

**天弘中证500指数型发起式证券投资基金2015年半年度报告**

**2015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：2015年8月25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2015年8月21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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年1月20日起至2015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遵规守信情况的说明	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	11
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	11
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	12
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	12
§5 托管人报告	12
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	12
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	12
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	12
§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	14
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	16
6.4 报表附注	17
§7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	42
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	43
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	60
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	62
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	63
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	63
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	63
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	63
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	63
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	63
7.12 投资组合报告附注	63
§8 基金份额持有人信息	64
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	65
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	65
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	65
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	65
§9 开放式基金份额变动	66
§10 重大事件揭示	66

10.1	基金份额持有人大会决议 .....	66
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 .....	66
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	66
10.4	基金投资策略的改变 .....	67
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	67
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 .....	67
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	67
10.8	其他重大事件 .....	68
§11	影响投资者决策的其他重要信息 .....	72
§12	备查文件目录 .....	72
12.1	备查文件目录 .....	72
12.2	存放地点 .....	73
12.3	查阅方式 .....	73

## § 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	675,223,773.35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

信息披露负责人	姓名	童建林	王健
	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

<b>3.1.1 期间数据和指标</b>	报告期（2015年1月20日至2015年6月30日）
----------------------	----------------------------

本期已实现收益	69,460,894.10
本期利润	54,252,779.24
加权平均基金份额本期利润	0.1408
本期加权平均净值利润率	9.18%
本期基金份额净值增长率	50.18%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	报告期末(2015年6月30日)
期末可供分配利润	76,926,181.52
期末可供分配基金份额利润	0.1139
期末基金资产净值	1,014,063,862.94
期末基金份额净值	1.5018
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	报告期末(2015年6月30日)
基金份额累计净值增长率	50.18%

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、期末可供分配利润采用期末资产负债表未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

4、本基金合同自2015年1月20日起生效。

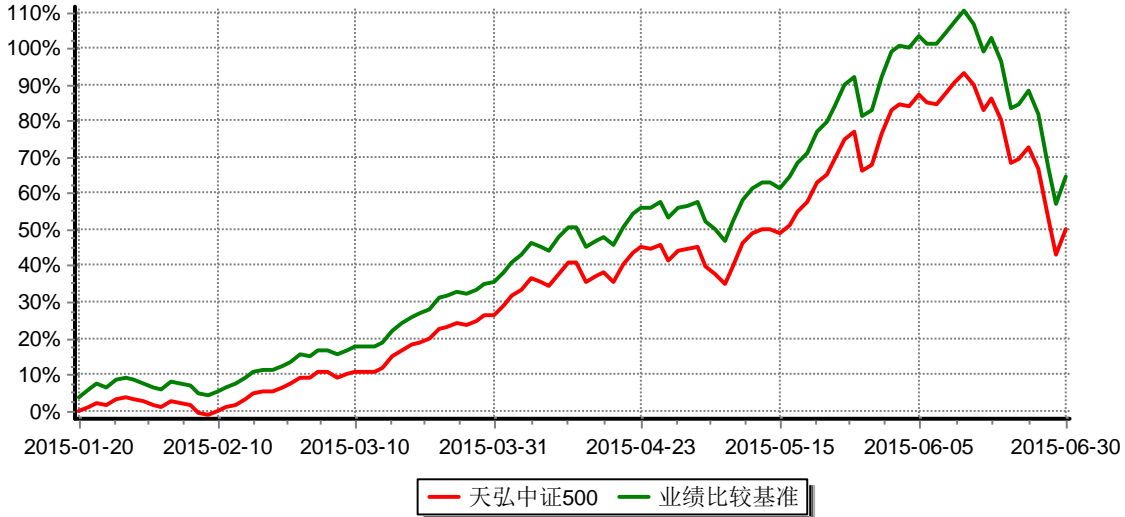
### 3.2 基金净值表现

#### 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	-10.62%	3.71%	-10.07%	3.60%	-0.55%	0.11%
过去三个月	18.98%	2.85%	21.70%	2.75%	-2.72%	0.10%
自基金合同生效日起至今（2015年01月20日-2015年06月30日）	50.18%	2.25%	64.52%	2.21%	-14.34%	0.04%

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%。

### 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变动的比较



注：1、本基金合同于2015年1月20日生效，本基金合同生效起至披露时点不满1年。  
2、基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。本基金的建仓期为2015年1月20日-2015年7月19日，截止报告日本基金仍处于建仓期。

## § 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2015年6月30日，本基金管理人共管理33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、天弘永定价值成长股票型证券投资基金、天弘周期策略股票型证券投资基金、天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金、天弘添利分级债券型证券投资基金、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、天弘通利债券型证券投资基金、天弘同利分级债券型证券投资基金、天弘季加利理财债券型证券投资基金、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、天弘普惠养老保本混合型证券投资基金、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。

#### 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		
李蕴炜	本基金基金经理；天弘沪深300指数型发起式证券投资基金基金经理。	2015年1月	—	9年	男，理学硕士。历任亚洲证券有限责任公司股票分析师、Ophedge investment services运营分析师。2007年加盟本公司，历任交易员、行业研究员、高级研究员、股票研究部副总经理、天弘精选混合型证券投资基金基金经理助理、天弘永定价值成长股票型

					证券投资基金基金经理、天弘安康养老混合型证券投资基金基金经理、天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理。
--	--	--	--	--	--

注：1、上述任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

本基金按照国家法律法规及基金合同的相关约定进行操作，不存在违法违规及未履行基金合同承诺的情况。

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其配套规则和其他相关法律法规、基金合同的有关规定，勤勉尽责地管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。

本报告期内，本基金运作合法合规，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

本基金在成立以来根据基金合同规定，采取了对指数的被动复制策略，将年化跟踪误差和日均跟踪偏离度控制在了基金合同约定的范围之内。

报告期内，本基金跟踪误差主要来自基金所持股票组合与所跟踪标的指数在权重结构上的差异。这种差异源自部分股票由于权重差价及停牌等原因所造成，各股票的权重与标的指数相比有所变化。本基金管理人在量化分析基础上，采取了适当的组合调整策略，尽可能地控制了基金的跟踪误差与偏离度。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2015年6月30日，本基金份额净值为1.5018元，本报告期份额净值增长率50.18%，同期业绩比较基准增长率64.52%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

在经济仍将继续下行判断的基础上，国家会进一步出台货币宽松及财政刺激等政策。同时，在中国经济结构性改革的时代，结构性行情及创新板块仍将表现抢眼。本基金管理人将根据基金合同，以量化分析研究为基础，克服各种因素的不利影响，不断优化和改进量化模型，将基金的跟踪误差及偏离度保持在较低水平，保持对指数的紧密跟踪，从而为基金持有人创造满意的投资回报。

#### 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《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，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、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：2015年6月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
<b>资 产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	120,910,488.37	—
结算备付金		1,732,764.00	—
存出保证金		1,380,614.01	—
交易性金融资产	6.4.7.2	975,696,291.09	—
其中：股票投资		955,574,291.09	—
基金投资		—	—
债券投资		20,122,000.00	—
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		107,764,491.86	—
应收利息	6.4.7.5	479,003.81	—
应收股利		—	—
应收申购款		—	—
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.6	—	—
资产总计		1,207,963,653.14	—
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2015年6月30日</b>	<b>上年度末 2014年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			

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		—	—
应付赎回款		192,554,846.24	—
应付管理人报酬		500,323.26	—
应付托管费		100,064.65	—
应付销售服务费		—	—
应付交易费用	6.4.7.7	448,118.45	—
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	296,437.60	—
负债合计		193,899,790.20	—
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	675,223,773.35	—
未分配利润	6.4.7.10	338,840,089.59	—
所有者权益合计		1,014,063,862.94	—
负债和所有者权益总计		1,207,963,653.14	—

注：1、报告截止日2015年6月30日，基金份额净值1.5018元，基金份额总额675223773.35份；

2、本财务报表的实际编制期间为2015年01月20日(基金合同生效日)至2015年6月30日，无上一年度可比数据（下同）。

## 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：2015年1月20日至2015年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2015年1月20日至2015年6月30日
一、收入		57,615,337.93

1.利息收入		611,626.35
其中：存款利息收入	6.4.7.11	436,108.54
债券利息收入		175,517.81
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）		72,211,826.44
其中：股票投资收益	6.4.7.12	69,222,106.90
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	—
股利收益	6.4.7.16	2,989,719.54
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-15,208,114.86
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	—
<b>减：二、费用</b>		<b>3,362,558.69</b>
1. 管理人报酬		1,289,456.77
2. 托管费		257,891.32
3. 销售服务费		—
4. 交易费用	6.4.7.19	1,607,554.35
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	207,656.25
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		54,252,779.24
减：所得税费用		—
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		54,252,779.24

### 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：2015年1月20日至2015年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月20日至2015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)	10,000,000.00	—	10,000,000.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	54,252,779.24	54,252,779.24
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)	665,223,773.35	284,587,310.35	949,811,083.70
其中：1.基金申购款	2,186,326,095.96	1,101,747,944.51	3,288,074,040.47
2.基金赎回款	-1,521,102,322.61	-817,160,634.16	-2,338,262,956.77
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	—	—	—
五、期末所有者权益(基金净值)	675,223,773.35	338,840,089.59	1,014,063,862.94

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[2014]第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。本基金为股票型证券投资基金,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有限公司普华永道验资报告予以验证。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,有效认购份额为10,000,000.00份。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。基金管理人股东资金、基金管理人固有资金、基金管理人高级管理人员、基金经理等投资管理人员认购金额不低于1,000万元,认购的基金份额持有期限不低于三年。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《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为:中证500指数收益率 $\times$ 95%+银行活期存款利率(税后) $\times$ 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日颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(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》、《天弘中证500指数型发起式证券投资基金合同》和如财务报表附注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。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2015年度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2015年6月30日的财务状况以及2015年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 重要会计政策和会计估计

#### 6.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期会计报表实际编制期间为2015年1月20日至2015年6月30日止。

#### 6.4.4.2 记账本位币

本基金记账本位币为人民币。

#### 6.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金目前暂无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

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

##### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损

益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和各类应付款项等。

#### 6.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，于交易日按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；支付的价款中包含已宣告但尚未发放的现金股利或债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，应当单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

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

当收取某项金融资产现金流量的合同权利已终止或该金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬已转移时，终止确认该金融资产。终止确认的金融资产的成本按移动加权平均法于交易日结转。

#### 6.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 6.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金依法有权抵销债权债务且交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产

负债表中列示。

#### 6.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额拆分引起的实收基金份额变动于基金份额拆分日根据拆分前的基金份额数及确定的拆分比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

#### 6.4.4.8 损益平准金

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

#### 6.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；处置时其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

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

#### 6.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

#### 6.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投

资。若期末未分配利润中的未实现部分(包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等)为正数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分;若期末未分配利润的未实现部分为负数,则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润(已实现部分相抵未实现部分后的余额)。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 6.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部,以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分:(1)本基金该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用;(2)本基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果,以决定向其配置资源、评价其业绩;(3)本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征,并且满足一定条件的,则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作,不需要进行分部报告的披露。

#### 6.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

(1) 对于证券交易所上市的股票,若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况,本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》,根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票,根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》之附件《非公开发行有明确锁定期股票的公允价值的确定方法》,若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价低于非公开发行股票的初始投资成本,按估值日证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价估值;若在证券交易所挂牌的同一股票的市场交易收盘价高于非公开发行股票的初始投资成本,按锁定期内已经过交易天数占锁定期内总交易天数的比例将两者之间差价的一部分确认为估值增值。

(3) 在银行间同业市场交易的债券品种,根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值,具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(4) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

## 6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

### 6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

### 6.4.5.2 会计估计变更的说明

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外),鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息,本基金本报告期改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

### 6.4.5.3 差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

## 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》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)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。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(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,股权的股息、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,暂减按25%计入应纳税所得额。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 2015年6月30日
活期存款	120,910,488.37
定期存款	—
其中：存款期限1-3个月	—
其他存款	—
合计	120,910,488.37

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日			
	成本	公允价值	公允价值变动	
股票	970,847,405.95	955,574,291.09	-15,273,114.86	
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—	
债券	交易所市场	20,057,000.00	20,122,000.00	65,000.00
	银行间市场	—	—	—
	合计	20,057,000.00	20,122,000.00	65,000.00
资产支持证券	—	—	—	
基金	—	—	—	
其他	—	—	—	
合计	990,904,405.95	975,696,291.09	-15,208,114.86	

注：截至2015年6月30日，股票投资余额中包含按照指数收益法估值的特殊事项停牌相关股票。

##### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本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 2015年6月30日
应收活期存款利息	56,758.97
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	779.80
应收债券利息	420,843.84
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	621.20
合计	479,003.81

#### 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 2015年6月30日
交易所市场应付交易费用	448,118.45
银行间市场应付交易费用	—
合计	448,118.45

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元



项目	本期末 2015年6月30日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	96,321.83
预提费用	152,168.22
其他应付	47,947.55
合计	296,437.60

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2015年1月20日至2015年6月30日	
	基金份额（份）	账面金额
基金合同生效日	10,000,000.00	10,000,000.00
本期申购	2,186,326,095.96	2,186,326,095.96
本期赎回（以“-”号填列）	-1,521,102,322.61	-1,521,102,322.61
本期末	675,223,773.35	675,223,773.35

注：申购含转换入份额，赎回含转换出份额。

#### 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	—	—	—
本期利润	69,460,894.10	-15,208,114.86	54,252,779.24
本期基金份额交易产生的变动数	7,465,287.42	277,122,022.93	284,587,310.35
其中：基金申购款	95,324,429.13	1,006,423,515.38	1,101,747,944.51
基金赎回款	-87,859,141.71	-729,301,492.45	-817,160,634.16
本期已分配利润	—	—	—
本期末	76,926,181.52	261,913,908.07	338,840,089.59

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2015年1月20日至2015年6月30日
活期存款利息收入	404,909.07
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	17,054.98
其他	14,144.49
合计	436,108.54

### 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2015年1月20日至2015年6月30日
股票投资收益——买卖股票 差价收入	69,222,106.90
股票投资收益——赎回差价 收入	—
合计	69,222,106.90

#### 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 2015年1月20日至2015年6月30日
卖出股票成交总额	801,523,568.59
减：卖出股票成本总额	732,301,461.69
买卖股票差价收入	69,222,106.90

### 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

本基金本报告期未发生债券投资收益。

#### 6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

本基金本报告期未发生资产支持证券投资收益。

### 6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期未发生贵金属投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期未发生衍生工具收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2015年1月20日至2015年6月30日
股票投资产生的股利收益	2,989,719.54
基金投资产生的股利收益	—
合计	2,989,719.54

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期
	2015年1月20日至2015年6月30日
1.交易性金融资产	-15,208,114.86
——股票投资	-15,273,114.86
——债券投资	65,000.00
——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	—
——权证投资	—
3.其他	—
合计	-15,208,114.86

#### 6.4.7.18 其他收入

本基金本报告期未发生其他收入。

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月20日至2015年6月30日
交易所市场交易费用	1,607,554.35
银行间市场交易费用	—
合计	1,607,554.35

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月20日至2015年6月30日
审计费用	11,704.50
信息披露费	140,463.72
其他费用	880.00
指数使用费	51,578.24
汇划手续费	3,029.79
合计	207,656.25

#### 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

截至财务报表报出日，本基金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

根据本基金的基金管理人于2015年2月26日披露的关于增资扩股工商变更登记的相关公告，基金管理人变更前股东名单为：

关联方名称	与本基金的关系
天津信托有限责任公司	基金管理人的股东

内蒙古君正能源化工集团股份有限公司	基金管理人的股东
芜湖高新投资有限公司	基金管理人的股东

变更后股东名单为：

关联方名称	与本基金的关系
浙江蚂蚁小微金融服务集团有限公司	基金管理人的股东
天津信托有限责任公司	基金管理人的股东
内蒙古君正能源化工集团股份有限公司	基金管理人的股东
芜湖高新投资有限公司	基金管理人的股东
新疆天瑞博丰股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
新疆天惠新盟股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
新疆天阜恒基股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
新疆天聚宸兴股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东

#### 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、注册登记机构
国泰君安证券股份有限公司	基金托管人

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 2015年1月20日至2015年6月30日	
	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	2,504,441,165.63	100.00%

##### 6.4.10.1.2 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年1月20日至2015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	526,937.09	100.00%	448,118.45	100.00%

#### 6.4.10.1.3 债券交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期2015年1月20日至2015年6月30日	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例
国泰君安证券股份有限公司	20,057,000.00	100.00%

#### 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 2015年1月20日至2015年6月30日
	当期发生的基金应支付的管理费
其中：支付销售机构的客户维护费	—

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。本期未发生客户维护费。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	
	2015年1月20日至2015年6月30日	
当期发生的基金应支付的托管费	257,891.32	

注：1、支付基金托管人中国工商银行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X0.1%/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

本基金本报告期内未与关联方进行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	
	2015年1月20日至2015年6月30日	
基金合同生效日（2015年1月20日）持有的基金份额	10,000,000.00	
期初持有的基金份额	—	
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	
期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.48%	

#### 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

本报告期末除管理人之外的其他关联方未投资本基金份额。

### 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	
	2015年1月20日至2015年6月30日	
	期末余额	当期利息收入

国泰君安证券 活期存款	120,910,488.37	404,909.07
----------------	----------------	------------

注：本基金的银行存款由基金托管人国泰君安证券保管，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

本基金本报告期未在承销期内参与关联方承销证券交易。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本期无利润分配情况。

#### 6.4.12 期末（2015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

截至本报告期末（2015年6月30日）止本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 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
000693	华泽钴镍	2015-06-30	披露重大事项	20.57	2015-08-18	22.63	48,688	1,466,144.57	1,001,512.16
002091	江苏国泰	2015-06-01	重大资产重组	26.22		—	38,300	795,076.51	1,004,226.00
002069	獐子岛	2015-06-01	披露重大事项	19.76		—	50,900	814,468.09	1,005,784.00
002226	江南化工	2015-06-08	披露重大事项	13.18		—	77,100	789,974.62	1,016,178.00
002345	潮宏基	2015-05-22	披露重大事项	19.58		—	56,900	740,009.13	1,114,102.00
002574	明牌珠宝	2015-06-04	披露重大事项	22.90		—	49,400	760,726.29	1,131,260.00
002727	一心堂	2015-04-13	披露重大事项	78.24	2015-08-17	70.42	14,515	854,836.13	1,135,653.60
000788	北大医药	2015-05-25	披露重大事项	20.72	2015-07-21	18.65	54,900	1,025,359.99	1,137,528.00
002106	莱宝高科	2015-04-07	重大资产重组	16.42		—	69,900	1,064,983.00	1,147,758.00



000688	建新矿业	2015-06-10	披露重大事项	17.07		—	69,600	736,660.53	1,188,072.00
600869	智慧能源	2015-05-11	披露重大事项	29.14	2015-07-31	26.23	40,800	775,995.45	1,188,912.00
000519	江南红箭	2015-06-15	披露重大事项	26.06		—	45,700	883,958.64	1,190,942.00
600078	澄星股份	2015-06-09	披露重大事项	15.23	2015-07-01	13.71	79,800	819,415.32	1,215,354.00
002242	九阳股份	2015-06-15	披露重大事项	19.45	2015-07-07	17.51	64,500	1,029,418.94	1,254,525.00
0022203	海亮股份	2015-04-27	披露重大事项	12.71		—	103,500	1,088,687.47	1,315,485.00
000850	华茂股份	2015-05-07	重大资产重组	10.98		—	126,000	1,203,286.19	1,383,480.00
600335	国机汽车	2015-06-15	披露重大事项	37.93	2015-07-21	34.14	38,566	1,093,688.21	1,462,808.38
600416	湘电股份	2015-05-22	重大资产重组	22.64	2015-07-20	20.35	65,500	1,179,390.55	1,482,920.00
000697	炼石有色	2015-05-18	重大资产重组	33.83		—	43,900	1,217,150.43	1,485,137.00
600790	轻纺城	2015-05-25	披露重大事项	13.38	2015-08-18	12.04	112,340	1,092,506.71	1,503,109.20
002143	印纪传媒	2015-06-30	披露重大事项	32.01	2015-07-01	33.50	48,600	1,875,359.43	1,555,686.00
000979	中弘股份	2015-05-25	重大资产重组	6.04		—	272,640	1,159,408.14	1,646,745.60
002309	中利科技	2015-06-02	披露重大事项	33.39	2015-07-21	30.05	50,500	1,390,767.07	1,686,195.00
600702	沱牌舍得	2015-06-29	披露重大事项	26.11	2015-08-20	28.00	64,700	1,503,030.73	1,689,317.00
002269	美邦服饰	2015-05-22	披露重大事项	11.86	2015-07-02	10.67	148,550	1,118,600.94	1,761,803.00
002414	高德红外	2015-05-13	披露重大事项	39.36		—	47,200	1,389,124.90	1,857,792.00
600366	宁波韵升	2015-05-22	重大资产重组	35.09	2015-08-12	31.58	53,300	1,230,798.37	1,870,297.00
000669	金鸿能源	2015-05-04	披露重大事项	41.70	2015-07-23	33.95	45,900	1,534,657.24	1,914,030.00
000786	北新建材	2015-04-10	重大资产重组	18.58		—	109,200	1,705,650.53	2,028,936.00
000650	仁和药业	2015-06-12	披露重大事项	13.39		—	152,500	1,592,436.93	2,041,975.00

002665	首航节能	2015-06-30	披露重大事项	27.70	2015-07-01	30.00	78,750	2,403,180.12	2,181,375.00
000959	首钢股份	2015-04-23	重大资产重组	6.15		—	360,000	1,808,221.98	2,214,000.00
600967	北方创业	2015-04-13	重大资产重组	17.12		—	129,800	2,033,617.00	2,222,176.00
002325	洪涛股份	2015-06-03	披露重大事项	31.15		—	75,300	1,624,011.92	2,345,595.00
600482	风帆股份	2015-05-28	重大资产重组	42.38		—	56,300	1,237,689.00	2,385,994.00
000543	皖能电力	2015-06-15	披露重大事项	21.36	2015-07-14	19.22	112,300	1,784,433.73	2,398,728.00
002368	太极股份	2015-05-14	重大资产重组	65.52		—	36,900	1,617,922.00	2,417,688.00
600587	新华医疗	2015-05-22	披露重大事项	58.63	2015-07-03	52.77	41,500	1,903,537.48	2,433,145.00
002308	威创股份	2015-06-12	披露重大事项	31.00		—	79,989	1,381,042.48	2,479,659.00
601311	骆驼股份	2015-06-18	披露重大事项	28.20	2015-07-15	25.38	94,700	2,126,449.20	2,670,540.00
001696	宗申动力	2015-06-30	披露重大事项	17.25	2015-08-24	15.53	158,200	3,314,783.01	2,728,950.00
600175	美都能源	2015-06-29	披露重大事项	10.64	2015-07-20	9.58	269,624	2,180,444.78	2,868,799.36
300291	华录百纳	2015-06-30	披露重大事项	37.76	2015-07-13	34.65	77,800	3,920,261.42	2,937,728.00
000732	泰禾集团	2015-06-25	披露重大事项	34.20	2015-07-02	30.78	88,973	2,871,431.90	3,042,876.60
000887	中鼎股份	2015-06-30	披露重大事项	24.75		—	129,100	3,794,457.75	3,195,225.00
000066	长城电脑	2015-06-18	披露重大事项	21.54		—	150,300	2,642,108.15	3,237,462.00
600499	科达洁能	2015-06-10	披露重大事项	29.64		—	113,400	2,831,654.91	3,361,176.00
600879	航天电子	2015-05-15	重大资产重组	24.50		—	138,700	2,723,930.77	3,398,150.00
600110	中科英华	2015-06-26	披露重大事项	13.73		—	250,759	2,420,055.01	3,442,921.07
000592	平潭发展	2015-06-30	披露重大事项	29.76	2015-07-14	30.00	122,569	5,443,419.30	3,647,653.44
600312	平高电气	2015-06-23	披露重大事项	22.58		—	165,058	3,732,252.62	3,727,009.64

002276	万马股份	2015-06-30	披露重大事项	34.15	2015-07-20	30.74	109,700	2,698,697.17	3,746,255.00
600643	爱建股份	2015-06-30	披露重大事项	16.73		—	231,430	4,026,522.77	3,871,823.90
002191	劲嘉股份	2015-06-18	披露重大事项	19.22		—	210,400	2,879,960.55	4,043,888.00
002662	京威股份	2015-05-15	披露重大事项	17.84	2015-08-13	16.06	24,400	432,336.14	435,296.00
600872	中炬高新	2015-05-04	重大资产重组	23.17		—	188,700	2,788,553.69	4,372,179.00
600654	中安消	2015-06-29	披露重大事项	30.91		—	141,500	3,654,533.17	4,373,765.00
002018	华信国际	2015-06-15	重大资产重组	44.08		—	99,700	2,343,856.30	4,394,776.00
002223	鱼跃医疗	2015-06-25	披露重大事项	67.20	2015-07-13	60.48	69,760	3,234,071.78	4,687,872.00
600645	中源协和	2015-04-27	重大资产重组	79.34		—	59,700	3,767,588.54	4,736,598.00
300144	宋城演艺	2015-06-18	披露重大事项	76.47	2015-07-20	68.82	63,600	4,184,472.37	4,863,492.00
000566	海南海药	2015-06-18	披露重大事项	49.97		—	99,600	3,772,195.78	4,977,012.00
601718	际华集团	2015-06-17	披露重大事项	15.12	2015-07-02	13.61	341,400	3,124,358.84	5,161,968.00
000748	长城信息	2015-06-18	披露重大事项	34.88		—	149,700	4,376,608.84	5,221,536.00
600410	华胜天成	2015-05-28	披露重大事项	47.84	2015-07-22	43.06	111,300	3,572,305.68	5,324,592.00
600333	长春燃气	2015-05-29	披露重大事项	11.97	2015-07-09	10.77	47,300	478,579.54	566,181.00
600978	宜华木业	2015-06-18	披露重大事项	22.44		—	265,600	3,723,820.22	5,960,064.00
002183	怡亚通	2015-06-01	披露重大事项	73.15		—	106,000	4,157,106.93	7,753,900.00
002257	洽洽食品	2015-06-29	披露重大事项	16.38	2015-08-24	14.74	48,000	914,977.27	786,240.00
002238	天威视讯	2015-06-29	披露重大事项	23.76		—	35,950	824,902.03	854,172.00
002194	武汉凡谷	2015-06-18	披露重大事项	26.98	2015-07-24	24.28	34,277	601,064.15	924,793.46
002461	珠江啤酒	2015-06-04	披露重大事项	26.40	2015-07-24	23.76	35,900	615,124.37	947,760.00

注：本基金截至2015年6月30日止持有以上因公布的重大事项或重大资产重组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2015年6月30日止，本基金未持有从事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2015年6月30日止，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，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。

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。

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。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。公司经理层面成立了风险管理委员会，根据公司总体风险控制目标，分配各业务和各环节风险控制目标和要求；落实公司重大风险管理的决定或决议；听取并讨论会议成员的报告；对会议成员提出的或发现的已经存在的风险点，在充分讨论、协调基础上形成具体的风险控制措施；对潜在风险点分析讨论，拟定应对措施；对发生的风险事件和重大差错，分析原因、总结经验教训、风险定级、划分责任，向总经理办公会报告。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本基金的托管行中国工商银行，与该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。

于2015年6月30日，本基金持有的除国债、央行票据和政策性金融债以外的债券占基金资产净值的比例为0。

##### 6.4.13.2.1按短期信用评级列示的债券投资

截至本报告期末2015年6月30日止，本基金未持有短期信用类债券。

##### 6.4.13.2.2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 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
AAA	—	—
AAA以下	—	—
未评级	20,122,000.00	—
合计	20,122,000.00	—

注：1、截止至本报告期末2015年6月30日，未评级债券主要为国债。

2、本基金基金合同生效日为2015年1月20日，所以无上年度可比期间数据。

### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金所持金融工具变现的难易程度。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。

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的投资品种比例等。本基金所持大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，因此除附注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，其余金融资产均能以合理价格适时变现。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。

本基金所持有的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

### 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。

本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及债券投资等。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。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末 2015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	120,910,488.37	—	—	—	120,910,488.37
结算备付金	1,732,764.00	—	—	—	1,732,764.00
存出保证金	1,380,614.01	—	—	—	1,380,614.01
交易性金融资产	20,122,000.00	—	—	955,574,291.09	975,696,291.09
应收证券清算款	—	—	—	107,764,491.86	107,764,491.86
应收利息	—	—	—	479,003.81	479,003.81
资产总计	144,145,866.38	—	—	1,063,817,786.76	1,207,963,653.14
负债					
应付赎回款	—	—	—	192,554,846.24	192,554,846.24
应付管理人报酬	—	—	—	500,323.26	500,323.26
应付托管费	—	—	—	100,064.65	100,064.65
应付交易费用	—	—	—	448,118.45	448,118.45
其他负债	—	—	—	296,437.60	296,437.60
负债总计	—	—	—	193,899,790.20	193,899,790.20
利率敏感度缺口	144,145,866.38	—	—	869,917,996.56	1,014,063,862.94

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2015年6月30日，债券资产余额小于资产净值20%，市场价格因素影响不重大，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 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 2015年6月30日		上年度末 2014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	955,574,291.09	94.23	—	—
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	955,574,291.09	94.23	—	—

注：本基金合同生效日为2015年1月20日，因此无上年度同期可比数据。

##### 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 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
	1.业绩比较基准(附注 6.4.1)上升5%	51,892,642.91	—
	2.业绩比较基准(附注 6.4.1)下降5%	-51,892,642.91	—

#### 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2015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775815753.68元，属于第二层次的余额为191552353.41元，第三层次的余额为8328184.00元。

##### (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。对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，本基金于2015年3月26日起改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值(附注6.4.5.2)，并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

(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（元）	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	955,574,291.09	79.11
	其中：股票	955,574,291.09	79.11
2	固定收益投资	20,122,000.00	1.67
	其中：债券	20,122,000.00	1.67
	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	122,643,252.37	10.15
7	其他资产	109,624,109.68	9.08
8	合计	1,207,963,653.14	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	14,748,566.22	1.45
B	采矿业	25,838,213.93	2.55
C	制造业	563,900,938.92	55.61
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	29,524,159.98	2.91

E	建筑业	21,152,660.05	2.09
F	批发和零售业	64,992,907.05	6.41
G	交通运输、仓储和邮政业	30,358,518.20	2.99
H	住宿和餐饮业	1,177,100.00	0.12
I	信息传输、软件和信息技术服务业	54,207,660.01	5.35
J	金融业	8,509,327.90	0.84
K	房地产业	68,658,343.07	6.77
L	租赁和商务服务业	25,538,916.04	2.52
M	科学研究和技术服务业	6,067,429.00	0.60
N	水利、环境和公共设施管理业	5,183,392.47	0.51
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	2,770,020.00	0.27
R	文化、体育和娱乐业	19,764,145.48	1.95
S	综合	13,181,992.77	1.30
	合计	955,574,291.09	94.23

### 7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

### 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	002183	怡亚通	106,000	7,753,900.00	0.76
2	600978	宜华木业	265,600	5,960,064.00	0.59
3	600410	华胜天成	111,300	5,324,592.00	0.53
4	000748	长城信息	149,700	5,221,536.00	0.51
5	601718	际华集团	341,400	5,161,968.00	0.51
6	002405	四维图新	115,077	5,040,372.60	0.50
7	000566	海南海药	99,600	4,977,012.00	0.49

8	300144	宋城演艺	63,600	4,863,492.00	0.48
9	600645	中源协和	59,700	4,736,598.00	0.47
10	002223	鱼跃医疗	69,760	4,687,872.00	0.46
11	600881	亚泰集团	363,298	4,617,517.58	0.46
12	600895	张江高科	158,400	4,611,024.00	0.45
13	000540	中天城投	350,363	4,414,573.80	0.44
14	002018	华信国际	99,700	4,394,776.00	0.43
15	600654	中安消	141,500	4,373,765.00	0.43
16	600872	中炬高新	188,700	4,372,179.00	0.43
17	600037	歌华有线	135,100	4,255,650.00	0.42
18	002030	达安基因	94,240	4,174,832.00	0.41
19	600737	中粮屯河	196,500	4,089,165.00	0.40
20	600376	首开股份	209,909	4,049,144.61	0.40
21	002191	劲嘉股份	210,400	4,043,888.00	0.40
22	600435	北方导航	87,900	3,988,023.00	0.39
23	600158	中体产业	137,800	3,947,970.00	0.39
24	600635	大众公用	399,698	3,909,046.44	0.39
25	600601	方正科技	426,036	3,876,927.60	0.38
26	600643	爱建股份	231,430	3,871,823.90	0.38
27	600219	南山铝业	380,200	3,836,218.00	0.38
28	600446	金证股份	31,000	3,827,260.00	0.38
29	600201	金宇集团	52,786	3,754,140.32	0.37
30	002276	万马股份	109,700	3,746,255.00	0.37
31	600312	平高电气	165,058	3,727,009.64	0.37
32	000998	隆平高科	135,840	3,681,264.00	0.36
33	000592	平潭发展	122,569	3,647,653.44	0.36
34	300033	同花顺	41,695	3,585,353.05	0.35
35	002400	省广股份	139,600	3,526,296.00	0.35
36	600026	中海发展	273,800	3,515,592.00	0.35
37	600594	益佰制药	60,400	3,511,052.00	0.35

38	600143	金发科技	292,664	3,488,554.88	0.34
39	600500	中化国际	198,500	3,469,780.00	0.34
40	000997	新大陆	130,022	3,458,585.20	0.34
41	600110	中科英华	250,759	3,442,921.07	0.34
42	000547	闽福发A	127,930	3,413,172.40	0.34
43	600879	航天电子	138,700	3,398,150.00	0.34
44	300253	卫宁软件	65,349	3,398,148.00	0.34
45	600525	长园集团	164,239	3,378,396.23	0.33
46	600021	上海电力	159,838	3,372,581.80	0.33
47	600320	振华重工	320,507	3,365,323.50	0.33
48	600499	科达洁能	113,400	3,361,176.00	0.33
49	600811	东方集团	272,500	3,359,925.00	0.33
50	600200	江苏吴中	90,803	3,337,010.25	0.33
51	000012	南玻A	250,000	3,335,000.00	0.33
52	000031	中粮地产	176,000	3,324,640.00	0.33
53	600694	大商股份	59,186	3,271,802.08	0.32
54	002022	科华生物	76,150	3,248,559.00	0.32
55	000066	长城电脑	150,300	3,237,462.00	0.32
56	600816	安信信托	64,900	3,233,318.00	0.32
57	601012	隆基股份	203,650	3,205,451.00	0.32
58	000887	中鼎股份	129,100	3,195,225.00	0.32
59	600079	人福医药	86,000	3,186,300.00	0.31
60	600770	综艺股份	159,800	3,122,492.00	0.31
61	000732	泰禾集团	88,973	3,042,876.60	0.30
62	600787	中储股份	188,900	3,041,290.00	0.30
63	600122	宏图高科	184,500	3,029,490.00	0.30
64	600655	豫园商城	188,129	3,019,470.45	0.30
65	600198	大唐电信	84,500	2,994,680.00	0.30
66	600675	中华企业	264,200	2,988,102.00	0.29
67	600169	太原重工	335,372	2,984,810.80	0.29

68	600797	浙大网新	157,600	2,977,064.00	0.29
69	002701	奥瑞金	113,500	2,954,405.00	0.29
70	600511	国药股份	58,300	2,937,737.00	0.29
71	300291	华录百纳	77,800	2,937,728.00	0.29
72	600704	物产中大	123,000	2,937,240.00	0.29
73	600651	飞乐音响	140,800	2,896,256.00	0.29
74	600175	美都能源	269,624	2,868,799.36	0.28
75	600521	华海药业	91,642	2,863,812.50	0.28
76	600125	铁龙物流	185,600	2,863,808.00	0.28
77	000511	烯碳新材	233,300	2,857,925.00	0.28
78	600584	长电科技	148,900	2,845,479.00	0.28
79	000616	海航投资	273,947	2,843,569.86	0.28
80	002266	浙富控股	207,500	2,838,600.00	0.28
81	000690	宝新能源	224,187	2,835,965.55	0.28
82	002073	软控股份	122,300	2,825,130.00	0.28
83	000930	中粮生化	149,600	2,819,960.00	0.28
84	002004	华邦颖泰	216,440	2,809,391.20	0.28
85	600428	中远航运	172,200	2,787,918.00	0.27
86	300244	迪安诊断	33,000	2,770,020.00	0.27
87	300072	三聚环保	81,700	2,753,290.00	0.27
88	001696	宗申动力	158,200	2,728,950.00	0.27
89	601608	中信重工	166,924	2,720,861.20	0.27
90	000661	长春高新	20,862	2,712,060.00	0.27
91	300273	和佳股份	90,836	2,706,004.44	0.27
92	600522	中天科技	118,800	2,700,324.00	0.27
93	600240	华业资本	175,100	2,672,026.00	0.26
94	601311	骆驼股份	94,700	2,670,540.00	0.26
95	600058	五矿发展	81,672	2,668,224.24	0.26
96	002219	恒康医疗	59,867	2,661,686.82	0.26
97	300199	翰宇药业	82,100	2,654,293.00	0.26

98	600664	哈药股份	220,300	2,652,412.00	0.26
99	600498	烽火通信	100,200	2,651,292.00	0.26
100	000006	深振业A	191,900	2,604,083.00	0.26
101	600151	航天机电	161,700	2,592,051.00	0.26
102	600436	片仔癀	38,800	2,586,796.00	0.26
103	002161	远望谷	117,800	2,563,328.00	0.25
104	002340	格林美	168,291	2,559,706.11	0.25
105	600685	中船防务	47,476	2,551,360.24	0.25
106	600426	华鲁恒升	136,642	2,536,075.52	0.25
107	600017	日照港	311,600	2,527,076.00	0.25
108	002573	清新环境	121,905	2,519,776.35	0.25
109	600759	洲际油气	164,800	2,518,144.00	0.25
110	600755	厦门国贸	223,636	2,513,668.64	0.25
111	002285	世联行	116,820	2,504,620.80	0.25
112	002013	中航机电	89,530	2,493,410.50	0.25
113	000897	津滨发展	260,500	2,485,170.00	0.25
114	600171	上海贝岭	101,429	2,479,939.05	0.24
115	002308	威创股份	79,989	2,479,659.00	0.24
116	000078	海王生物	112,700	2,479,400.00	0.24
117	600611	大众交通	146,800	2,444,220.00	0.24
118	002250	联化科技	108,900	2,439,360.00	0.24
119	000415	渤海租赁	257,754	2,438,352.84	0.24
120	600587	新华医疗	41,500	2,433,145.00	0.24
121	000667	美好集团	361,700	2,430,624.00	0.24
122	600765	中航重机	88,487	2,427,198.41	0.24
123	600220	江苏阳光	292,200	2,422,338.00	0.24
124	600808	马钢股份	455,200	2,421,664.00	0.24
125	600325	华发股份	133,600	2,418,160.00	0.24
126	002368	太极股份	36,900	2,417,688.00	0.24
127	600528	中铁二局	143,640	2,408,842.80	0.24

128	000543	皖能电力	112,300	2,398,728.00	0.24
129	600056	中国医药	98,200	2,390,188.00	0.24
130	600482	风帆股份	56,300	2,385,994.00	0.24
131	300267	尔康制药	69,900	2,382,891.00	0.23
132	000062	深圳华强	41,600	2,374,112.00	0.23
133	600433	冠豪高新	153,800	2,366,982.00	0.23
134	002489	浙江永强	62,640	2,361,528.00	0.23
135	002325	洪涛股份	75,300	2,345,595.00	0.23
136	600673	东阳光科	237,000	2,343,930.00	0.23
137	002424	贵州百灵	37,273	2,331,798.88	0.23
138	000758	中色股份	118,556	2,327,254.28	0.23
139	600517	置信电气	148,160	2,318,704.00	0.23
140	300274	阳光电源	75,600	2,311,092.00	0.23
141	601000	唐山港	167,400	2,291,706.00	0.23
142	000988	华工科技	128,600	2,290,366.00	0.23
143	002063	远光软件	73,000	2,282,710.00	0.23
144	600176	中国巨石	84,207	2,278,641.42	0.22
145	600880	博瑞传播	146,100	2,268,933.00	0.22
146	000088	盐田港	159,500	2,258,520.00	0.22
147	600086	东方金钰	42,000	2,258,340.00	0.22
148	000656	金科股份	321,904	2,224,356.64	0.22
149	600967	北方创业	129,800	2,222,176.00	0.22
150	000959	首钢股份	360,000	2,214,000.00	0.22
151	000718	苏宁环球	153,365	2,213,056.95	0.22
152	002049	同方国芯	46,100	2,212,800.00	0.22
153	600187	国中水务	280,900	2,191,020.00	0.22
154	600138	中青旅	103,500	2,185,920.00	0.22
155	002665	首航节能	78,750	2,181,375.00	0.22
156	600805	悦达投资	139,500	2,180,385.00	0.22
157	002271	东方雨虹	84,746	2,177,972.20	0.21



158	000933	神火股份	230,900	2,175,078.00	0.21
159	000021	深科技	141,305	2,154,901.25	0.21
160	600409	三友化工	190,300	2,150,390.00	0.21
161	000652	泰达股份	210,700	2,144,926.00	0.21
162	600270	外运发展	73,100	2,131,596.00	0.21
163	000939	凯迪电力	144,000	2,109,600.00	0.21
164	002005	德豪润达	182,500	2,095,100.00	0.21
165	002428	云南锗业	88,800	2,087,688.00	0.21
166	600120	浙江东方	61,500	2,084,235.00	0.21
167	600422	昆药集团	56,001	2,068,116.93	0.20
168	600478	科力远	121,433	2,066,789.66	0.20
169	002195	二三四五	49,600	2,061,376.00	0.20
170	000830	鲁西化工	206,600	2,057,736.00	0.20
171	600006	东风汽车	161,297	2,045,245.96	0.20
172	600580	卧龙电气	114,600	2,043,318.00	0.20
173	000650	仁和药业	152,500	2,041,975.00	0.20
174	000671	阳光城	98,000	2,036,440.00	0.20
175	002092	中泰化学	199,500	2,032,905.00	0.20
176	601717	郑煤机	186,200	2,031,442.00	0.20
177	000786	北新建材	109,200	2,028,936.00	0.20
178	600812	华北制药	166,400	2,020,096.00	0.20
179	600160	巨化股份	183,300	2,019,966.00	0.20
180	600835	上海机电	61,142	2,014,017.48	0.20
181	000829	天音控股	135,603	2,013,704.55	0.20
182	600536	中国软件	56,717	2,012,319.16	0.20
183	002179	中航光电	60,913	2,010,129.00	0.20
184	603766	隆鑫通用	79,600	1,997,960.00	0.20
185	600067	冠城大通	200,300	1,986,976.00	0.20
186	000681	视觉中国	48,331	1,984,470.86	0.20
187	002595	豪迈科技	91,415	1,972,735.70	0.19

188	600161	天坛生物	52,368	1,972,178.88	0.19
189	600557	康缘药业	70,800	1,970,364.00	0.19
190	002244	滨江集团	106,800	1,966,188.00	0.19
191	600064	南京高科	100,819	1,965,970.50	0.19
192	600418	江淮汽车	139,441	1,963,329.28	0.19
193	002029	七匹狼	93,300	1,959,300.00	0.19
194	600699	均胜电子	51,100	1,957,641.00	0.19
195	600183	生益科技	191,900	1,955,461.00	0.19
196	600487	亨通光电	52,582	1,935,017.60	0.19
197	000090	天健集团	79,100	1,918,175.00	0.19
198	300147	香雪制药	62,200	1,915,760.00	0.19
199	000669	金鸿能源	45,900	1,914,030.00	0.19
200	000528	柳工	160,870	1,901,483.40	0.19
201	000572	海马汽车	226,000	1,896,140.00	0.19
202	002440	闰土股份	78,900	1,891,233.00	0.19
203	002299	圣农发展	93,037	1,888,651.10	0.19
204	600366	宁波韵升	53,300	1,870,297.00	0.18
205	600458	时代新材	74,478	1,869,397.80	0.18
206	000685	中山公用	63,400	1,865,862.00	0.18
207	600481	双良节能	77,600	1,858,520.00	0.18
208	002414	高德红外	47,200	1,857,792.00	0.18
209	600039	四川路桥	283,857	1,853,586.21	0.18
210	002466	天齐锂业	29,900	1,847,820.00	0.18
211	300088	长信科技	67,000	1,842,500.00	0.18
212	600284	浦东建设	112,792	1,839,637.52	0.18
213	600289	亿阳信通	91,900	1,831,567.00	0.18
214	002390	信邦制药	102,050	1,824,654.00	0.18
215	600614	鼎立股份	61,000	1,822,680.00	0.18
216	000816	智慧农业	174,900	1,808,466.00	0.18
217	000680	山推股份	203,300	1,803,271.00	0.18

218	000028	国药一致	24,200	1,803,142.00	0.18
219	601666	平煤股份	237,020	1,794,241.40	0.18
220	600851	海欣股份	141,300	1,788,858.00	0.18
221	600825	新华传媒	107,800	1,788,402.00	0.18
222	300202	聚龙股份	44,200	1,785,680.00	0.18
223	600380	健康元	117,400	1,779,784.00	0.18
224	600216	浙江医药	133,800	1,776,864.00	0.18
225	300115	长盈精密	53,269	1,774,390.39	0.17
226	002508	老板电器	46,162	1,770,774.32	0.17
227	000777	中核科技	53,700	1,764,045.00	0.17
228	002269	美邦服饰	148,550	1,761,803.00	0.17
229	000587	金叶珠宝	76,100	1,760,193.00	0.17
230	002168	深圳惠程	113,300	1,758,416.00	0.17
231	002444	巨星科技	94,739	1,750,776.72	0.17
232	600757	长江传媒	125,000	1,737,500.00	0.17
233	600300	维维股份	170,200	1,727,530.00	0.17
234	600267	海正药业	91,900	1,726,801.00	0.17
235	600546	山煤国际	200,900	1,709,659.00	0.17
236	600062	华润双鹤	65,500	1,705,620.00	0.17
237	002050	三花股份	148,200	1,702,818.00	0.17
238	000735	罗牛山	181,322	1,702,613.58	0.17
239	000422	湖北宜化	183,600	1,694,628.00	0.17
240	000973	佛塑科技	140,995	1,691,940.00	0.17
241	600702	沱牌舍得	64,700	1,689,317.00	0.17
242	002309	中利科技	50,500	1,686,195.00	0.17
243	000848	承德露露	92,300	1,679,860.00	0.17
244	002221	东华能源	56,205	1,676,595.15	0.17
245	002311	海大集团	121,560	1,676,312.40	0.17
246	600859	王府井	53,038	1,670,697.00	0.16
247	002642	荣之联	29,000	1,657,350.00	0.16

248	600826	兰生股份	42,700	1,649,501.00	0.16
249	000979	中弘股份	272,640	1,646,745.60	0.16
250	002396	星网锐捷	51,291	1,646,441.10	0.16
251	002437	誉衡药业	56,373	1,637,635.65	0.16
252	600884	杉杉股份	57,085	1,632,631.00	0.16
253	600736	苏州高新	143,120	1,630,136.80	0.16
254	002155	湖南黄金	131,000	1,628,330.00	0.16
255	000488	晨鸣纸业	181,400	1,627,158.00	0.16
256	600545	新疆城建	108,400	1,627,084.00	0.16
257	002048	宁波华翔	78,200	1,625,778.00	0.16
258	600572	康恩贝	71,454	1,622,005.80	0.16
259	002273	水晶光电	51,400	1,606,250.00	0.16
260	002190	成飞集成	31,400	1,601,086.00	0.16
261	600260	凯乐科技	97,300	1,600,585.00	0.16
262	600004	白云机场	94,400	1,595,360.00	0.16
263	600885	宏发股份	50,900	1,595,206.00	0.16
264	601001	大同煤业	171,836	1,587,764.64	0.16
265	002477	雏鹰农牧	82,359	1,581,292.80	0.16
266	600112	天成控股	82,800	1,573,200.00	0.16
267	600509	天富能源	111,500	1,568,805.00	0.15
268	601002	晋亿实业	99,100	1,567,762.00	0.15
269	002064	华峰氨纶	172,100	1,560,947.00	0.15
270	000861	海印股份	72,600	1,560,174.00	0.15
271	002143	印纪传媒	48,600	1,555,686.00	0.15
272	601369	陕鼓动力	132,650	1,553,331.50	0.15
273	600180	瑞茂通	54,000	1,547,640.00	0.15
274	000099	中信海直	86,900	1,545,082.00	0.15
275	300039	上海凯宝	98,735	1,535,329.25	0.15
276	000975	银泰资源	89,050	1,534,331.50	0.15
277	600351	亚宝药业	113,300	1,534,082.00	0.15

278	600059	古越龙山	99,775	1,528,553.00	0.15
279	000541	佛山照明	132,800	1,523,216.00	0.15
280	002237	恒邦股份	127,000	1,520,190.00	0.15
281	002122	天马股份	142,500	1,517,625.00	0.15
282	600259	广晟有色	25,856	1,516,712.96	0.15
283	002551	尚荣医疗	34,946	1,516,306.94	0.15
284	000550	江铃汽车	41,300	1,515,710.00	0.15
285	600596	新安股份	108,500	1,512,490.00	0.15
286	000926	福星股份	107,000	1,509,770.00	0.15
287	600747	大连控股	190,300	1,509,079.00	0.15
288	600993	马应龙	46,900	1,505,021.00	0.15
289	600790	轻纺城	112,340	1,503,109.20	0.15
290	002251	步步高	61,580	1,502,552.00	0.15
291	000620	新华联	110,300	1,502,286.00	0.15
292	601880	大连港	208,101	1,498,327.20	0.15
293	002431	棕榈园林	51,334	1,489,712.68	0.15
294	600970	中材国际	101,893	1,489,675.66	0.15
295	603019	中科曙光	17,200	1,489,348.00	0.15
296	600761	安徽合力	89,011	1,489,154.03	0.15
297	000697	炼石有色	43,900	1,485,137.00	0.15
298	600416	湘电股份	65,500	1,482,920.00	0.15
299	000900	现代投资	144,400	1,481,544.00	0.15
300	000969	安泰科技	103,000	1,481,140.00	0.15
301	000762	西藏矿业	77,925	1,480,575.00	0.15
302	000600	建投能源	100,700	1,478,276.00	0.15
303	002078	太阳纸业	184,672	1,477,376.00	0.15
304	000877	天山股份	125,900	1,475,548.00	0.15
305	000612	焦作万方	135,100	1,475,292.00	0.15
306	600335	国机汽车	38,566	1,462,808.38	0.14
307	000931	中关村	103,342	1,452,988.52	0.14

308	002482	广田股份	52,700	1,438,710.00	0.14
309	600261	阳光照明	176,935	1,438,481.55	0.14
310	300043	互动娱乐	95,600	1,434,956.00	0.14
311	002463	沪电股份	171,738	1,434,012.30	0.14
312	002384	东山精密	64,300	1,421,673.00	0.14
313	600387	海越股份	55,650	1,420,188.00	0.14
314	600460	士兰微	153,800	1,419,574.00	0.14
315	600298	安琪酵母	40,500	1,408,590.00	0.14
316	600823	世茂股份	107,900	1,405,937.00	0.14
317	000563	陕国投 A	99,800	1,404,186.00	0.14
318	600496	精工钢构	190,280	1,390,946.80	0.14
319	002093	国脉科技	86,928	1,390,848.00	0.14
320	000513	丽珠集团	20,500	1,390,515.00	0.14
321	601233	桐昆股份	69,609	1,389,395.64	0.14
322	002181	粤传媒	94,420	1,387,974.00	0.14
323	600586	金晶科技	201,700	1,387,696.00	0.14
324	000850	华茂股份	126,000	1,383,480.00	0.14
325	002028	思源电气	75,000	1,380,000.00	0.14
326	000417	合肥百货	112,600	1,379,350.00	0.14
327	000636	风华高科	109,900	1,371,552.00	0.14
328	002371	七星电子	35,915	1,364,770.00	0.13
329	000401	冀东水泥	103,600	1,362,340.00	0.13
330	600720	祁连山	128,500	1,360,815.00	0.13
331	002025	航天电器	51,846	1,358,365.20	0.13
332	601908	京运通	64,456	1,352,286.88	0.13
333	600748	上实发展	85,400	1,336,510.00	0.13
334	002672	东江环保	63,050	1,333,507.50	0.13
335	601139	深圳燃气	126,839	1,331,809.50	0.13
336	600292	中电远达	43,553	1,330,108.62	0.13
337	600628	新世界	79,300	1,328,275.00	0.13

338	000961	中南建设	66,502	1,328,044.94	0.13
339	300134	大富科技	47,390	1,324,550.50	0.13
340	002011	盾安环境	91,130	1,320,473.70	0.13
341	600894	广日股份	66,100	1,319,356.00	0.13
342	002203	海亮股份	103,500	1,315,485.00	0.13
343	601886	江河创建	87,900	1,307,952.00	0.13
344	600566	济川药业	44,300	1,305,964.00	0.13
345	603077	和邦股份	62,700	1,304,160.00	0.13
346	600831	广电网络	76,800	1,303,296.00	0.13
347	002479	富春环保	70,500	1,293,675.00	0.13
348	000726	鲁泰A	92,600	1,287,140.00	0.13
349	600776	东方通信	77,800	1,282,922.00	0.13
350	002277	友阿股份	74,500	1,278,420.00	0.13
351	601678	滨化股份	142,172	1,275,282.84	0.13
352	002332	仙琚制药	73,400	1,271,288.00	0.13
353	002698	博实股份	24,076	1,271,212.80	0.13
354	600639	浦东金桥	52,269	1,269,614.01	0.13
355	600251	冠农股份	91,500	1,265,445.00	0.12
356	002373	千方科技	29,200	1,264,068.00	0.12
357	000869	张裕A	25,900	1,263,661.00	0.12
358	601005	重庆钢铁	221,900	1,262,611.00	0.12
359	600729	重庆百货	39,200	1,261,456.00	0.12
360	002233	塔牌集团	72,800	1,256,528.00	0.12
361	002242	九阳股份	64,500	1,254,525.00	0.12
362	600640	号百控股	43,400	1,253,392.00	0.12
363	002249	大洋电机	97,600	1,251,232.00	0.12
364	002041	登海种业	70,170	1,241,307.30	0.12
365	002358	森源电气	57,075	1,225,971.00	0.12
366	002408	齐翔腾达	71,181	1,220,042.34	0.12
367	601777	力帆股份	77,101	1,217,424.79	0.12

368	600078	澄星股份	79,800	1,215,354.00	0.12
369	002342	巨力索具	128,100	1,213,107.00	0.12
370	000919	金陵药业	62,226	1,212,162.48	0.12
371	002480	新筑股份	74,055	1,204,134.30	0.12
372	002588	史丹利	41,800	1,201,750.00	0.12
373	002663	普邦园林	123,523	1,198,173.10	0.12
374	002056	横店东磁	38,300	1,198,024.00	0.12
375	000519	江南红箭	45,700	1,190,942.00	0.12
376	600869	智慧能源	40,800	1,188,912.00	0.12
377	000688	建新矿业	69,600	1,188,072.00	0.12
378	600073	上海梅林	91,400	1,182,716.00	0.12
379	000603	盛达矿业	47,400	1,182,156.00	0.12
380	002317	众生药业	41,766	1,177,383.54	0.12
381	600754	锦江股份	39,500	1,177,100.00	0.12
382	601126	四方股份	38,441	1,172,450.50	0.12
383	600750	江中药业	36,217	1,165,825.23	0.11
384	000049	德赛电池	24,437	1,165,644.90	0.11
385	002254	泰和新材	72,300	1,164,030.00	0.11
386	002503	搜于特	61,300	1,157,344.00	0.11
387	002106	莱宝高科	69,900	1,147,758.00	0.11
388	600874	创业环保	89,900	1,146,225.00	0.11
389	000788	北大医药	54,900	1,137,528.00	0.11
390	600488	天药股份	117,300	1,136,637.00	0.11
391	002727	一心堂	14,515	1,135,653.60	0.11
392	600195	中牧股份	40,273	1,131,671.30	0.11
393	600456	宝钛股份	43,400	1,131,438.00	0.11
394	002574	明牌珠宝	49,400	1,131,260.00	0.11
395	601101	昊华能源	98,860	1,127,004.00	0.11
396	600337	美克家居	75,299	1,124,967.06	0.11
397	600141	兴发集团	65,200	1,123,396.00	0.11



398	600199	金种子酒	79,600	1,114,400.00	0.11
399	002345	潮宏基	56,900	1,114,102.00	0.11
400	600329	中新药业	44,070	1,110,123.30	0.11
401	600636	三爱富	54,600	1,107,288.00	0.11
402	002128	露天煤业	67,185	1,107,208.80	0.11
403	600132	重庆啤酒	49,067	1,104,988.84	0.11
404	600425	青松建化	112,200	1,101,804.00	0.11
405	600997	开滦股份	127,200	1,096,464.00	0.11
406	601801	皖新传媒	37,200	1,085,124.00	0.11
407	000030	富奥股份	93,776	1,084,988.32	0.11
408	002315	焦点科技	11,300	1,084,800.00	0.11
409	600864	哈投股份	66,900	1,083,780.00	0.11
410	000418	小天鹅A	45,100	1,077,890.00	0.11
411	600088	中视传媒	33,300	1,074,591.00	0.11
412	600850	华东电脑	19,100	1,057,949.00	0.10
413	603699	纽威股份	42,305	1,057,201.95	0.10
414	000596	古井贡酒	22,550	1,052,634.00	0.10
415	002204	大连重工	78,700	1,051,432.00	0.10
416	600773	西藏城投	59,600	1,049,556.00	0.10
417	601010	文峰股份	107,350	1,048,809.50	0.10
418	000501	鄂武商A	51,100	1,047,550.00	0.10
419	002646	青青稞酒	35,800	1,044,644.00	0.10
420	600429	三元股份	92,100	1,039,809.00	0.10
421	002293	罗莱家纺	56,550	1,022,989.50	0.10
422	002226	江南化工	77,100	1,016,178.00	0.10
423	600510	黑牡丹	65,100	1,010,352.00	0.10
424	002140	东华科技	45,000	1,006,200.00	0.10
425	002069	獐子岛	50,900	1,005,784.00	0.10
426	002091	江苏国泰	38,300	1,004,226.00	0.10
427	600657	信达地产	121,600	1,001,984.00	0.10

428	000693	华泽钴镍	48,688	1,001,512.16	0.10
429	000426	兴业矿业	59,900	988,949.00	0.10
430	002174	游族网络	10,640	986,966.40	0.10
431	000860	顺鑫农业	43,000	985,130.00	0.10
432	600537	亿晶光电	55,012	984,714.80	0.10
433	603555	贵人鸟	23,361	976,022.58	0.10
434	000823	超声电子	72,400	974,504.00	0.10
435	000951	中国重汽	33,738	972,329.16	0.10
436	600280	中央商场	69,930	969,929.10	0.10
437	002216	三全食品	64,700	951,090.00	0.09
438	603366	日出东方	64,607	949,722.90	0.09
439	603188	亚邦股份	33,100	948,646.00	0.09
440	002461	珠江啤酒	35,900	947,760.00	0.09
441	600971	恒源煤电	103,001	942,459.15	0.09
442	600617	国新能源	51,421	939,461.67	0.09
443	600392	盛和资源	36,800	938,768.00	0.09
444	002267	陕天然气	60,598	938,663.02	0.09
445	002681	奋达科技	34,080	935,836.80	0.09
446	002392	北京利尔	108,300	935,712.00	0.09
447	002194	武汉凡谷	34,277	924,793.46	0.09
448	600803	新奥股份	54,008	924,076.88	0.09
449	600507	方大特钢	101,400	916,656.00	0.09
450	000852	江钻股份	27,006	914,153.10	0.09
451	000525	红太阳	40,741	911,376.17	0.09
452	000921	海信科龙	74,000	902,800.00	0.09
453	002118	紫鑫药业	52,105	901,416.50	0.09
454	000703	恒逸石化	70,303	897,066.28	0.09
455	601515	东风股份	44,400	896,880.00	0.09
456	002240	威华股份	65,600	889,536.00	0.09
457	600551	时代出版	40,820	886,202.20	0.09

458	600780	通宝能源	88,500	859,335.00	0.08
459	002275	桂林三金	33,598	858,764.88	0.08
460	600468	百利电气	36,723	856,013.13	0.08
461	000631	顺发恒业	105,610	854,384.90	0.08
462	002238	天威视讯	35,950	854,172.00	0.08
463	600563	法拉电子	27,000	835,650.00	0.08
464	002393	力生制药	17,999	822,194.32	0.08
465	600743	华远地产	101,300	813,439.00	0.08
466	601208	东材科技	70,800	808,536.00	0.08
467	000962	东方钨业	54,050	799,940.00	0.08
468	002327	富安娜	64,600	797,164.00	0.08
469	002557	洽洽食品	48,000	786,240.00	0.08
470	002678	珠江钢琴	38,500	780,780.00	0.08
471	600397	安源煤业	80,700	780,369.00	0.08
472	000780	平庄能源	82,972	773,299.04	0.08
473	601965	中国汽研	58,300	758,483.00	0.07
474	002281	光迅科技	15,500	745,240.00	0.07
475	002419	天虹商场	43,804	744,668.00	0.07
476	600983	惠而浦	46,400	737,296.00	0.07
477	603001	奥康国际	23,400	730,548.00	0.07
478	002648	卫星石化	47,500	719,150.00	0.07
479	601226	华电重工	44,500	707,995.00	0.07
480	002635	安洁科技	28,100	684,235.00	0.07
481	300147	香雪制药	22,110	680,988.00	0.07
482	603169	兰石重装	36,400	673,036.00	0.07
483	002430	杭氧股份	50,900	672,898.00	0.07
484	600184	光电股份	23,500	661,760.00	0.07
485	000552	靖远煤电	46,500	655,650.00	0.06
486	603005	晶方科技	13,000	635,830.00	0.06
487	600403	大有能源	70,200	627,588.00	0.06

488	601999	出版传媒	44,099	627,087.78	0.06
489	603698	航天工程	15,800	622,836.00	0.06
490	002490	山东墨龙	51,600	619,716.00	0.06
491	002225	濮耐股份	65,400	618,684.00	0.06
492	600618	氯碱化工	45,500	617,890.00	0.06
493	600389	江山股份	19,700	615,428.00	0.06
494	603328	依顿电子	19,000	582,540.00	0.06
495	600333	长春燃气	47,300	566,181.00	0.06
496	000719	大地传媒	22,877	510,614.64	0.05
497	603899	晨光文具	12,100	484,726.00	0.05
498	002705	新宝股份	24,094	452,967.20	0.04
499	002662	京威股份	24,400	435,296.00	0.04
500	600801	华新水泥	39,300	415,401.00	0.04
501	600917	重庆燃气	31,400	396,896.00	0.04
502	603369	今世缘	10,671	395,787.39	0.04
503	000582	北部湾港	17,700	376,479.00	0.04

### 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前五名股票投资明细

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

## 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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	300059	东方财富	25,002,960.00	2.47
2	601099	太平洋	11,525,451.00	1.14
3	300168	万达信息	10,972,413.96	1.08
4	600601	方正科技	8,510,226.82	0.84
5	600219	南山铝业	8,394,656.00	0.83
6	002405	四维图新	8,326,247.71	0.82

7	000592	平潭发展	8,099,929.00	0.80
8	300253	卫宁软件	7,940,484.64	0.78
9	000540	中天城投	7,675,852.54	0.76
10	600881	亚泰集团	7,648,557.40	0.75
11	600037	歌华有线	7,460,555.00	0.74
12	600446	金证股份	7,364,951.00	0.73
13	002030	达安基因	7,104,380.49	0.70
14	600895	张江高科	7,099,320.00	0.70
15	600635	大众公用	6,982,534.52	0.69
16	601519	大智慧	6,823,865.00	0.67
17	600820	隧道股份	6,689,902.00	0.66
18	600158	中体产业	6,616,748.65	0.65
19	000998	隆平高科	6,575,237.00	0.65
20	600021	上海电力	6,465,142.00	0.64

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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	300059	东方财富	25,279,490.76	2.49
2	300168	万达信息	13,888,576.30	1.37
3	601099	太平洋	12,352,532.00	1.22
4	600820	隧道股份	9,333,692.50	0.92
5	000712	锦龙股份	6,452,017.00	0.64
6	601519	大智慧	6,341,912.00	0.63
7	000977	浪潮信息	6,274,509.00	0.62
8	601872	招商轮船	6,264,021.40	0.62
9	600266	北京城建	5,082,597.24	0.50
10	600490	鹏欣资源	4,739,532.00	0.47
11	600317	营口港	4,526,428.49	0.45

12	600582	天地科技	4,523,342.31	0.45
13	600098	广州发展	4,076,520.90	0.40
14	600601	方正科技	3,981,999.12	0.39
15	600219	南山铝业	3,946,113.00	0.39
16	002690	美亚光电	3,926,553.00	0.39
17	600881	亚泰集团	3,741,896.48	0.37
18	000050	深天马 A	3,503,709.00	0.35
19	300253	卫宁软件	3,401,112.80	0.34
20	600200	江苏吴中	3,384,192.60	0.33

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	1,703,148,867.64
卖出股票的收入（成交）总额	801,523,568.59

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	20,122,000.00	1.98
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	—	—
8	其他	—	—
9	合计	20,122,000.00	1.98

## 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	019039	10国债39	200,000	20,122,000.00	1.98

## 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	1,380,614.01
2	应收证券清算款	107,764,491.86
3	应收股利	—
4	应收利息	479,003.81

5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	109,624,109.68

#### 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
1	002183	怡亚通	7,753,900.00	0.76	披露重大事项
2	600978	宜华木业	5,960,064.00	0.59	披露重大事项
3	600410	华胜天成	5,324,592.00	0.53	披露重大事项
4	000748	长城信息	5,221,536.00	0.51	披露重大事项
5	601718	际华集团	5,161,968.00	0.51	披露重大事项
6	000566	海南海药	4,977,012.00	0.49	披露重大事项
7	300144	宋城演艺	4,863,492.00	0.48	披露重大事项
8	600645	中源协和	4,736,598.00	0.47	重大资产重组
9	002223	鱼跃医疗	4,687,872.00	0.46	披露重大事项

##### 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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

#### 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
294,018	2,296.54	10,000,000.00	1.48%	665,223,773.35	98.52%

## 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	336,853.83	0.05%

## 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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	0~10

## 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	1.48%	10,000,000. 00	1.48%	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	1.48%	10,000,000. 00	1.48%	

## § 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
基金合同生效日基金份额总额	—
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	2,186,326,095.96
基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	1,521,102,322.61
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	—
本报告期期末基金份额总额	675,223,773.35

注：总申购份额含转换入份额，总赎回份额含转换出份额。

## § 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，天弘基金管理有限公司(以下简称"本公司")股东会选举井贤栋先生、卢信群先生、袁雷鸣先生、屠剑威先生、付岩先生、郭树强先生、魏新顺先生、张军先生和贺强先生担任新一届董事会董事，其中井贤栋先生、袁雷鸣先生、屠剑威先生、张军先生和贺强先生为新任董事；本公司董事会选举井贤栋先生为新一届董事会董事长（本公司法定代表人）。

以上重大人事变动事宜已经依照相关规定履行备案程序。

本报告期内，本基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。2015年5月21日完成了法定代表人的工商变更登记，由杨德红担任法定代表人。

### 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	2,504,441,165.63	100%	526,937.09	100%	—

### 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	
	成交金额	占当期债券成交总额比例	成交金额	占当期债券回购成交总额比例	成交金额	占当期权证成交总额比例
国泰君安	20,057,000.00	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、报告期内新租用的证券公司交易单元情况：

序号	证券公司名称	所属市场	数量
----	--------	------	----

1	国泰君安证券	上海	1
2	国泰君安证券	深圳	1

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	天弘中证500指数型发起式证券投资基金招募说明书、基金合同、基金合同摘要、基金份额发售公告、托管协议	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站 www.thfund.com.cn	2015-01-15
2	天弘中证500指数型发起式证券投资基金基金合同生效公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站 www.thfund.com.cn	2015-01-21
3	天弘基金管理有限公司关于天弘中证500指数型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回及定期定额投资业务的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站 www.thfund.com.cn	2015-01-22
4	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金开展网上直销申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站 www.thfund.com.cn	2015-01-24
5	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金开展网上直销申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站 www.thfund.com.cn	2015-02-09
6	天弘基金管理有限公司公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站 www.thfund.com.cn	2015-02-26
7	天弘基金管理有限公司公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站 www.thfund.com.cn	2015-02-27
8	天弘基金管理有限公司公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站 www.thfund.com.cn	2015-03-06
9	天弘基金管理有限公司关于旗下基金调整交易所固定收益品种估	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2015-03-27

	值方法的公告	www.thfund.com.cn	
10	天弘基金管理有限公司关于网上直销通联支付渠道新增支持银行卡及实施申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站 www.thfund.com.cn	2015-04-03
11	天弘基金管理有限公司关于网上直销通联支付渠道增加支持银行卡及实施申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站 www.thfund.com.cn	2015-04-07
12	天弘中证500指数型发起式证券投资基金2015年第1季度报告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站 www.thfund.com.cn	2015-04-22
13	关于天弘中证500指数型发起式证券投资基金的更正公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站 www.thfund.com.cn	2015-04-23
14	天弘基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站 www.thfund.com.cn	2015-05-15
15	天弘基金管理有限公司公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站 www.thfund.com.cn	2015-05-19
16	天弘基金管理有限公司公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站 www.thfund.com.cn	2015-05-20
17	天弘基金管理有限公司公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站 www.thfund.com.cn	2015-05-30
18	天弘基金管理有限公司关于网上直销通联支付渠道增加支持银行卡并实施申购及定投费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站 www.thfund.com.cn	2015-06-08
19	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金开通基金转换业务的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站 www.thfund.com.cn	2015-06-11

20	天弘基金管理有限公司关于在天弘基金淘宝官方店开展申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站 www.thfund.com.cn	2015-06-12
21	天弘基金管理有限公司关于旗下基金所持“暴风科技”估值方法调整的提示性公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站 www.thfund.com.cn	2015-06-16
22	天弘基金管理有限公司关于旗下基金开展网上直销转换优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站 www.thfund.com.cn	2015-06-17
23	天弘基金管理有限公司关于在天弘基金淘宝官方店开展申购费率优惠活动的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站 www.thfund.com.cn	2015-06-17
24	天弘基金管理有限公司关于旗下基金所持“皇氏集团”、“天瑞仪器”估值方法调整的提示性公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站 www.thfund.com.cn	2015-06-20
25	天弘基金管理有限公司关于旗下基金所持“东土科技”、“华测检测”、“天神娱乐”估值方法调整的提示性公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站 www.thfund.com.cn	2015-06-26
26	天弘基金管理有限公司关于旗下基金所持“新时达”、“仁和药业”估值方法调整的提示性公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站 www.thfund.com.cn	2015-06-27
27	天弘基金管理有限公司关于旗下基金所持“长荣股份”、“中国天楹”估值方法调整的提示性公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站 www.thfund.com.cn	2015-06-30
28	天弘基金管理有限公司旗下基金2015年6月30日基金资产净值公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站 www.thfund.com.cn	2015-06-30
29	天弘基金管理有限公司关于旗下基金所持“春秋航空”估值方法调整的提示性公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站 www.thfund.com.cn	2015-07-02

30	天弘基金管理有限公司关于旗下基金所持“美盈森”、“建发股份”估值方法调整的提示性公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站 www.thfund.com.cn	2015-07-03
31	天弘基金管理有限公司关于旗下基金所持“沱牌舍得”、“正邦科技”、“长城汽车”、“广博股份”、“万好万家”、“美亚柏科”、“中国国航”、“燃控科技”、“劲嘉股份”估值方法调整的提示性公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站 www.thfund.com.cn	2015-07-04
32	天弘基金管理有限公司关于公司、高管投资旗下基金相关事宜的公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站 www.thfund.com.cn	2015-07-06
33	天弘基金管理有限公司关于旗下基金所持“德尔家居”、“怡亚通”、“华胜天成”、“利欧股份”估值方法调整的提示性公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站 www.thfund.com.cn	2015-07-07
34	天弘基金管理有限公司关于旗下基金所持“华信国际”、“长城信息”、“长江电力”、“兴森科技”、“腾信股份”、“航天电子”和“宋城演艺”估值方法调整的提示性公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站 www.thfund.com.cn	2015-07-08
35	天弘基金管理有限公司关于旗下基金所持“均胜电子”、“圣农发展”、“华英农业”、“益生股份”、“常山药业”、“海澜之家”、“海南海药”、“鱼跃医疗”、“宜华木业”、“广誉远”、“海虹控股”、“盾安环境”、“中顺洁柔”、“金正大”估值方法调整的提示性公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站 www.thfund.com.cn	2015-07-09
36	天弘基金管理有限公司关于旗下基金所持“海南航空”估值方法	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站	2015-07-10

	调整的提示性公告	www.thfund.com.cn	
37	天弘基金管理有限公司关于旗下基金所持“网宿科技”、“天邦股份”、“民和股份”和“深圳机场”估值方法调整的提示性公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站 www.thfund.com.cn	2015-07-11
38	天弘基金管理有限公司关于旗下基金所持“省广股份”、“百润股份”、“海康威视”、“誉衡药业”、“兆驰股份”、“麦趣尔”、“中天城投”、“华夏幸福”估值方法调整的提示性公告	中国证券报、证券时报、上海证券报及公司网站 www.thfund.com.cn	2015-07-14

### § 11 影响投资者决策的其他重要信息

根据天弘基金管理有限公司(以下简称“本公司”)于2015年2月26日发布的公告,本公司的注册资本由人民币1.8亿元增加为人民币5.143亿元,其调整后的股东及持股比例如下:

股东名称	股权比例
浙江蚂蚁小微金融服务集团有限公司	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%

### § 12 备查文件目录

#### 12.1 备查文件目录



- 1、中国证监会批准设立天弘中证500指数型发起式证券投资基金的文件
- 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、中国证监会批准设立天弘基金管理有限公司的文件
- 5、天弘中证500指数型发起式证券投资基金财务报表及报表附注
- 6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告

## 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住所及网站或基金托管人的住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](http://www.thfund.com.cn)

天弘基金管理有限公司

二〇一五年八月二十五日