383	光环新网	121,400	1,646,184.00	0.24
75	600673	东阳光科	225,700	1,645,353.00	0.24
76	300113	顺网科技	60,982	1,640,415.80	0.24
77	002004	华邦健康	208,890	1,635,608.70	0.24
78	300055	万邦达	88,800	1,633,920.00	0.24
79	000878	云南铜业	123,600	1,630,284.00	0.24
80	600511	国药股份	44,500	1,612,680.00	0.23
81	002030	达安基因	73,863	1,609,474.77	0.23
82	600503	华丽家族	232,900	1,609,339.00	0.23
83	600655	豫园商城	142,029	1,607,768.28	0.23
84	002273	水晶光电	77,740	1,603,776.20	0.23
85	300002	神州泰岳	191,900	1,600,446.00	0.23
86	600260	凯乐科技	62,701	1,588,843.34	0.23
87	000400	许继电气	88,000	1,580,480.00	0.23
88	002013	中航机电	152,379	1,574,075.07	0.23
89	002583	海能达	97,700	1,571,993.00	0.23
90	002078	太阳纸业	212,791	1,564,013.85	0.23
91	600298	安琪酵母	60,401	1,562,573.87	0.23
92	600755	厦门国贸	170,736	1,557,112.32	0.23
93	002384	东山精密	62,803	1,551,234.10	0.23
94	002001	新和成	79,800	1,548,918.00	0.23

95	600635	大众公用	283,897	1,547,238.65	0.23
96	600808	马钢股份	436,502	1,545,217.08	0.23
97	000566	海南海药	116,484	1,544,577.84	0.23
98	002019	亿帆医药	92,300	1,539,564.00	0.22
99	300324	旋极信息	84,226	1,536,282.24	0.22
100	600717	天津港	122,800	1,533,772.00	0.22
101	000547	航天发展	146,730	1,533,328.50	0.22
102	000930	中粮生化	141,300	1,523,214.00	0.22
103	000401	冀东水泥	98,781	1,520,239.59	0.22
104	603019	中科曙光	53,998	1,519,503.72	0.22
105	000418	小天鹅 A	32,337	1,513,048.23	0.22
106	300244	迪安诊断	47,960	1,508,821.60	0.22
107	002244	滨江集团	217,500	1,505,100.00	0.22
108	601231	环旭电子	95,700	1,503,447.00	0.22
109	600872	中炬高新	81,782	1,496,610.60	0.22
110	600392	盛和资源	113,250	1,493,767.50	0.22
111	600160	巨化股份	123,870	1,490,156.10	0.22
112	600122	宏图高科	134,172	1,489,309.20	0.22
113	002491	通鼎互联	109,970	1,477,996.80	0.22
114	000598	兴蓉环境	262,800	1,476,936.00	0.22
115	600633	浙数文化	76,303	1,474,173.96	0.21
116	600240	华业资本	162,200	1,469,532.00	0.21
117	002439	启明星辰	78,800	1,465,680.00	0.21
118	600418	江淮汽车	138,841	1,464,772.55	0.21
119	002176	江特电机	167,200	1,457,984.00	0.21
120	600062	华润双鹤	53,099	1,456,505.57	0.21
121	000960	锡业股份	106,900	1,454,909.00	0.21
122	600409	三友化工	144,300	1,453,101.00	0.21
123	600500	中化国际	151,300	1,446,428.00	0.21
124	000825	太钢不锈	331,042	1,440,032.70	0.21
125	300159	新研股份	108,599	1,437,850.76	0.21

126	002400	省广股份	178,967	1,437,105.01	0.21
127	600143	金发科技	236,864	1,428,289.92	0.21
128	002408	齐翔腾达	128,898	1,428,189.84	0.21
129	600594	益佰制药	92,903	1,417,699.78	0.21
130	300146	汤臣倍健	102,900	1,413,846.00	0.21
131	300058	蓝色光标	179,700	1,405,254.00	0.20
132	002601	龙麟佰利	85,300	1,397,214.00	0.20
133	000078	海王生物	231,250	1,394,437.50	0.20
134	000089	深圳机场	148,900	1,392,215.00	0.20
135	000513	丽珠集团	20,385	1,388,218.50	0.20
136	601699	潞安环能	175,280	1,370,689.60	0.20
137	000979	中弘股份	522,540	1,369,054.80	0.20
138	600312	平高电气	99,459	1,366,566.66	0.20
139	600811	东方集团	209,221	1,364,120.92	0.20
140	002354	天神娱乐	63,065	1,355,897.50	0.20
141	000685	中山公用	123,742	1,354,974.90	0.20
142	002051	中工国际	65,212	1,351,844.76	0.20
143	600967	内蒙一机	99,100	1,350,733.00	0.20
144	600884	杉杉股份	81,670	1,345,104.90	0.20
145	300122	智飞生物	70,300	1,343,433.00	0.20
146	000697	炼石有色	65,600	1,342,832.00	0.20
147	600970	中材国际	154,396	1,341,701.24	0.20
148	002431	棕榈股份	121,025	1,333,695.50	0.19
149	601880	大连港	449,603	1,330,824.88	0.19
150	002640	跨境通	62,600	1,330,250.00	0.19
151	600026	中远海能	200,334	1,328,214.42	0.19
152	000988	华工科技	90,801	1,324,786.59	0.19
153	000729	燕京啤酒	197,100	1,324,512.00	0.19
154	600499	科达洁能	165,640	1,315,181.60	0.19
155	002701	奥瑞金	205,315	1,311,962.85	0.19
156	300134	大富科技	55,990	1,307,926.40	0.19

157	600809	山西汾酒	37,700	1,307,813.00	0.19
158	600307	酒钢宏兴	457,800	1,304,730.00	0.19
159	600183	生益科技	105,585	1,302,918.90	0.19
160	000926	福星股份	106,200	1,295,640.00	0.19
161	000806	银河生物	95,800	1,293,300.00	0.19
162	000600	建投能源	105,100	1,289,577.00	0.19
163	600566	济川药业	33,900	1,289,217.00	0.19
164	600664	哈药股份	221,592	1,287,449.52	0.19
165	002048	宁波华翔	61,598	1,284,934.28	0.19
166	002221	东华能源	117,610	1,283,125.10	0.19
167	002127	南极电商	106,100	1,281,688.00	0.19
168	600120	浙江东方	47,503	1,276,880.64	0.19
169	600787	中储股份	161,299	1,275,875.09	0.19
170	000690	宝新能源	212,988	1,273,668.24	0.19
171	300253	卫宁健康	162,715	1,270,804.15	0.19
172	600863	内蒙华电	422,000	1,270,220.00	0.19
173	600094	大名城	165,400	1,268,618.00	0.18
174	002373	千方科技	92,602	1,263,091.28	0.18
175	600572	康恩贝	182,383	1,262,090.36	0.18
176	002665	首航节能	173,215	1,247,148.00	0.18
177	002390	信邦制药	143,050	1,245,965.50	0.18
178	000012	南玻A	133,500	1,245,555.00	0.18
179	002191	劲嘉股份	132,801	1,243,017.36	0.18
180	600874	创业环保	63,302	1,238,820.14	0.18
181	300026	红日药业	262,494	1,236,346.74	0.18
182	002512	达华智能	76,504	1,235,539.60	0.18
183	002635	安洁科技	34,042	1,233,001.24	0.18
184	002603	以岭药业	70,600	1,232,676.00	0.18
185	002028	思源电气	77,262	1,231,556.28	0.18
186	000667	美好置业	371,900	1,230,989.00	0.18
187	002444	巨星科技	78,840	1,228,327.20	0.18

188	000816	智慧农业	164,900	1,226,856.00	0.18
189	000006	深振业A	138,593	1,221,004.33	0.18
190	600478	科力远	141,450	1,217,884.50	0.18
191	000758	中色股份	173,112	1,213,515.12	0.18
192	600017	日照港	268,200	1,206,900.00	0.18
193	000975	银泰资源	95,184	1,202,173.92	0.18
194	600125	铁龙物流	134,000	1,200,640.00	0.17
195	600881	亚泰集团	235,998	1,198,869.84	0.17
196	600064	南京高科	79,269	1,196,961.90	0.17
197	600348	阳泉煤业	176,400	1,195,992.00	0.17
198	000592	平潭发展	216,138	1,193,081.76	0.17
199	000031	中粮地产	158,154	1,190,899.62	0.17
200	300166	东方国信	88,017	1,182,068.31	0.17
201	002672	东江环保	69,850	1,179,766.50	0.17
202	000158	常山股份	74,500	1,177,100.00	0.17
203	300001	特锐德	69,700	1,168,172.00	0.17
204	600565	迪马股份	211,700	1,166,467.00	0.17
205	002477	雏鹰农牧	263,077	1,165,431.11	0.17
206	000939	凯迪生态	228,476	1,165,227.60	0.17
207	000732	泰禾集团	69,600	1,160,928.00	0.17
208	000860	顺鑫农业	57,998	1,160,539.98	0.17
209	600198	大唐电信	90,503	1,155,723.31	0.17
210	002250	联化科技	80,800	1,155,440.00	0.17
211	600597	光明乳业	90,200	1,150,050.00	0.17
212	600410	华胜天成	129,580	1,148,078.80	0.17
213	002261	拓维信息	97,738	1,144,511.98	0.17
214	000877	天山股份	90,300	1,144,101.00	0.17
215	603077	和邦生物	224,500	1,142,705.00	0.17
216	300274	阳光电源	102,805	1,140,107.45	0.17
217	600416	湘电股份	83,200	1,139,840.00	0.17
218	600687	刚泰控股	87,300	1,124,424.00	0.16

219	000727	华东科技	397,300	1,124,359.00	0.16
220	000027	深圳能源	166,300	1,119,199.00	0.16
221	603766	隆鑫通用	153,500	1,117,480.00	0.16
222	000563	陕国投 A	216,100	1,117,237.00	0.16
223	002002	鸿达兴业	142,012	1,111,953.96	0.16
224	300287	飞利信	120,501	1,106,199.18	0.16
225	002353	杰瑞股份	69,600	1,101,072.00	0.16
226	002266	浙富控股	225,250	1,099,220.00	0.16
227	300116	坚瑞沃能	102,100	1,097,575.00	0.16
228	600039	四川路桥	263,277	1,095,232.32	0.16
229	601929	吉视传媒	316,400	1,094,744.00	0.16
230	002468	申通快递	42,800	1,087,548.00	0.16
231	002308	威创股份	82,869	1,081,440.45	0.16
232	600200	江苏吴中	81,899	1,081,066.80	0.16
233	600466	蓝光发展	125,100	1,079,613.00	0.16
234	600751	天海投资	188,706	1,073,737.14	0.16
235	601689	拓普集团	32,000	1,071,680.00	0.16
236	600282	南钢股份	288,637	1,070,843.27	0.16
237	600582	天地科技	231,500	1,062,585.00	0.15
238	300257	开山股份	50,301	1,060,345.08	0.15
239	600086	东方金钰	98,074	1,060,179.94	0.15
240	002517	恺英网络	30,100	1,059,219.00	0.15
241	600380	健康元	116,200	1,055,096.00	0.15
242	002375	亚厦股份	117,900	1,050,489.00	0.15
243	600557	康缘药业	63,220	1,050,084.20	0.15
244	601928	凤凰传媒	106,700	1,041,392.00	0.15
245	600151	航天机电	126,200	1,038,626.00	0.15
246	000830	鲁西化工	150,400	1,037,760.00	0.15
247	002022	科华生物	59,668	1,036,433.16	0.15
248	000519	中兵红箭	82,147	1,035,052.20	0.15
249	002268	卫士通	61,469	1,033,908.58	0.15

250	000501	鄂武商 A	55,914	1,032,172.44	0.15
251	300199	翰宇药业	67,274	1,031,983.16	0.15
252	002440	闰土股份	67,400	1,028,524.00	0.15
253	000712	锦龙股份	62,700	1,026,399.00	0.15
254	002544	杰赛科技	44,900	1,023,720.00	0.15
255	002396	星网锐捷	52,749	1,020,693.15	0.15
256	603000	人民网	77,300	1,018,041.00	0.15
257	002489	浙江永强	159,540	1,017,865.20	0.15
258	002281	光迅科技	45,806	1,017,809.32	0.15
259	600316	洪都航空	63,101	1,014,033.07	0.15
260	600611	大众交通	183,400	1,012,368.00	0.15
261	002589	瑞康医药	65,520	1,009,008.00	0.15
262	600366	宁波韵升	57,191	1,008,849.24	0.15
263	600694	大商股份	25,837	1,006,867.89	0.15
264	600169	太原重工	260,772	1,006,579.92	0.15
265	000703	恒逸石化	70,621	1,005,643.04	0.15
266	600270	外运发展	53,102	1,005,220.86	0.15
267	002155	湖南黄金	104,904	1,003,931.28	0.15
268	002358	森源电气	58,904	1,002,546.08	0.15
269	600835	上海机电	47,244	998,738.16	0.15
270	002670	国盛金控	62,803	998,567.70	0.15
271	600759	洲际油气	164,425	996,415.50	0.15
272	002342	巨力索具	98,511	992,005.77	0.14
273	600267	海正药业	84,900	991,632.00	0.14
274	000528	柳 工	114,570	989,884.80	0.14
275	000612	焦作万方	122,345	984,877.25	0.14
276	300273	和佳股份	80,881	983,512.96	0.14
277	600563	法拉电子	19,803	978,466.23	0.14
278	600187	国中水务	193,700	978,185.00	0.14
279	600108	亚盛集团	226,300	975,353.00	0.14
280	600545	新疆城建	81,500	974,740.00	0.14

281	601717	郑煤机	124,556	970,291.24	0.14
282	600645	中源协和	45,251	969,728.93	0.14
283	600648	外高桥	52,200	966,744.00	0.14
284	000090	天健集团	86,960	965,256.00	0.14
285	600277	亿利洁能	123,146	964,233.18	0.14
286	002368	太极股份	34,801	963,639.69	0.14
287	600993	马应龙	44,180	962,240.40	0.14
288	600848	上海临港	44,500	959,420.00	0.14
289	600729	重庆百货	35,700	958,188.00	0.14
290	002503	搜于特	136,200	957,486.00	0.14
291	002657	中科金财	33,002	956,727.98	0.14
292	002285	世联行	118,888	953,481.76	0.14
293	000937	冀中能源	155,459	951,409.08	0.14
294	600098	广州发展	119,800	947,618.00	0.14
295	600765	中航重机	68,418	942,800.04	0.14
296	601678	滨化股份	135,187	939,549.65	0.14
297	002709	天赐材料	22,800	938,676.00	0.14
298	002437	誉衡药业	128,919	938,530.32	0.14
299	000049	德赛电池	18,040	934,652.40	0.14
300	002325	洪涛股份	127,630	931,699.00	0.14
301	000587	金洲慈航	62,300	928,270.00	0.14
302	000810	创维数字	75,802	919,478.26	0.13
303	000543	皖能电力	157,560	918,574.80	0.13
304	600073	上海梅林	96,118	917,926.90	0.13
305	000021	深科技	106,808	916,412.64	0.13
306	600750	江中药业	26,319	914,585.25	0.13
307	002018	华信国际	133,440	914,064.00	0.13
308	600422	昆药集团	80,202	909,490.68	0.13
309	002011	盾安环境	80,030	908,340.50	0.13
310	600300	维维股份	170,000	907,800.00	0.13
311	000669	金鸿能源	49,888	904,469.44	0.13

312	000829	天音控股	83,703	903,992.40	0.13
313	600639	浦东金桥	49,871	903,662.52	0.13
314	002056	横店东磁	119,360	895,200.00	0.13
315	000897	津滨发展	189,400	890,180.00	0.13
316	000777	中核科技	44,498	888,180.08	0.13
317	002242	九阳股份	44,997	885,090.99	0.13
318	002317	众生药业	71,028	882,167.76	0.13
319	601311	骆驼股份	62,204	880,808.64	0.13
320	300376	易事特	96,700	877,069.00	0.13
321	603188	亚邦股份	50,194	875,383.36	0.13
322	002249	大洋电机	132,500	871,850.00	0.13
323	600284	浦东建设	81,264	871,150.08	0.13
324	000636	风华高科	101,992	867,951.92	0.13
325	002122	天马股份	84,000	865,200.00	0.13
326	000572	海马汽车	167,300	864,941.00	0.13
327	300291	华录百纳	43,201	864,884.02	0.13
328	000766	通化金马	54,100	864,518.00	0.13
329	000848	承德露露	86,110	859,377.80	0.13
330	000596	古井贡酒	16,850	858,507.50	0.13
331	600770	综艺股份	114,375	857,812.50	0.12
332	000762	西藏矿业	60,525	857,639.25	0.12
333	600259	广晟有色	21,962	857,396.48	0.12
334	601016	节能风电	232,400	855,232.00	0.12
335	002128	露天煤业	98,285	855,079.50	0.12
336	002505	大康农业	244,300	855,050.00	0.12
337	600651	飞乐音响	100,728	853,166.16	0.12
338	603444	吉比特	3,000	849,990.00	0.12
339	600496	精工钢构	175,680	848,534.40	0.12
340	000061	农产品	93,600	848,016.00	0.12
341	000062	深圳华强	31,721	841,558.13	0.12
342	600587	新华医疗	47,300	840,994.00	0.12

343	600216	浙江医药	84,702	839,396.82	0.12
344	002106	莱宝高科	82,800	838,764.00	0.12
345	002254	泰和新材	62,696	833,856.80	0.12
346	600536	中国软件	43,517	833,785.72	0.12
347	002276	万马股份	82,602	833,454.18	0.12
348	300010	立思辰	63,911	827,647.45	0.12
349	002479	富春环保	69,400	825,860.00	0.12
350	002482	广田集团	90,950	817,640.50	0.12
351	002073	软控股份	96,240	816,115.20	0.12
352	002707	众信旅游	61,800	811,434.00	0.12
353	600171	上海贝岭	79,043	803,867.31	0.12
354	002123	梦网荣信	72,300	803,253.00	0.12
355	000652	泰达股份	150,300	796,590.00	0.12
356	000680	山推股份	145,300	791,885.00	0.12
357	002428	云南锗业	74,084	791,217.12	0.12
358	002064	华峰氨纶	164,100	790,962.00	0.12
359	000541	佛山照明	86,121	784,562.31	0.11
360	000620	新华联	110,318	784,360.98	0.11
361	600428	中远海特	125,900	783,098.00	0.11
362	600058	五矿发展	62,872	780,241.52	0.11
363	002463	沪电股份	170,538	775,947.90	0.11
364	000726	鲁泰A	65,300	774,458.00	0.11
365	002642	荣之联	30,835	772,725.10	0.11
366	600458	时代新材	67,341	771,054.45	0.11
367	002332	仙琚制药	89,650	770,990.00	0.11
368	001696	宗申动力	100,754	762,707.78	0.11
369	002690	美亚光电	39,590	759,336.20	0.11
370	603883	老百姓	15,608	759,329.20	0.11
371	600329	中新药业	41,683	754,879.13	0.11
372	300297	蓝盾股份	68,900	754,455.00	0.11
373	600289	亿阳信通	68,700	751,578.00	0.11

374	000969	安泰科技	86,084	751,513.32	0.11
375	600894	广日股份	63,086	746,938.24	0.11
376	600517	置信电气	98,460	745,342.20	0.11
377	601233	桐昆股份	53,655	743,658.30	0.11
378	600736	苏州高新	105,083	742,936.81	0.11
379	000426	兴业矿业	82,160	741,083.20	0.11
380	601777	力帆股份	92,103	740,508.12	0.11
381	600859	王府井	45,530	735,309.50	0.11
382	600805	悦达投资	99,830	733,750.50	0.11
383	600880	博瑞传播	112,100	732,013.00	0.11
384	600790	轻纺城	107,440	731,666.40	0.11
385	002063	远光软件	69,976	729,149.92	0.11
386	603369	今世缘	55,100	727,320.00	0.11
387	600586	金晶科技	148,600	726,654.00	0.11
388	600338	西藏珠峰	19,117	726,254.83	0.11
389	000099	中信海直	64,269	723,668.94	0.11
390	600460	士兰微	118,460	719,052.20	0.10
391	000616	海航投资	166,591	716,341.30	0.10
392	300043	星辉娱乐	87,000	714,270.00	0.10
393	002663	普邦股份	131,423	713,626.89	0.10
394	000552	靖远煤电	199,381	711,790.17	0.10
395	600395	盘江股份	97,100	711,743.00	0.10
396	600220	江苏阳光	207,300	711,039.00	0.10
397	600773	西藏城投	64,121	709,819.47	0.10
398	002681	奋达科技	56,360	709,572.40	0.10
399	600720	祁连山	90,300	707,049.00	0.10
400	603888	新华网	21,800	706,102.00	0.10
401	002727	一心堂	37,931	697,930.40	0.10
402	603556	海兴电力	15,900	697,851.00	0.10
403	601886	江河集团	67,680	693,720.00	0.10
404	300147	香雪制药	67,210	690,246.70	0.10

405	603355	莱克电气	11,712	688,314.24	0.10
406	002269	美邦服饰	184,250	687,252.50	0.10
407	600006	东风汽车	117,298	686,193.30	0.10
408	300039	上海凯宝	94,115	684,216.05	0.10
409	002041	登海种业	51,620	683,965.00	0.10
410	600801	华新水泥	71,300	679,489.00	0.10
411	002190	成飞集成	25,303	678,120.40	0.10
412	002005	德豪润达	142,000	677,340.00	0.10
413	603816	顾家家居	11,500	675,970.00	0.10
414	002345	潮宏基	61,906	672,918.22	0.10
415	603198	迎驾贡酒	35,117	668,276.51	0.10
416	600596	新安股份	78,992	667,482.40	0.10
417	300032	金龙机电	47,700	665,415.00	0.10
418	600053	九鼎投资	19,007	664,484.72	0.10
419	002277	友阿股份	102,906	663,743.70	0.10
420	603377	东方时尚	17,603	661,696.77	0.10
421	600280	中央商场	83,432	661,615.76	0.10
422	601001	大同煤业	126,006	661,531.50	0.10
423	000417	合肥百货	80,003	660,024.75	0.10
424	300202	聚龙股份	39,903	659,197.56	0.10
425	600757	长江传媒	88,130	658,331.10	0.10
426	600628	新世界	56,900	657,195.00	0.10
427	600869	智慧能源	97,600	656,848.00	0.10
428	002120	韵达股份	12,700	655,320.00	0.10
429	600059	古越龙山	70,475	651,893.75	0.09
430	600141	兴发集团	52,100	644,477.00	0.09
431	600580	卧龙电气	94,477	644,333.14	0.09
432	002371	北方华创	26,850	642,252.00	0.09
433	000681	视觉中国	40,751	638,160.66	0.09
434	002233	塔牌集团	52,000	632,840.00	0.09
435	600481	双良节能	118,796	630,806.76	0.09

436	002588	史丹利	80,900	622,121.00	0.09
437	002344	海宁皮城	74,476	619,640.32	0.09
438	600292	远达环保	57,199	616,605.22	0.09
439	002147	新光圆成	39,300	610,722.00	0.09
440	600195	中牧股份	31,374	608,341.86	0.09
441	600754	锦江股份	22,400	607,040.00	0.09
442	601002	晋亿实业	69,700	602,905.00	0.09
443	600537	亿晶光电	120,724	601,205.52	0.09
444	600971	恒源煤电	73,289	595,839.57	0.09
445	600640	号百控股	35,002	591,533.80	0.09
446	600657	信达地产	102,500	590,400.00	0.09
447	600862	中航高科	60,700	588,183.00	0.09
448	002309	中利集团	47,000	587,970.00	0.09
449	600748	上实发展	81,110	583,992.00	0.09
450	600743	华远地产	136,350	575,397.00	0.08
451	600826	兰生股份	30,603	553,914.30	0.08
452	002699	美盛文化	39,931	551,047.80	0.08
453	603169	兰石重装	45,001	546,762.15	0.08
454	600251	冠农股份	68,300	544,351.00	0.08
455	600335	国机汽车	44,799	535,796.04	0.08
456	600184	光电股份	28,463	533,965.88	0.08
457	600831	广电网络	52,700	524,365.00	0.08
458	600996	贵广网络	43,700	523,089.00	0.08
459	002551	尚荣医疗	32,427	523,047.51	0.08
460	002093	国脉科技	59,029	519,455.20	0.08
461	002392	北京利尔	87,104	516,526.72	0.08
462	002118	紫鑫药业	75,104	512,960.32	0.07
463	002414	高德红外	27,419	501,767.70	0.07
464	002416	爱施德	45,000	485,550.00	0.07
465	600776	东方通信	70,102	475,291.56	0.07
466	600551	时代出版	29,621	467,715.59	0.07

467	002251	步步高	37,748	467,697.72	0.07
468	603005	晶方科技	16,604	464,745.96	0.07
469	002646	青青稞酒	26,334	459,791.64	0.07
470	603698	航天工程	18,102	456,170.40	0.07
471	000536	华映科技	77,300	449,113.00	0.07
472	603001	奥康国际	23,451	440,644.29	0.06
473	000517	荣安地产	93,400	434,310.00	0.06
474	603868	飞科电器	7,002	433,003.68	0.06
475	603568	伟明环保	19,991	432,205.42	0.06
476	603567	珍宝岛	24,818	417,686.94	0.06
477	603328	依顿电子	29,104	411,821.60	0.06
478	000025	特力A	7,903	408,901.22	0.06
479	603528	多伦科技	27,215	391,079.55	0.06
480	600936	广西广电	46,700	376,869.00	0.05
481	603806	福斯特	11,705	374,677.05	0.05
482	600126	杭钢股份	54,500	373,870.00	0.05
483	002807	江阴银行	29,600	370,888.00	0.05
484	600618	氯碱化工	32,600	348,168.00	0.05
485	603228	景旺电子	7,100	342,575.00	0.05
486	002315	焦点科技	13,646	340,331.24	0.05
487	603515	欧普照明	9,300	335,916.00	0.05
488	601020	华钰矿业	14,700	323,841.00	0.05
489	603866	桃李面包	8,802	313,175.16	0.05
490	002194	武汉凡谷	33,027	292,288.95	0.04
491	603658	安图生物	6,100	262,910.00	0.04
492	002815	崇达技术	7,400	244,496.00	0.04
493	002818	富森美	6,100	240,767.00	0.04
494	600917	重庆燃气	25,091	236,608.13	0.03
495	603877	太平鸟	8,302	232,372.98	0.03
496	601811	新华文轩	14,901	231,859.56	0.03
497	000761	本钢板材	44,100	230,643.00	0.03

498	603569	长久物流	6,401	213,985.43	0.03
499	603025	大豪科技	7,213	190,423.20	0.03

7.3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	占基金资产净值比例（%）
1	002168	深圳惠程	117,700	1,999,723.00	0.29
2	002399	海普瑞	56,020	1,133,284.60	0.17
3	002025	航天电器	36,546	911,822.70	0.13
4	000693	*ST华泽	49,788	622,350.00	0.09
5	600468	百利电气	52,620	342,030.00	0.05
6	601878	浙商证券	6,049	102,893.49	0.01
7	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.01
8	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.01
9	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.01
10	603380	易德龙	1,298	35,370.50	0.01
11	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.00
12	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.00
13	002881	美格智能	989	22,608.54	0.00
14	603679	华体科技	809	21,438.50	0.00
15	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.00
16	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.00
17	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.00
18	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.00
19	300669	沪宁股份	841	14,650.22	0.00
20	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.00
21	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.00
22	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.00
23	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
24	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00

25	603617	君禾股份	832	7,429.76	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	300136	信维通信	2,900,831.57	0.49
2	600201	生物股份	2,643,024.00	0.44
3	000066	中国长城	2,534,598.57	0.43
4	002460	赣锋锂业	2,444,663.05	0.41
5	600079	人福医药	2,419,725.22	0.41
6	600642	申能股份	2,371,609.78	0.40
7	300156	神雾环保	2,352,770.97	0.40
8	600682	南京新百	2,244,846.92	0.38
9	000547	航天发展	2,232,900.00	0.38
10	600487	亨通光电	2,170,510.00	0.36
11	002405	四维图新	2,157,003.00	0.36
12	600522	中天科技	2,051,658.00	0.34
13	002572	索菲亚	2,048,795.98	0.34
14	002340	格林美	2,042,926.00	0.34
15	002092	中泰化学	2,035,053.00	0.34
16	600525	长园集团	2,012,947.00	0.34
17	000778	新兴铸管	1,994,097.00	0.34
18	603799	华友钴业	1,969,798.00	0.33
19	002407	多氟多	1,966,835.50	0.33
20	600219	南山铝业	1,924,461.00	0.32

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	600522	中天科技	5,122,063.42	0.86
2	002508	老板电器	4,896,756.51	0.82
3	600682	南京新百	4,878,028.65	0.82
4	600436	片仔癀	3,938,994.04	0.66
5	000959	首钢股份	3,029,507.10	0.51
6	002602	世纪华通	2,999,276.08	0.50
7	600497	驰宏锌锗	2,672,723.10	0.45
8	600201	生物股份	2,568,452.74	0.43
9	002460	赣锋锂业	2,440,487.03	0.41
10	600079	人福医药	2,349,441.62	0.39
11	000066	中国长城	2,344,713.27	0.39
12	300136	信维通信	2,339,338.01	0.39
13	300156	神雾环保	2,227,015.00	0.37
14	002595	豪迈科技	2,185,645.19	0.37
15	600487	亨通光电	2,147,688.00	0.36
16	600525	长园集团	2,114,359.00	0.36
17	000961	中南建设	2,085,605.91	0.35
18	600601	方正科技	2,083,266.56	0.35
19	600575	皖江物流	2,057,264.30	0.35
20	002572	索菲亚	2,043,493.59	0.34

注：本项“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

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	485,381,129.06
卖出股票的收入（成交）总额	456,808,145.88

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

7.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量（买/卖）	合约市值（元）	公允价值变动（元）	风险说明
IC1707	IC1707	31	37,838,600.00	212,880.00	买入股指期货多头合约的目的是进行更有效地流动性管理。
公允价值变动总额合计（元）					212,880.00
股指期货投资本期收益（元）					—
股指期货投资本期公允价值变动（元）					212,880.00

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

当基金遭遇代销渠道的大额申购时，导致下一个交易日基金组合的仓位被动降低，同时申购资金处于不可用状态，为了降低该交易日的跟踪风险，会利用原有现金头寸，适量配置股指期货充当仓位达到买入套保的功能，以降低当日的市场波动风险。当申购资金可用时，逐步买入指数成分股，平仓股指期货，用股票的实际仓位取代股指期货仓位，最后达到正常的股票仓位水平。

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 本报告编制日前一年内，在本基金投资的前十名证券发行主体中，金宇生物技术股份有限公司于2016年12月1日收到中国证监会派出机构的行政监管措施决定书。具体内容，敬请投资者参见上述公司的相关公告。

对该股票的投资决策程序说明：本基金为被动跟踪指数基金。根据本基金《基金合同》等相关规定，为更好地跟踪标的指数和控制跟踪误差，故按照成份股权重配置该证券，符合法律法规、基金合同和公司内部投资决策程序的相关规定。

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	8,566,321.47
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	14,252.39
5	应收申购款	70,804,826.50
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	79,385,400.36

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

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
	000656	金科股份	3,709,514.16	0.54	重大资产重组

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

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	002168	深圳惠程	1,999,723.00	0.29	重大资产重组
2	002399	海普瑞	1,133,284.60	0.17	重大事项
3	002025	航天电器	911,822.70	0.13	筹划重大事项
4	000693	*ST华泽	622,350.00	0.09	重大事项
5	600468	百利电气	342,030.00	0.05	重大资产重组

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

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
409,214	1,678.80	10,121,410.77	1.47%	676,867,867.21	98.53%

8.2 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	3,004,647.13	0.44%

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	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	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	0

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	1.46%	10,000,000.00	1.46%	三年
基金管理人高级管理人员	—	—	—	—	
基金经理等人员	—	—	—	—	
基金管理人股东	—	—	—	—	
其他	—	—	—	—	
合计	10,000,000.00	1.46%	10,000,000.00	1.46%	

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2015年1月20日)基金份额总额	10,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	588,058,121.23
本报告期基金总申购份额	1,065,004,221.44
减：本报告期基金总赎回份额	966,073,064.69
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	686,989,277.98

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，熊军先生已任职本公司副总经理职务，具体信息请参见基金管理人于2017年4月26日披露的《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，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

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比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安	2	941,158,549.46	100%	217,687.68	100%	—

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情况稳定；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：无。

4、本基金报告期内停止租用交易单元：无。

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降低	中国证监会指定媒介	2017-01-06

	旗下部分基金申购、赎回及最低持有份额等相关业务限额的公告		
2	天弘基金管理有限公司关于增加上海联泰资产管理有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投及转换业务以及参加其申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2017-01-12
3	天弘基金管理有限公司关于增加杭州科地瑞富基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投及转换业务以及参加其申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2017-01-18
4	天弘基金管理有限公司关于增加东海期货有限责任公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投及转换业务以及参加其申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2017-01-18
5	天弘中证500指数型发起式证券投资基金2016年第4季度报告	中国证监会指定媒介	2017-01-20
6	天弘中证500指数型发起式证券投资基金招募说明书（更新）摘要	中国证监会指定媒介	2017-03-03
7	天弘中证500指数型发起式证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会指定媒介	2017-03-03
8	天弘基金管理有限公司关于变更基金直销资金账户的公告	中国证监会指定媒介	2017-03-04
9	天弘基金管理有限公司关于增加上海朝阳永续基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回及转换业务以及参加其申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2017-03-14
10	天弘基金管理有限公司关于增加	中国证监会指定媒介	2017-03-23

	泰诚财富基金销售（大连）有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投及转换业务以及参加其申购费率优惠活动的公告		
11	天弘基金管理有限公司关于增加北京肯特瑞财富投资管理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相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2017-03-29
12	天弘中证500指数型发起式证券投资基金2016年年度报告	中国证监会指定媒介	2017-03-30
13	天弘中证500指数型发起式证券投资基金2016年年度报告摘要	中国证监会指定媒介	2017-03-30
14	天弘基金管理有限公司关于调整天弘中证500指数型发起式证券投资基金基金经理的公告	中国证监会指定媒介	2017-04-17
15	天弘中证500指数型发起式证券投资基金2017年第1季度报告	中国证监会指定媒介	2017-04-22
16	天弘基金管理有限公司广州分公司关于营业场所变更的公告	中国证监会指定媒介	2017-04-25
17	天弘基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会指定媒介	2017-04-26
18	天弘基金管理有限公司关于调整网上直销交易系统浦发银行直联渠道申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2017-05-24
19	天弘基金管理有限公司关于旗下基金参加肯特瑞财富申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2017-06-06
20	天弘基金管理有限公司关于在网上交易系统开通连连支付的第三方支付业务并实施申购费率优惠	中国证监会指定媒介	2017-06-06

	的公告		
21	天弘基金管理有限公司关于旗下基金在网上交易系统开展申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2017-06-12
22	天弘基金管理有限公司旗下基金2017年6月30日基金资产净值公告	中国证监会指定媒介	2017-06-30

§ 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

本报告期内，本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

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

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
二〇一七年八月二十八日