

天弘中证800指数型发起式证券投资基金2015年年度报告

2015年12月31日

基金管理人：天弘基金管理有限公司

基金托管人：广发证券股份有限公司

送出日期：2016年03月30日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人广发证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年3月25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。

本报告期自2015年7月16日起至2015年12月31日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介.....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告.....	10
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明.....	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明.....	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况.....	14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	16
§5 托管人报告.....	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明.....	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	16
§6 审计报告.....	17
6.1 审计报告基本信息.....	17
6.2 审计报告的基本内容.....	17
§7 年度财务报表.....	18
7.1 资产负债表.....	18
7.2 利润表.....	20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	21
7.4 报表附注.....	22
§8 投资组合报告.....	49
8.1 期末基金资产组合情况.....	49
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	49
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细.....	50
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	76
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	77
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	78
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	78
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	78
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	78
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	78
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	78
8.12 投资组合报告附注.....	78
§9 基金份额持有人信息.....	79
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	79
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	80

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况 .....	80
§10 开放式基金份额变动 .....	81
§11 重大事件揭示 .....	81
11.1 基金份额持有人大会决议 .....	81
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	81
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	81
11.4 基金投资策略的改变 .....	81
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 .....	81
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况 .....	81
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	82
11.8 其他重大事件 .....	82
§12 影响投资者决策的其他重要信息 .....	87
§13 备查文件目录 .....	88
13.1 备查文件目录 .....	88
13.2 存放地点 .....	88
13.3 查阅方式 .....	88

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	天弘中证800指数型发起式证券投资基金	
基金简称	天弘中证800	
基金主代码	001588	
基金运作方式	契约型开放式、发起式	
基金合同生效日	2015年07月16日	
基金管理人	天弘基金管理有限公司	
基金托管人	广发证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	11,263,417.37份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	天弘中证800A	天弘中证800C
下属分级基金的交易代码	001588	001589
报告期末下属分级基金的份 额总额	6,263,417.37份	5,000,000.00份

### 2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。
投资策略	本基金采用完全复制标的指数的方法，进行被动指数化投资。股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合复制标的指数，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，以复制和跟踪标的指数。本基金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	中证800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	广发证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	童建林	王玮
	联系电话	022-83310208	020-87555888-6052
	电子邮箱	service@thfund.com.cn	wwei@gf.com.cn
客户服务电话		4007109999	95575
传真		022-83865569	020-87555129
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	广东省广州市天河区天河北路183-187号大都会广场43楼(4301-4316房)
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	广州市天河北路183号大都会广场41楼
邮政编码		300203	510620
法定代表人		井贤栋	孙树明

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券时报
登载基金年度报告正文的基金管理人互联网网址	www.thfund.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公地址

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	中国上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
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、基金净值表现及利润分配情况

### 3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2015年	2015年
	天弘中证800A	天弘中证800C
本期已实现收益	-199,370.87	-162,053.34
本期利润	-523,828.27	-460,038.90
加权平均基金份额本期利润	-0.0846	-0.0920
本期加权平均净值利润率	-9.54%	-10.35%
本期基金份额净值增长率	-9.09%	-9.20%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末	2015年末
期末可供分配利润	-569,166.35	-460,038.90
期末可供分配基金份额利润	-0.0909	-0.0920
期末基金资产净值	5,694,251.02	4,539,961.10
期末基金份额净值	0.9091	0.9080
3.1.3 累计期末指标	2015年末	2015年末
基金份额累计净值增长率	-9.09%	-9.20%

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、本基金合同于2015年7月16日生效，报告期为2015年7月16日至2015年12月31日。

### 3.2 基金净值表现

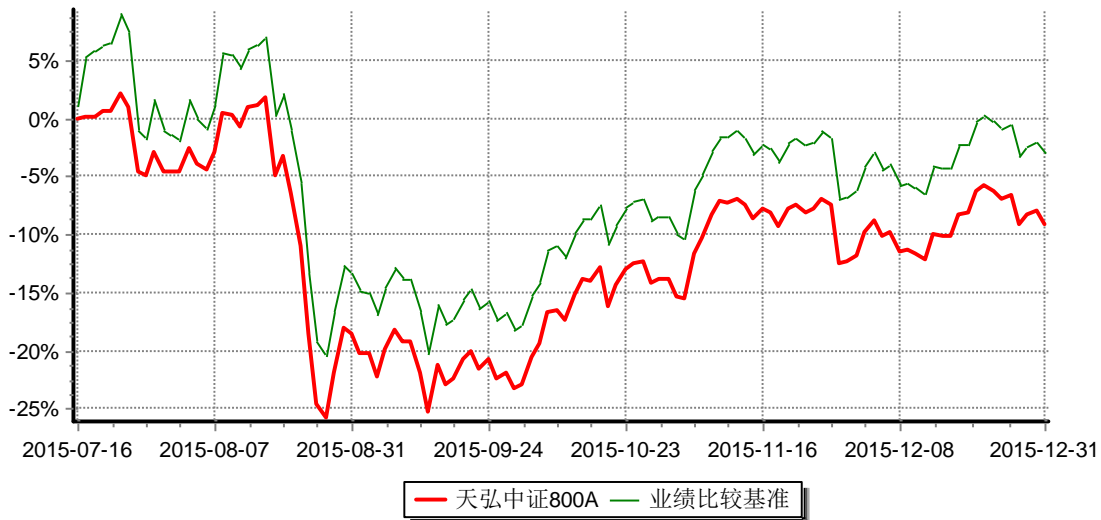
#### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 (天弘中证800A)	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	17.94%	1.67%	17.80%	1.64%	0.14%	0.03%
自基金合同生效日起至今（2015年07月16日-2015年12月31日）	-9.09%	2.32%	-3.10%	2.40%	-5.99%	-0.08%

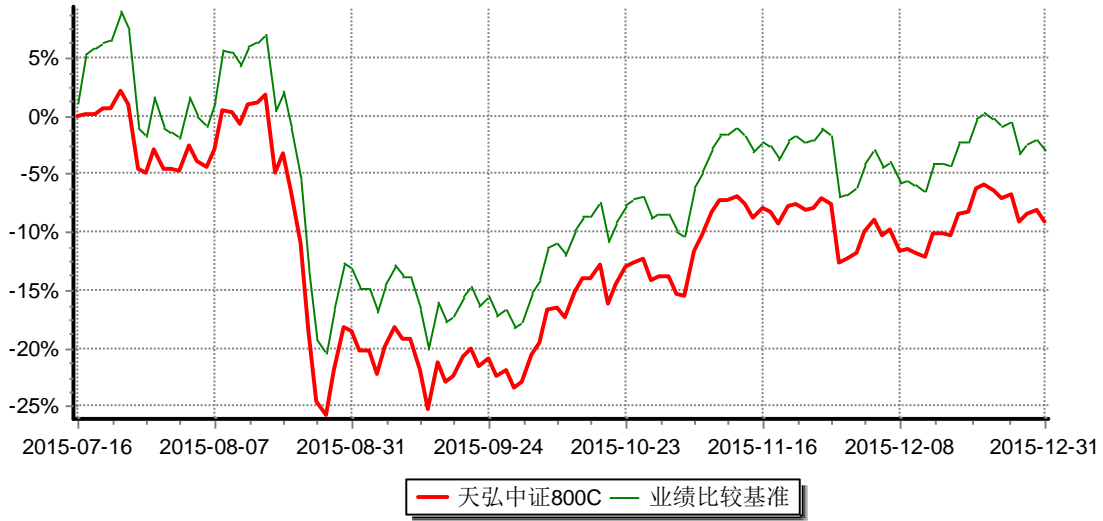
阶段 (天弘中证800C)	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	17.88%	1.67%	17.80%	1.64%	0.08%	0.03%
自基金合同生效日起至今 (2015年07月16日-2015年12月31日)	-9.20%	2.32%	-3.10%	2.40%	-6.10%	-0.08%

注：本基金投资组合的业绩比较基准为：中证800指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。中证800指数成份股由中证500和沪深300成份股一起构成，中证800指数综合反映沪深证券市场内大中小市值公司的整体状况。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800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

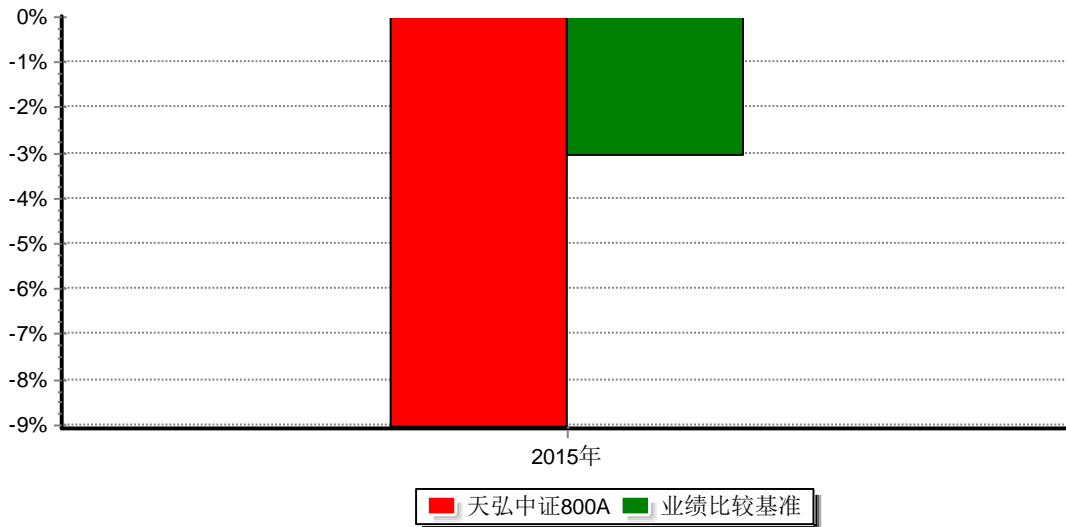


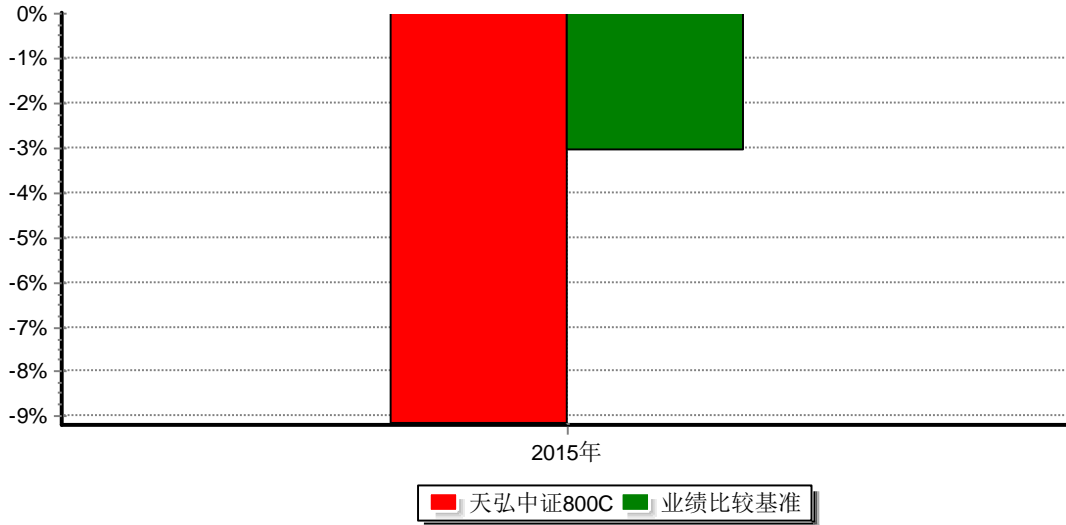




注：1、本基金合同于2015年7月16日生效，本基金合同生效起至披露时点不满1年。  
2、基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。本基金的建仓期为2015年7月16日-2016年1月15日，截止报告日本基金仍处于建仓期。

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





注：本基金合同于2015年7月16日生效。基金合同生效当年2015年的净值增长率按照基金合同生效后当年的实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金于2015年7月16日成立。本基金自基金合同生效以来无利润分配情况，符合相关法规及基金合同的规定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

天弘基金管理有限公司（以下简称“公司”或“本基金管理人”）经中国证监会证监基金字[2004]164号文批准，于2004年11月8日正式成立。注册资本金为5.143亿元人民币，总部设在天津，在北京、上海、广州、天津设有分公司。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12月31日，本基金管理人共管理46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、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、天弘中证银行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、天弘中证休闲娱乐指数型发起式证券投资基金、天弘弘运宝货币市场基金、天弘鑫安宝保本混合型证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘冬	本基金基金经理。	2015年07月	—	9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，历任投资部固定收益研究员、宏观策略研究员、基金经理助理，天弘现金管家货币市场基金基金经理、天弘债券型发起式证券投资基金基金经理、天弘丰利债券型证券投资基金（LOF）基金经理等。
--	--	--	--	--	---

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、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

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

本报告期内，本基金运作合法合规，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

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

##### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

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

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

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

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

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说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金成立日期为2015年7月16日，报告期内，本基金尚在建仓期，经过二季度末与三季度初的市场剧烈波动，停牌股票个数较多，对本基金的跟踪误差有一定影响，进入四季度停牌股票逐步开始复牌，因估值方法对本基金造成的跟踪误差较大偏离的压力逐步开始缓解，跟踪误差逐步缩小；在此期间，本基金根据基金合同的规定，采取对指数的被动复制，结合市场趋势预判与量化分析，优化组合结构的操作策略。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止2015年12月31日，天弘中证800A基金份额净值为0.9091元，天弘中证800C基金份额净值为0.9080元。报告期内份额净值增长率天弘中证800A为-9.09%，天弘中证800C为-9.20%，同期业绩比较基准增长率为-3.10%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2015年经济政策均偏宽松，有多次降息降准，但经济增长情况的回暖并不显著，主要在于经济结构扭曲积累的失衡问题较为明显，单纯的总量宽松政策对经济结构失衡的问题并不十分有效，更多的还是要寄希望于产业结构方面的优化调整；对于16年经济大概率还会维持偏弱的格局，政策层面仍然会维持宽松状态，以减缓经济回落的幅度，由于经济结构层面的优化需要一定时间，短期而言A股市场的盈利水平还是很难有明显的改善，预计16年的市场还是较难有全局性机会，对于指数基金的管理仍然按合同约定的内容，优化操作以体现其工具性的特征。

#### 4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

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

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

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

1、在研究环节，加强研究业务独立性，注重程序合规和质量控制；在关注研究报告形式与内容的合法性基础上，跟踪检查投资备选库的入选、维护依据；进一步规范新

股、新债询价、申购流程；定期检查关联方关系以及关联交易的日常维护；定期评估研究对投资的支持程度，对投资业绩的贡献度；

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

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

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

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

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

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

报告期内，本基金管理人未与任何第三方签定与估值相关的定价服务。

#### **4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

#### **4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明**

本报告期内本基金管理人无应说明预警信息。

### **§ 5 托管人报告**

#### **5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明**

本报告期内，本基金托管人在对天弘中证800指数型发起式证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内，天弘中证800指数型发起式证券投资基金的管理人——天弘基金管理有限公司在天弘中证800指数型发起式证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

本报告期内，天弘中证800指数型发起式证券投资基金未进行利润分配。

#### **5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见**

本托管人依法对天弘基金管理有限公司编制和披露的天弘中证800指数型发起式证券投资基金2015年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投



资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

## § 6 审计报告

### 6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2016)第21859号

### 6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	天弘中证800指数型发起式证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的天弘中证800指数型发起式证券投资基金(以下简称“天弘中证800指数型发起式基金”)的财务报表,包括2015年12月31日的资产负债表、2015年7月16日(基金合同生效日)至2015年12月31日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是天弘中证800指数型发起式基金的基金管理人天弘基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括: (1)按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表,并使其实实现公允反映; (2)设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。

	<p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
审计意见段	<p>我们认为，上述天弘中证800指数型发起式基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了天弘中证800指数型发起式基金2015年12月31日的财务状况以及2015年7月16日(基金合同生效日)至2015年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况。</p>
注册会计师的姓名	薛竞、周祎
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
会计师事务所的地址	中国上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
审计报告日期	2016-03-25

## § 7 年度财务报表

### 7.1 资产负债表

会计主体：天弘中证800指数型发起式证券投资基金

报告截止日：2015年12月31日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2015年12月31日
资 产：		

银行存款	7.4.7.1	732,775.29
结算备付金		1,788.10
存出保证金		9,811.26
交易性金融资产	7.4.7.2	9,583,305.96
其中：股票投资		9,583,305.96
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	7.4.7.3	—
买入返售金融资产	7.4.7.4	—
应收证券清算款		—
应收利息	7.4.7.5	144.32
应收股利		—
应收申购款		379.07
递延所得税资产		—
其他资产	7.4.7.6	—
资产总计		10,328,204.00
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2015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	7.4.7.3	—
卖出回购金融资产款		—
应付证券清算款		13,005.27
应付赎回款		1,186.03
应付管理人报酬		4,351.46
应付托管费		870.27
应付销售服务费		961.96
应付交易费用	7.4.7.7	615.04

应交税费		—
应付利息		—
应付利润		—
递延所得税负债		—
其他负债	7.4.7.8	73,001.85
负债合计		93,991.88
<b>所有者权益：</b>		
实收基金	7.4.7.9	11,263,417.37
未分配利润	7.4.7.10	-1,029,205.25
所有者权益合计		10,234,212.12
负债和所有者权益总计		10,328,204.00

注：1、报告截止日2015年12月31日，天弘中证800指数型发起式证券投资基金A类基金份额净值0.9091元，天弘中证800指数型发起式证券投资基金C类基金份额净值0.9080元，基金份额总额11,263,417.37份，其中天弘中证800指数型发起式证券投资基金A类基金份额6,263,417.37份，天弘中证800指数型发起式证券投资基金C类基金份额5,000,000.00份。

2、本财务报表的实际编制期间为2015年7月16日(基金合同生效日)至2015年12月31日，无上一年度可比期间(下同)。

## 7.2 利润表

会计主体：天弘中证800指数型发起式证券投资基金

本报告期：2015年07月16日至2015年12月31日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期
		2015年07月16日至2015年12月31日
一、收入		-862,970.22
1. 利息收入		5,903.85
其中：存款利息收入	7.4.7.11	5,903.85
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）		-246,938.40
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-262,738.11
基金投资收益		—
债券投资收益	7.4.7.13	—
资产支持证券投资收益		—
贵金属投资收益	7.4.7.14	—
衍生工具收益	7.4.7.15	—
股利收益	7.4.7.16	15,799.71
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-622,442.96
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	507.29
<b>减：二、费用</b>		120,896.95
1. 管理人报酬		22,730.62
2. 托管费		4,546.13
3. 销售服务费		5,075.02
4. 交易费用	7.4.7.19	7,989.53
5. 利息支出		—
其中：卖出回购金融资产支出		—
6. 其他费用	7.4.7.20	80,555.65
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		-983,867.17
减：所得税费用		—
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		-983,867.17

### 7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：天弘中证800指数型发起式证券投资基金

本报告期：2015年07月16日至2015年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2015年07月16日至2015年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	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）	—	-983,867.17	-983,867.17
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	1,263,417.37	-45,338.08	1,218,079.29
其中：1. 基金申购款	3,904,353.94	-339,795.08	3,564,558.86
2. 基金赎回款	-2,640,936.57	294,457.00	-2,346,479.57
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）	11,263,417.37	-1,029,205.25	10,234,212.12

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

郭树强

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

## 7.4 报表附注

### 7.4.1 基金基本情况

天弘中证800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]1339号《关于准予天弘中证800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800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7月15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959号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《天弘中证800指数型发起式证券投资基金基金合同》于2015年7月16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,基金托管人为广发证券股份有限公司。

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800指数型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资对象是具有良好流动性的金融工具,以中证800指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。为更好地实现投资目标,本基金也可少量投资于其他股票(非标的指数成份股及其备选成份股,含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、银行存款、债券、债券回购、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800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800指数收益率 $\times$ 95%+银行活期存款利率(税后) $\times$ 5%。

本财务报表由本基金的基金管理人天弘基金管理有限公司于2016年3月25日批准报出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《天弘中证800指数型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2015年7月16日(基金合同生效日)至2015年12月31日止期间的财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2015年12月31日的财务状况以及2015年7月16日(基金合同生效日)至2015年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况

等有关信息。

#### 7.4.4 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2015年7月16日(基金合同生效日)至2015年12月31日。

##### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

##### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

###### (1) 金融资产的分类

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

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资和衍生工具(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。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其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

###### (2) 金融负债的分类

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

##### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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



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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(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。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

#### 7.4.4.7 实收基金

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

实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

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

#### 7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其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则按直线法计算。

#### 7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

#### 7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### 7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### 7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：  
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》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

#### 7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

##### 7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

##### 7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

##### 7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》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，于2015年9月8日前暂减按25%计入应纳税所得额，自2015年9月8日起，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。

#### 7.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日
活期存款	732,775.29
定期存款	—
其中：存款期限1-3个月	—
其他存款	—
合计	732,775.29

##### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末2015年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	10,205,748.92	9,583,305.96	-622,442.96
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	10,205,748.92	9,583,305.96	-622,442.96

注：截至2015年12月31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。

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融工具。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.1 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因买断式逆回购而取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末2015年12月31日
应收活期存款利息	138.60
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	0.88
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	4.84
合计	144.32

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末2015年12月31日
交易所市场应付交易费用	615.04
银行间市场应付交易费用	—
合计	615.04

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末2015年12月31日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	1.85
预提费用	65,000.00
其他应付	8,000.00
合计	73,001.85

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目 (天弘中证800A)	本期2015年07月16日至2015年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	5,000,000.00	5,000,000.00
本期申购	3,904,353.94	3,904,353.94
本期赎回(以“-”号填列)	-2,640,936.57	-2,640,936.57
本期末	6,263,417.37	6,263,417.37
项目 (天弘中证800C)	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	5,000,000.00	5,000,000.00
本期申购	—	—
本期赎回(以“-”号填列)	—	—
本期末	5,000,000.00	5,000,000.00

注：1、本基金于2015年7月15日公开发售，共募集有效净认购资金10,000,000.00元。

2、根据《天弘中证800指数型发起式证券投资基金招募说明书》、《天弘基金管理有限公司关于天

弘中证800指数型发起式证券投资基金开放日常申购、赎回、定期定额投资业务的公告》以及《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》的相关规定，本基金于2015年7月16日(基金合同生效日)至2015年7月20日止期间暂不向投资人开放基金交易。申购和赎回业务自2015年7月21日起开始办理，转换业务自2015年11月10日起开始办理。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目 (天弘中证800A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	—	—	—
本期利润	-199,370.87	-324,457.40	-523,828.27
本期基金份额交易产生的变动数	3,140.23	-48,478.31	-45,338.08
其中：基金申购款	-38,542.21	-301,252.87	-339,795.08
基金赎回款	41,682.44	252,774.56	294,457.00
本期已分配利润	—	—	—
本期末	-196,230.64	-372,935.71	-569,166.35

单位：人民币元

项目 (天弘中证800C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
基金合同生效日	—	—	—
本期利润	-162,053.34	-297,985.56	-460,038.90
本期基金份额交易产生的变动数	—	—	—
其中：基金申购款	—	—	—
基金赎回款	—	—	—
本期已分配利润	—	—	—
本期末	-162,053.34	-297,985.56	-460,038.90

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年07月16日至2015年12月31日

活期存款利息收入	5,682.40
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	164.37
其他	57.08
合计	5,903.85

#### 7.4.7.12 股票投资收益

##### 7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2015年07月16日至2015年12月31日
股票投资收益——买卖股票 差价收入	-262,738.11
股票投资收益——赎回差价 收入	—
股票投资收益——申购差价 收入	—
合计	-262,738.11

##### 7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期2015年07月16日至2015年12月31日
卖出股票成交总额	2,811,702.80
减：卖出股票成本总额	3,074,440.91
买卖股票差价收入	-262,738.11

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期未取得债券投资收益。

##### 7.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

本基金本报告期未取得资产支持证券投资收益。



7.4.7.14 贵金属投资收益

7.4.7.14.1 贵金属投资收益项目构成

本基金本报告期未取得贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期未取得衍生工具投资收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2015年07月16日至2015年12月31日
股票投资产生的股利收益	15,799.71
基金投资产生的股利收益	—
合计	15,799.71

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2015年07月16日至2015年12月31日
1. 交易性金融资产	-622,442.96
——股票投资	-622,442.96
——债券投资	—
——资产支持证券投资	—
——基金投资	—
——贵金属投资	—
——其他	—
2. 衍生工具	—
——权证投资	—
3. 其他	—
合计	-622,442.96

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年07月16日至2015年12月31日
基金赎回费收入	507.29
合计	507.29

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费归入基金资产的比例按持有期间递减。  
2. 本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费归入转出基金的基金资产的比例按持有期间递减。

#### 7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年07月16日至2015年12月31日
交易所市场交易费用	7,989.53
银行间市场交易费用	—
合计	7,989.53

#### 7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2015年07月16日至2015年12月31日
审计费用	25,000.00
信息披露费	40,000.00
其他费用	500.00
帐户维护费	360.00
指数使用费	14,695.65
合计	80,555.65

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
天弘基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
广发证券股份有限公司(“广发证券”)	基金托管人、基金销售机构
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
天弘创新资产管理有限公司(“天弘创新”)	基金管理人的全资子公司

注：1、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2、2015年度内，本基金管理人股东“内蒙古君正能源化工股份有限公司”的名称变更为“内蒙古君正能源化工集团股份有限公司”。

3、根据本基金管理人于2015年2月26日披露的关于完成增资扩股相关工商变更登记的公告，浙江蚂蚁小微金融服务集团有限公司、新疆天瑞博丰股权投资合伙企业(有限合伙)、新疆天惠新盟股权投资合伙企业(有限合伙)、新疆天阜恒基股权投资合伙企业(有限合伙)、新疆天聚宸兴股权投资合伙企业(有限合伙)为本基金管理人新增股东。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期
-------	----

	2015年07月16日至2015年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
广发证券	16,091,892.63	100.00%

#### 7.4.10.1.2 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。

#### 7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2015年07月16日至2015年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券	3,595.85	100.00%	615.04	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。

#### 7.4.10.2 关联方报酬

##### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2015年07月16日至2015年12月31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	35.98

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0.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值 X 0.50% / 当年天数。

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

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期
	2015年07月16日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	4,546.13

注：支付基金托管人广发证券的托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值 X 0.10% / 当年天数。

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2015年07月16日至2015年12月31日		
	天弘中证800A	天弘中证800C	合计
天弘基金管理有限公司	—	5,075.02	5,075.02
合计	—	5,075.02	5,075.02

注：基金支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值一定比例的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给天弘基金管理有限公司，再由天弘基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.25%。其计算公式为：日销售服务费=前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 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：人民币元

项目	本期	
	2015年07月16日至2015年12月31日	
	天弘中证800A	天弘中证800C
基金合同生效日持有的基	5,000,000.00	5,000,000.00

金份额		
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	5,000,000.00	5,000,000.00
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	44.39%	44.39%

注：基金管理人天弘基金管理有限公司在本年度申购本基金的交易委托直销柜台办理，适用费率为每笔1000元。

#### 7.4.10.4.2 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

本基金本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 7.4.10.5 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07月16日至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
广发证券活期存款	732,775.29	5,682.40

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

#### 7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末在承销期内参与关联方承销证券交易。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

#### 7.4.12 期末（2015年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额
000002	万科A	2015-12-21	重大资产重组	23.98			5,600	82,516.35	134,288.00
300104	乐视网	2015-12-07	重大资产重组	60.18			700	35,146.00	42,126.00
601377	兴业证券	2015-12-29	配股	11.00	2016-01-07	9.40	2,800	31,537.89	30,800.00
600271	航天信息	2015-10-12	重大资产重组	71.46			400	26,679.96	28,584.00
600649	城投控股	2015-12-30	重要事项未公告	23.16	2016-01-07	20.84	1,000	14,114.62	23,160.00
600690	青岛海尔	2015-10-19	重大资产重组	9.92	2016-02-01	8.93	2,100	26,687.64	20,832.00
002465	海格通信	2015-12-30	拟披露重大事项	16.69	2016-02-04	15.02	1,200	21,458.33	20,028.00
601018	宁波港	2015-08-04	重大资产重组	7.63	2016-02-22	7.34	2,000	15,855.00	15,260.00
600654	中安消	2015-12-14	重要事项未公告	28.84			500	15,250.00	14,420.00
600873	梅花生物	2015-12-	重要事项未公告	9.80			1,400	13,319.00	13,720.00

		17							
600584	长电科技	2015-11-30	重大资产重组	22.02			600	12,463.00	13,212.00
600645	中源协和	2015-12-30	重要事项未公告	65.01	2016-01-04	63.90	200	10,616.00	13,002.00
002065	东华软件	2015-12-22	重大事项	25.10			500	13,008.33	12,550.00
000876	新希望	2015-08-17	筹划重大事项	17.63	2016-03-02	17.09	700	13,555.50	12,341.00
002049	同方国芯	2015-12-11	重大资产重组	60.15	2016-03-11	54.14	200	8,908.00	12,030.00
600122	宏图高科	2015-12-25	重要事项未公告	19.42			600	8,862.00	11,652.00
600200	江苏吴中	2015-11-26	重大资产重组	27.89	2016-03-16	25.10	400	8,605.00	11,156.00
002340	格林美	2015-12-29	重大事项	15.20	2016-01-06	14.35	700	10,529.75	10,640.00
600219	南山铝业	2015-09-29	重要事项未公告	6.58	2016-01-25	7.00	1,500	12,342.00	9,870.00
000712	锦龙股份	2015-12-25	重大事项	29.12	2016-01-04	28.00	300	8,331.00	8,736.00
002568	百润股份	2015-12-21	重大事项	42.69	2016-01-18	38.42	200	8,196.00	8,538.00
002143	印纪传媒	2015-12-09	拟披露重大事项	40.55	2016-01-05	36.50	200	7,387.50	8,110.00
6007	鲁信	2015	重要事项	39.07	2016	37.60	200	5,701.00	7,814.00



83	创投	-12-31	未公告		-01-04					
600851	海欣股份	2015-12-21	重大资产重组	14.70	2016-01-19	13.23	500	5,104.72	7,350.00	
300088	长信科技	2015-12-14	重大资产重组	14.03	2016-02-29	12.63	500	4,668.95	7,015.00	
600572	康恩贝	2015-12-28	重要事项未公告	13.36	2016-01-04	13.18	500	8,051.00	6,680.00	
000028	国药一致	2015-10-21	重大资产重组	66.15	2016-03-25	63.05	100	7,998.00	6,615.00	
000973	佛塑科技	2015-12-18	重大事项	13.00	2016-02-22	11.70	500	4,633.17	6,500.00	
300043	互动娱乐	2015-12-17	拟披露重大事项	15.80			400	6,291.75	6,320.00	
600759	洲际油气	2015-09-21	重大资产重组	7.85			800	8,493.82	6,280.00	
000829	天音控股	2015-11-09	重大资产重组	12.22			500	6,495.00	6,110.00	
600578	京能电力	2015-11-05	重大资产重组	6.07	2016-02-24	5.49	1,000	6,787.62	6,070.00	
600859	王府井	2015-12-21	重要事项未公告	27.22	2016-01-04	27.22	200	5,416.00	5,444.00	
601717	郑煤机	2015-12-18	重大资产重组	7.52			700	6,268.00	5,264.00	
002048	宁波华翔	2015-11-19	重大资产重组	17.40			300	5,724.00	5,220.00	

002011	盾安环境	2015-12-28	重大事项	16.72	2016-02-22	15.05	300	4,160.02	5,016.00
002698	博实股份	2015-12-28	重大事项	29.33	2016-01-05	26.40	170	4,820.00	4,986.10
601000	唐山港	2015-10-29	重大资产重组	8.25	2016-02-17	7.98	600	6,060.43	4,950.00
002242	九阳股份	2015-12-24	拟披露重大事项	22.68	2016-01-11	20.41	200	5,823.00	4,536.00
600880	博瑞传播	2015-09-16	重大资产重组	7.50	2016-01-18	8.25	600	7,471.00	4,500.00
600282	南钢股份	2015-12-30	重要事项未公告	3.17	2016-01-12	3.24	1,400	4,242.00	4,438.00
601678	滨化股份	2015-12-31	公司申请停牌对相关事项进行核查	8.02	2016-01-05	7.22	500	4,196.00	4,010.00
600120	浙江东方	2015-10-12	重大资产重组	19.86			200	5,824.00	3,972.00
600699	均胜电子	2015-11-04	重大资产重组	31.25	2016-03-10	29.00	100	2,869.50	3,125.00
000426	兴业矿业	2015-10-28	重大资产重组	7.06	2016-03-21	7.77	400	2,520.00	2,824.00
600429	三元股份	2015-09-21	重大资产重组	7.29	2016-01-27	7.49	300	3,034.00	2,187.00
600864	哈投股份	2015-10-09	重大资产重组	10.88	2016-01-14	11.97	200	2,753.33	2,176.00
0023	七星	2015	拟披露重	19.28	2016	21.21	100	3,180.00	1,928.00

71	电子	-10-08	大事项		-01-11				
002678	珠江钢琴	2015-12-21	非公开发行股票	17.21	2016-01-19	15.49	100	1,919.00	1,721.00

注：本基金截至2015年12月31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。

#### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

##### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2015年12月31日，本基金未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

##### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2015年12月31日，本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 7.4.13 金融工具风险及管理

##### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为指数型基金，采用指数复制投资策略，标的指数为中证100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。

#### 7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在具有基金托管资格的中国建设银行股份有限公司，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2015年12月31日，本基金未持有债券。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场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7.4.12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2015年12月31日，本基金所承担的全部金融负债无固定到期日或合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.4 市场风险

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

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或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。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末2015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	732,775.29	—	—	—	732,775.29
结算备付金	1,788.10	—	—	—	1,788.10
存出保证金	9,811.26	—	—	—	9,811.26
交易性金融资	—	—	—	9,583,305.	9,583,305.

产				96	96
应收利息	—	—	—	144.32	144.32
应收申购款	—	—	—	379.07	379.07
资产总计	744,374.65	—	—	9,583,829.35	10,328,204.00
负债					
应付证券清算款	—	—	—	13,005.27	13,005.27
应付赎回款	—	—	—	1,186.03	1,186.03
应付管理人报酬	—	—	—	4,351.46	4,351.46
应付托管费	—	—	—	870.27	870.27
应付销售服务费	—	—	—	961.96	961.96
应付交易费用	—	—	—	615.04	615.04
其他负债	—	—	—	73,001.85	73,001.85
负债总计	—	—	—	93,991.88	93,991.88
利率敏感度缺口	744,374.65	—	—	9,489,837.47	10,234,212.12

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

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2015年12月31日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

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

市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金采用完全复制法进行指数化投资，股票资产跟踪的标的指数为中证800指数，通过指数化分散投资降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括VaR (Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2015年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	9,583,305.96	93.64
交易性金融资产-基金投资	—	—
交易性金融资产-贵金属投资	—	—
衍生金融资产-权证投资	—	—
其他	—	—
合计	9,583,305.96	93.64

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

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12月31日
1. 业绩比较基准(附注7.4.1)	上升5%	481,007.97
2. 业绩比较基准(附注7.4.1)	下降5%	-481,007.97

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

###### (a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

###### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

###### (i) 各层次金融工具公允价值

于2015年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为8,975,199.86元，属于第二层次的余额为608,106.10元，无属于第三层次的余额。

###### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层次未发生重大变动。

###### (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2015年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

###### (d) 不以公允价值计量的金融工具

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

##### (2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。



## §8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	9,583,305.96	92.79
	其中：股票	9,583,305.96	92.79
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	734,563.39	7.11
7	其他各项资产	10,334.65	0.10
8	合计	10,328,204.00	100.00

### 8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

#### 8.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的股票投资组合

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	58,830.00	0.57
B	采矿业	326,854.00	3.19
C	制造业	3,886,617.10	37.98
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	367,322.60	3.59
E	建筑业	341,513.00	3.34
F	批发和零售业	305,824.00	2.99
G	交通运输、仓储和邮政业	329,029.00	3.21

H	住宿和餐饮业	5,132.00	0.05
I	信息传输、软件和信息技术服务业	582,854.00	5.70
J	金融业	2,326,766.50	22.74
K	房地产业	564,403.06	5.51
L	租赁和商务服务业	129,116.40	1.26
M	科学研究和技术服务业	19,037.00	0.19
N	水利、环境和公共设施管理业	76,705.00	0.75
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	16,428.00	0.16
R	文化、体育和娱乐业	165,791.30	1.62
S	综合	81,083.00	0.79
	合计	9,583,305.96	93.64

### 8.2.2 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。

### 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

#### 8.3.1 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

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	601318	中国平安	7,500	270,000.00	2.64
2	600016	民生银行	20,900	201,476.00	1.97
3	601166	兴业银行	9,000	153,630.00	1.50
4	000002	万科A	5,600	134,288.00	1.31
5	600036	招商银行	7,100	127,729.00	1.25
6	600000	浦发银行	6,600	120,582.00	1.18
7	600030	中信证券	5,400	104,490.00	1.02
8	601328	交通银行	15,600	100,464.00	0.98
9	600837	海通证券	5,700	90,174.00	0.88

10	601288	农业银行	25,900	83,657.00	0.82
11	601766	中国中车	6,300	80,955.00	0.79
12	000651	格力电器	3,400	75,990.00	0.74
13	601169	北京银行	7,200	75,816.00	0.74
14	601398	工商银行	14,800	67,784.00	0.66
15	600887	伊利股份	4,100	67,363.00	0.66
16	601668	中国建筑	10,600	67,204.00	0.66
17	601601	中国太保	2,300	66,378.00	0.65
18	600519	贵州茅台	300	65,457.00	0.64
19	601989	中国重工	6,100	57,340.00	0.56
20	601988	中国银行	14,200	56,942.00	0.56
21	600637	东方明珠	1,300	49,257.00	0.48
22	000333	美的集团	1,500	49,230.00	0.48
23	600104	上汽集团	2,300	48,806.00	0.48
24	000001	平安银行	4,000	47,960.00	0.47
25	000725	京东方A	16,100	47,817.00	0.47
26	601818	光大银行	11,000	46,640.00	0.46
27	600900	长江电力	3,400	46,104.00	0.45
28	600048	保利地产	4,100	43,624.00	0.43
29	600999	招商证券	2,000	43,400.00	0.42
30	601390	中国中铁	3,900	42,588.00	0.42
31	300104	乐视网	700	42,126.00	0.41
32	300059	东方财富	800	41,624.00	0.41
33	601688	华泰证券	2,100	41,412.00	0.40
34	600015	华夏银行	3,400	41,276.00	0.40
35	002024	苏宁云商	3,000	40,350.00	0.39
36	600276	恒瑞医药	800	39,296.00	0.38
37	600518	康美药业	2,200	37,290.00	0.36
38	600050	中国联通	6,000	37,080.00	0.36
39	600028	中国石化	7,400	36,704.00	0.36
40	601006	大秦铁路	4,200	36,204.00	0.35

41	000858	五 粮 液	1,300	35,464.00	0.35
42	002450	康得新	900	34,290.00	0.34
43	601628	中国人寿	1,200	33,972.00	0.33
44	000166	申万宏源	3,100	33,201.00	0.32
45	000063	中兴通讯	1,700	31,671.00	0.31
46	601186	中国铁建	2,300	31,004.00	0.30
47	002415	海康威视	900	30,951.00	0.30
48	601377	兴业证券	2,800	30,800.00	0.30
49	601985	中国核电	3,100	29,574.00	0.29
50	000538	云南白药	400	29,048.00	0.28
51	300027	华谊兄弟	700	29,036.00	0.28
52	600271	航天信息	400	28,584.00	0.28
53	601901	方正证券	2,900	27,840.00	0.27
54	601857	中国石油	3,300	27,555.00	0.27
55	002304	洋河股份	400	27,416.00	0.27
56	000783	长江证券	2,200	27,324.00	0.27
57	000625	长安汽车	1,600	27,152.00	0.27
58	601939	建设银行	4,600	26,588.00	0.26
59	002673	西部证券	800	26,328.00	0.26
60	601211	国泰君安	1,100	26,290.00	0.26
61	000100	TCL 集团	6,100	25,986.00	0.25
62	002594	比亚迪	400	25,760.00	0.25
63	600795	国电电力	6,500	25,545.00	0.25
64	601727	上海电气	2,200	25,388.00	0.25
65	002202	金风科技	1,100	25,069.00	0.24
66	601009	南京银行	1,400	24,780.00	0.24
67	600011	华能国际	2,800	24,444.00	0.24
68	601555	东吴证券	1,500	24,105.00	0.24
69	600585	海螺水泥	1,400	23,940.00	0.23
70	600010	包钢股份	6,600	23,826.00	0.23
71	600100	同方股份	1,300	23,504.00	0.23

72	001979	招商蛇口	1,121	23,384.06	0.23
73	600705	中航资本	1,500	23,370.00	0.23
74	600649	城投控股	1,000	23,160.00	0.23
75	000069	华侨城A	2,600	22,880.00	0.22
76	601099	太平洋	2,300	22,586.00	0.22
77	600893	中航动力	500	22,515.00	0.22
78	601669	中国电建	2,800	22,484.00	0.22
79	600085	同仁堂	500	22,305.00	0.22
80	002230	科大讯飞	600	22,230.00	0.22
81	600383	金地集团	1,600	22,080.00	0.22
82	600703	三安光电	900	21,852.00	0.21
83	601899	紫金矿业	6,200	21,824.00	0.21
84	600340	华夏幸福	700	21,504.00	0.21
85	600485	信威集团	800	21,400.00	0.21
86	000917	电广传媒	800	21,248.00	0.21
87	600089	特变电工	1,800	21,186.00	0.21
88	600111	北方稀土	1,500	21,030.00	0.21
89	601088	中国神华	1,400	20,958.00	0.20
90	600109	国金证券	1,300	20,956.00	0.20
91	000423	东阿阿胶	400	20,920.00	0.20
92	601336	新华保险	400	20,884.00	0.20
93	600690	青岛海尔	2,100	20,832.00	0.20
94	002241	歌尔声学	600	20,760.00	0.20
95	300070	碧水源	400	20,708.00	0.20
96	600009	上海机场	700	20,664.00	0.20
97	300024	机器人	300	20,550.00	0.20
98	600066	宇通客车	900	20,241.00	0.20
99	002142	宁波银行	1,300	20,163.00	0.20
100	002465	海格通信	1,200	20,028.00	0.20
101	601618	中国中冶	3,300	19,866.00	0.19
102	601919	中国远洋	2,200	19,844.00	0.19

103	000768	中航飞机	800	19,816.00	0.19
104	600369	西南证券	2,000	19,800.00	0.19
105	600029	南方航空	2,300	19,711.00	0.19
106	600886	国投电力	2,300	19,205.00	0.19
107	600804	鹏博士	800	18,976.00	0.19
108	600019	宝钢股份	3,400	18,972.00	0.19
109	600196	复星医药	800	18,792.00	0.18
110	600352	浙江龙盛	1,600	18,624.00	0.18
111	002236	大华股份	500	18,450.00	0.18
112	601600	中国铝业	3,700	18,389.00	0.18
113	600415	小商品城	2,000	18,380.00	0.18
114	601788	光大证券	800	18,352.00	0.18
115	600570	恒生电子	300	18,291.00	0.18
116	000559	万向钱潮	800	18,104.00	0.18
117	600739	辽宁成大	800	18,080.00	0.18
118	000728	国元证券	800	18,072.00	0.18
119	000793	华闻传媒	1,200	18,036.00	0.18
120	300017	网宿科技	300	17,997.00	0.18
121	600177	雅戈尔	1,100	17,908.00	0.17
122	601888	中国国旅	300	17,793.00	0.17
123	002736	国信证券	900	17,775.00	0.17
124	600150	中国船舶	500	17,415.00	0.17
125	000338	潍柴动力	1,800	17,388.00	0.17
126	600674	川投能源	1,600	17,216.00	0.17
127	600118	中国卫星	400	17,016.00	0.17
128	000503	海虹控股	500	16,745.00	0.16
129	600115	东方航空	2,200	16,742.00	0.16
130	600406	国电南瑞	1,000	16,680.00	0.16
131	601998	中信银行	2,300	16,606.00	0.16
132	600031	三一重工	2,500	16,450.00	0.16
133	600535	天士力	400	16,368.00	0.16

134	600958	东方证券	700	16,303.00	0.16
135	000009	中国宝安	900	16,164.00	0.16
136	601607	上海医药	800	15,928.00	0.16
137	002252	上海莱士	400	15,908.00	0.16
138	600315	上海家化	400	15,796.00	0.15
139	600068	葛洲坝	2,000	15,740.00	0.15
140	600221	海南航空	4,000	15,560.00	0.15
141	002008	大族激光	600	15,534.00	0.15
142	600718	东软集团	500	15,525.00	0.15
143	002405	四维图新	400	15,520.00	0.15
144	000157	中联重科	2,900	15,515.00	0.15
145	002292	奥飞动漫	300	15,513.00	0.15
146	002456	欧菲光	500	15,510.00	0.15
147	601866	中海集运	2,200	15,488.00	0.15
148	000623	吉林敖东	500	15,475.00	0.15
149	600256	广汇能源	2,300	15,341.00	0.15
150	601018	宁波港	2,000	15,260.00	0.15
151	600660	福耀玻璃	1,000	15,190.00	0.15
152	002153	石基信息	100	15,100.00	0.15
153	600663	陆家嘴	300	15,042.00	0.15
154	600816	安信信托	650	14,800.50	0.14
155	600201	生物股份	400	14,788.00	0.14
156	601800	中国交建	1,100	14,751.00	0.14
157	300058	蓝色光标	1,000	14,730.00	0.14
158	600252	中恒集团	2,000	14,680.00	0.14
159	601111	中国国航	1,700	14,586.00	0.14
160	600654	中安消	500	14,420.00	0.14
161	600895	张江高科	500	14,415.00	0.14
162	601106	中国一重	1,800	14,346.00	0.14
163	000895	双汇发展	700	14,287.00	0.14
164	600309	万华化学	800	14,280.00	0.14

165	600018	上港集团	2,200	14,256.00	0.14
166	600023	浙能电力	1,900	14,231.00	0.14
167	300124	汇川技术	300	14,160.00	0.14
168	601933	永辉超市	1,400	14,140.00	0.14
169	600482	风帆股份	300	14,115.00	0.14
170	600160	巨化股份	600	14,082.00	0.14
171	002466	天齐锂业	100	14,075.00	0.14
172	300315	掌趣科技	1,000	14,000.00	0.14
173	000686	东北证券	800	14,000.00	0.14
174	600398	海澜之家	1,000	13,960.00	0.14
175	600839	四川长虹	2,400	13,896.00	0.14
176	600873	梅花生物	1,400	13,720.00	0.13
177	002500	山西证券	900	13,716.00	0.13
178	600867	通化东宝	500	13,585.00	0.13
179	000568	泸州老窖	500	13,560.00	0.13
180	002385	大北农	1,100	13,431.00	0.13
181	600583	海油工程	1,500	13,425.00	0.13
182	600079	人福医药	600	13,356.00	0.13
183	600584	长电科技	600	13,212.00	0.13
184	600158	中体产业	500	13,040.00	0.13
185	600645	中源协和	200	13,002.00	0.13
186	000750	国海证券	1,000	12,850.00	0.13
187	600642	申能股份	1,700	12,835.00	0.13
188	600635	大众公用	1,300	12,818.00	0.13
189	002439	启明星辰	400	12,800.00	0.13
190	002004	华邦健康	900	12,735.00	0.12
191	600588	用友网络	400	12,724.00	0.12
192	000060	中金岭南	900	12,627.00	0.12
193	601718	际华集团	1,100	12,617.00	0.12
194	002400	省广股份	500	12,575.00	0.12
195	300253	卫宁软件	300	12,564.00	0.12



196	002065	东华软件	500	12,550.00	0.12
197	000046	泛海控股	1,000	12,550.00	0.12
198	002030	达安基因	300	12,354.00	0.12
199	000876	新希望	700	12,341.00	0.12
200	600503	华丽家族	900	12,330.00	0.12
201	000425	徐工机械	2,900	12,325.00	0.12
202	600673	东阳光科	1,200	12,228.00	0.12
203	601021	春秋航空	200	12,200.00	0.12
204	600332	白云山	400	12,108.00	0.12
205	000661	长春高新	100	12,045.00	0.12
206	002276	万马股份	400	12,040.00	0.12
207	002049	同方国芯	200	12,030.00	0.12
208	002739	万达院线	100	12,000.00	0.12
209	601098	中南传媒	500	11,950.00	0.12
210	000826	启迪桑德	300	11,886.00	0.12
211	000998	隆平高科	500	11,875.00	0.12
212	600741	华域汽车	700	11,802.00	0.12
213	000887	中鼎股份	500	11,800.00	0.12
214	600643	爱建集团	800	11,720.00	0.11
215	600820	隧道股份	1,100	11,704.00	0.11
216	000566	海南海药	300	11,658.00	0.11
217	600122	宏图高科	600	11,652.00	0.11
218	300003	乐普医疗	300	11,580.00	0.11
219	600027	华电国际	1,700	11,560.00	0.11
220	000402	金融街	1,000	11,530.00	0.11
221	600522	中天科技	500	11,450.00	0.11
222	600655	豫园商城	700	11,312.00	0.11
223	002701	奥瑞金	400	11,304.00	0.11
224	600525	长园集团	600	11,298.00	0.11
225	002081	金螳螂	600	11,208.00	0.11
226	002422	科伦药业	600	11,160.00	0.11

227	600200	江苏吴中	400	11,156.00	0.11
228	601333	广深铁路	2,200	11,022.00	0.11
229	002129	中环股份	900	10,998.00	0.11
230	600157	永泰能源	2,300	10,971.00	0.11
231	000540	中天城投	1,200	10,944.00	0.11
232	600875	东方电气	800	10,904.00	0.11
233	000413	东旭光电	1,200	10,896.00	0.11
234	601633	长城汽车	900	10,836.00	0.11
235	000415	渤海租赁	1,200	10,824.00	0.11
236	601991	大唐发电	2,100	10,794.00	0.11
237	300144	宋城演艺	381	10,782.30	0.11
238	600879	航天电子	600	10,722.00	0.10
239	002340	格林美	700	10,640.00	0.10
240	601872	招商轮船	1,500	10,635.00	0.10
241	000061	农产品	600	10,614.00	0.10
242	600410	华胜天成	400	10,604.00	0.10
243	600038	中直股份	200	10,546.00	0.10
244	000039	中集集团	500	10,500.00	0.10
245	600547	山东黄金	500	10,500.00	0.10
246	002146	荣盛发展	1,100	10,483.00	0.10
247	300002	神州泰岳	800	10,480.00	0.10
248	000778	新兴铸管	1,600	10,384.00	0.10
249	600388	龙净环保	600	10,368.00	0.10
250	000831	五矿稀土	500	10,350.00	0.10
251	600694	大商股份	200	10,326.00	0.10
252	000792	盐湖股份	400	10,272.00	0.10
253	300072	三聚环保	300	10,191.00	0.10
254	000997	新大陆	400	10,128.00	0.10
255	002038	双鹭药业	300	10,050.00	0.10
256	600376	首开股份	800	10,000.00	0.10
257	600489	中金黄金	1,000	9,930.00	0.10

258	600074	保千里	600	9,882.00	0.10
259	600219	南山铝业	1,500	9,870.00	0.10
260	600198	大唐电信	400	9,868.00	0.10
261	002308	威创股份	400	9,860.00	0.10
262	600372	中航电子	400	9,852.00	0.10
263	600060	海信电器	500	9,835.00	0.10
264	000800	一汽轿车	600	9,822.00	0.10
265	600312	平高电气	500	9,750.00	0.10
266	600688	上海石化	1,500	9,720.00	0.09
267	002085	万丰奥威	300	9,654.00	0.09
268	601117	中国化学	1,400	9,646.00	0.09
269	601168	西部矿业	1,300	9,607.00	0.09
270	300182	捷成股份	400	9,600.00	0.09
271	002475	立讯精密	300	9,585.00	0.09
272	000078	海王生物	400	9,584.00	0.09
273	600487	亨通光电	600	9,564.00	0.09
274	601012	隆基股份	700	9,555.00	0.09
275	600664	哈药股份	800	9,544.00	0.09
276	000629	攀钢钒钛	2,600	9,542.00	0.09
277	600208	新湖中宝	2,000	9,540.00	0.09
278	601179	中国西电	1,400	9,534.00	0.09
279	000547	航天发展	500	9,525.00	0.09
280	000738	中航动控	300	9,486.00	0.09
281	300015	爱尔眼科	300	9,474.00	0.09
282	600143	金发科技	1,100	9,460.00	0.09
283	600362	江西铜业	600	9,444.00	0.09
284	600881	亚泰集团	1,300	9,412.00	0.09
285	600373	中文传媒	400	9,396.00	0.09
286	600005	武钢股份	2,700	9,369.00	0.09
287	000012	南玻A	700	9,345.00	0.09
288	600138	中青旅	400	9,324.00	0.09

289	000709	河北钢铁	2,800	9,324.00	0.09
290	600601	方正科技	1,500	9,270.00	0.09
291	300257	开山股份	300	9,255.00	0.09
292	600026	中海发展	1,000	9,240.00	0.09
293	000718	苏宁环球	700	9,233.00	0.09
294	002191	劲嘉股份	600	9,216.00	0.09
295	000883	湖北能源	1,500	9,210.00	0.09
296	600611	大众交通	600	9,210.00	0.09
297	600170	上海建工	1,300	9,204.00	0.09
298	600770	综艺股份	500	9,135.00	0.09
299	603000	人民网	400	9,124.00	0.09
300	603019	中科曙光	100	9,117.00	0.09
301	300251	光线传媒	300	9,087.00	0.09
302	600499	科达洁能	400	9,052.00	0.09
303	600240	华业资本	600	9,030.00	0.09
304	601238	广汽集团	400	9,028.00	0.09
305	601198	东兴证券	300	8,991.00	0.09
306	002508	老板电器	200	8,990.00	0.09
307	000656	金科股份	1,700	8,976.00	0.09
308	002573	清新环境	400	8,976.00	0.09
309	600500	中化国际	700	8,967.00	0.09
310	600863	内蒙华电	2,000	8,940.00	0.09
311	300133	华策影视	300	8,937.00	0.09
312	600827	百联股份	500	8,935.00	0.09
313	002161	远望谷	400	8,920.00	0.09
314	000930	中粮生化	600	8,868.00	0.09
315	600021	上海电力	600	8,832.00	0.09
316	000690	宝新能源	900	8,802.00	0.09
317	002007	华兰生物	200	8,800.00	0.09
318	600478	科力远	400	8,768.00	0.09
319	600516	方大炭素	700	8,757.00	0.09

320	600418	江淮汽车	600	8,754.00	0.09
321	000712	锦龙股份	300	8,736.00	0.09
322	002022	科华生物	300	8,730.00	0.09
323	300055	万邦达	400	8,684.00	0.08
324	002489	浙江永强	800	8,672.00	0.08
325	601929	吉视传媒	1,400	8,652.00	0.08
326	601258	庞大集团	2,200	8,624.00	0.08
327	600435	北方导航	300	8,610.00	0.08
328	000630	铜陵有色	2,400	8,592.00	0.08
329	600498	烽火通信	300	8,553.00	0.08
330	000598	兴蓉环境	1,200	8,544.00	0.08
331	002568	百润股份	200	8,538.00	0.08
332	600017	日照港	1,300	8,502.00	0.08
333	600094	大名城	800	8,496.00	0.08
334	000050	深天马A	400	8,484.00	0.08
335	600594	益佰制药	400	8,480.00	0.08
336	600171	上海贝岭	400	8,476.00	0.08
337	000988	华工科技	400	8,472.00	0.08
338	000031	中粮地产	600	8,430.00	0.08
339	000970	中科三环	600	8,418.00	0.08
340	000541	佛山照明	500	8,350.00	0.08
341	000697	炼石有色	300	8,346.00	0.08
342	002444	巨星科技	400	8,280.00	0.08
343	000729	燕京啤酒	1,000	8,230.00	0.08
344	300274	阳光电源	300	8,226.00	0.08
345	600959	江苏有线	400	8,224.00	0.08
346	000511	烯碳新材	700	8,197.00	0.08
347	000963	华东医药	100	8,196.00	0.08
348	000999	华润三九	300	8,190.00	0.08
349	600325	华发股份	500	8,150.00	0.08
350	002266	浙富控股	1,000	8,140.00	0.08

351	002470	金正大	400	8,136.00	0.08
352	000671	阳光城	900	8,127.00	0.08
353	002273	水晶光电	200	8,120.00	0.08
354	002143	印纪传媒	200	8,110.00	0.08
355	600108	亚盛集团	1,100	8,074.00	0.08
356	000006	深振业A	700	8,057.00	0.08
357	603993	洛阳钼业	1,800	8,028.00	0.08
358	002657	中科金财	100	7,999.00	0.08
359	000592	平潭发展	400	7,992.00	0.08
360	601928	凤凰传媒	500	7,965.00	0.08
361	600422	昆药集团	200	7,964.00	0.08
362	000762	西藏矿业	300	7,890.00	0.08
363	600648	外高桥	300	7,881.00	0.08
364	601898	中煤能源	1,300	7,865.00	0.08
365	000616	海航投资	1,000	7,860.00	0.08
366	000027	深圳能源	800	7,848.00	0.08
367	600884	杉杉股份	200	7,848.00	0.08
368	002325	洪涛股份	500	7,815.00	0.08
369	600783	鲁信创投	200	7,814.00	0.08
370	600811	东方集团	900	7,812.00	0.08
371	002271	东方雨虹	400	7,812.00	0.08
372	000400	许继电气	400	7,772.00	0.08
373	600497	驰宏锌锗	700	7,728.00	0.08
374	300146	汤臣倍健	200	7,700.00	0.08
375	002223	鱼跃医疗	200	7,690.00	0.08
376	600176	中国巨石	300	7,623.00	0.07
377	600521	华海药业	300	7,617.00	0.07
378	002353	杰瑞股份	300	7,614.00	0.07
379	000681	视觉中国	200	7,602.00	0.07
380	600166	福田汽车	1,200	7,596.00	0.07
381	002179	中航光电	200	7,592.00	0.07

382	600511	国药股份	200	7,584.00	0.07
383	600064	南京高科	400	7,580.00	0.07
384	002250	联化科技	400	7,548.00	0.07
385	600633	浙报传媒	400	7,532.00	0.07
386	300147	香雪制药	300	7,503.00	0.07
387	601992	金隅股份	800	7,496.00	0.07
388	600755	厦门国贸	800	7,456.00	0.07
389	000581	威孚高科	300	7,428.00	0.07
390	600151	航天机电	600	7,416.00	0.07
391	002195	二三四五	200	7,400.00	0.07
392	300199	翰宇药业	300	7,389.00	0.07
393	600851	海欣股份	500	7,350.00	0.07
394	000732	泰禾集团	300	7,350.00	0.07
395	300122	智飞生物	200	7,276.00	0.07
396	002410	广联达	400	7,272.00	0.07
397	600587	新华医疗	200	7,266.00	0.07
398	600536	中国软件	200	7,216.00	0.07
399	600426	华鲁恒升	500	7,215.00	0.07
400	000939	凯迪生态	500	7,200.00	0.07
401	600797	浙大网新	500	7,190.00	0.07
402	002390	信邦制药	500	7,175.00	0.07
403	600528	中铁二局	500	7,165.00	0.07
404	600320	振华重工	1,200	7,164.00	0.07
405	600008	首创股份	700	7,133.00	0.07
406	300291	华录百纳	200	7,120.00	0.07
407	603766	隆鑫通用	300	7,119.00	0.07
408	600967	北方创业	400	7,100.00	0.07
409	002005	德豪润达	700	7,098.00	0.07
410	603883	老百姓	100	7,097.00	0.07
411	002399	海普瑞	200	7,074.00	0.07
412	603288	海天味业	200	7,070.00	0.07

413	600704	物产中大	400	7,048.00	0.07
414	600787	中储股份	700	7,028.00	0.07
415	300088	长信科技	500	7,015.00	0.07
416	600316	洪都航空	300	7,002.00	0.07
417	600161	天坛生物	200	6,986.00	0.07
418	002001	新和成	400	6,976.00	0.07
419	000825	太钢不锈	1,700	6,970.00	0.07
420	300244	迪安诊断	100	6,954.00	0.07
421	000667	美好集团	1,400	6,944.00	0.07
422	600380	健康元	500	6,910.00	0.07
423	001696	宗申动力	500	6,910.00	0.07
424	600169	太原重工	1,200	6,888.00	0.07
425	600436	片仔癀	100	6,879.00	0.07
426	600058	五矿发展	300	6,810.00	0.07
427	002595	豪迈科技	300	6,807.00	0.07
428	601225	陕西煤业	1,400	6,804.00	0.07
429	002013	中航机电	300	6,798.00	0.07
430	002217	合力泰	400	6,780.00	0.07
431	600717	天津港	600	6,762.00	0.07
432	002073	软控股份	400	6,760.00	0.07
433	000926	福星股份	400	6,736.00	0.07
434	300267	尔康制药	200	6,720.00	0.07
435	300115	长盈精密	200	6,714.00	0.07
436	002368	太极股份	100	6,710.00	0.07
437	002498	汉缆股份	900	6,696.00	0.07
438	000983	西山煤电	1,100	6,688.00	0.07
439	600572	康恩贝	500	6,680.00	0.07
440	000816	智慧农业	800	6,672.00	0.07
441	600317	营口港	1,400	6,650.00	0.06
442	600600	青岛啤酒	200	6,640.00	0.06
443	600808	马钢股份	2,100	6,615.00	0.06



444	000028	国药一致	100	6,615.00	0.06
445	000543	皖能电力	780	6,606.60	0.06
446	002299	圣农发展	300	6,597.00	0.06
447	600366	宁波韵升	300	6,552.00	0.06
448	601311	骆驼股份	300	6,549.00	0.06
449	600175	美都能源	900	6,507.00	0.06
450	002588	史丹利	200	6,506.00	0.06
451	000973	佛塑科技	500	6,500.00	0.06
452	002285	世联行	400	6,492.00	0.06
453	002281	光迅科技	100	6,483.00	0.06
454	300202	聚龙股份	200	6,438.00	0.06
455	000860	顺鑫农业	300	6,390.00	0.06
456	002050	三花股份	600	6,390.00	0.06
457	000587	金叶珠宝	300	6,375.00	0.06
458	600597	光明乳业	400	6,368.00	0.06
459	002244	滨江集团	800	6,368.00	0.06
460	002063	远光软件	300	6,342.00	0.06
461	000650	仁和药业	600	6,342.00	0.06
462	600267	海正药业	400	6,340.00	0.06
463	300026	红日药业	300	6,330.00	0.06
464	600805	悦达投资	500	6,330.00	0.06
465	600517	置信电气	500	6,330.00	0.06
466	300043	互动娱乐	400	6,320.00	0.06
467	002375	亚厦股份	400	6,308.00	0.06
468	600759	洲际油气	800	6,280.00	0.06
469	000777	中核科技	200	6,278.00	0.06
470	300273	和佳股份	300	6,270.00	0.06
471	600351	亚宝药业	400	6,248.00	0.06
472	600416	湘电股份	300	6,219.00	0.06
473	600187	国中水务	1,000	6,210.00	0.06
474	601808	中海油服	400	6,208.00	0.06

475	600292	中电远达	300	6,204.00	0.06
476	000898	鞍钢股份	1,300	6,201.00	0.06
477	600580	卧龙电气	400	6,168.00	0.06
478	601608	中信重工	900	6,165.00	0.06
479	002092	中泰化学	700	6,160.00	0.06
480	600428	中远航运	600	6,156.00	0.06
481	002344	海宁皮城	400	6,136.00	0.06
482	600039	四川路桥	1,200	6,120.00	0.06
483	600067	冠城大通	700	6,118.00	0.06
484	000829	天音控股	500	6,110.00	0.06
485	002665	首航节能	200	6,100.00	0.06
486	002414	高德红外	200	6,094.00	0.06
487	002428	云南锗业	300	6,084.00	0.06
488	600578	京能电力	1,000	6,070.00	0.06
489	600835	上海机电	200	6,062.00	0.06
490	002672	东江环保	300	6,051.00	0.06
491	002437	誉衡药业	200	6,050.00	0.06
492	601118	海南橡胶	800	6,048.00	0.06
493	000563	陕国投A	400	6,048.00	0.06
494	002269	美邦服饰	900	6,039.00	0.06
495	000021	深科技	500	6,030.00	0.06
496	000861	海印股份	780	6,029.40	0.06
497	002294	信立泰	200	6,024.00	0.06
498	300134	大富科技	200	6,020.00	0.06
499	002384	东山精密	300	6,006.00	0.06
500	600894	广日股份	300	5,997.00	0.06
501	600885	宏发股份	200	5,978.00	0.06
502	600970	中材国际	500	5,975.00	0.06
503	000758	中色股份	400	5,952.00	0.06
504	002168	深圳惠程	500	5,915.00	0.06
505	600289	亿阳信通	300	5,910.00	0.06

506	600651	飞乐音响	400	5,900.00	0.06
507	600765	中航重机	300	5,892.00	0.06
508	002482	广田股份	200	5,850.00	0.06
509	601958	金钼股份	700	5,796.00	0.06
510	002642	荣之联	100	5,789.00	0.06
511	002727	一心堂	100	5,783.00	0.06
512	000513	丽珠集团	100	5,743.00	0.06
513	600433	冠豪高新	500	5,730.00	0.06
514	002440	闰土股份	300	5,715.00	0.06
515	000049	德赛电池	100	5,678.00	0.06
516	000685	中山公用	400	5,660.00	0.06
517	600549	厦门钨业	300	5,643.00	0.06
518	300085	银之杰	100	5,590.00	0.05
519	002311	海大集团	400	5,588.00	0.05
520	600566	济川药业	200	5,532.00	0.05
521	600125	铁龙物流	600	5,514.00	0.05
522	600284	浦东建设	400	5,476.00	0.05
523	600859	王府井	200	5,444.00	0.05
524	002603	以岭药业	300	5,439.00	0.05
525	600481	双良节能	600	5,436.00	0.05
526	600628	新世界	300	5,427.00	0.05
527	600270	外运发展	200	5,412.00	0.05
528	002431	棕榈园林	200	5,368.00	0.05
529	601880	大连港	900	5,364.00	0.05
530	000680	山推股份	700	5,355.00	0.05
531	000488	晨鸣纸业	600	5,352.00	0.05
532	000600	建投能源	500	5,330.00	0.05
533	600458	时代新材	300	5,310.00	0.05
534	601717	郑煤机	700	5,264.00	0.05
535	002048	宁波华翔	300	5,220.00	0.05
536	601777	力帆股份	300	5,202.00	0.05

537	000979	中弘股份	1,300	5,200.00	0.05
538	002025	航天电器	200	5,198.00	0.05
539	000969	安泰科技	400	5,192.00	0.05
540	002064	华峰氨纶	800	5,192.00	0.05
541	603567	珍宝岛	100	5,180.00	0.05
542	600348	阳泉煤业	800	5,168.00	0.05
543	002463	沪电股份	800	5,168.00	0.05
544	600812	华北制药	600	5,166.00	0.05
545	600220	江苏阳光	900	5,166.00	0.05
546	600850	华东电脑	100	5,165.00	0.05
547	601699	潞安环能	800	5,136.00	0.05
548	600754	锦江股份	100	5,132.00	0.05
549	000897	津滨发展	900	5,130.00	0.05
550	000572	海马汽车	800	5,120.00	0.05
551	000090	天健集团	300	5,106.00	0.05
552	000519	江南红箭	300	5,094.00	0.05
553	002505	大康牧业	600	5,094.00	0.05
554	000931	中关村	400	5,080.00	0.05
555	002477	雏鹰农牧	300	5,073.00	0.05
556	002051	中工国际	200	5,066.00	0.05
557	002345	潮宏基	300	5,064.00	0.05
558	603005	晶方科技	100	5,030.00	0.05
559	600112	天成控股	300	5,028.00	0.05
560	002011	盾安环境	300	5,016.00	0.05
561	000975	银泰资源	400	5,008.00	0.05
562	600557	康缘药业	200	5,004.00	0.05
563	000652	泰达股份	700	4,991.00	0.05
564	600056	中国医药	300	4,989.00	0.05
565	002698	博实股份	170	4,986.10	0.05
566	000848	承德露露	300	4,950.00	0.05
567	601000	唐山港	600	4,950.00	0.05

568	600216	浙江医药	400	4,948.00	0.05
569	600183	生益科技	500	4,945.00	0.05
570	600086	东方金钰	400	4,924.00	0.05
571	600823	世茂股份	400	4,892.00	0.05
572	002251	步步高	300	4,890.00	0.05
573	000830	鲁西化工	700	4,851.00	0.05
574	002396	星网锐捷	200	4,830.00	0.05
575	002254	泰和新材	300	4,767.00	0.05
576	002028	思源电气	300	4,767.00	0.05
577	000786	北新建材	400	4,760.00	0.05
578	002181	粤传媒	300	4,755.00	0.05
579	600831	广电网络	300	4,743.00	0.05
580	603077	和邦生物	700	4,711.00	0.05
581	002714	牧原股份	100	4,707.00	0.05
582	600872	中炬高新	300	4,695.00	0.05
583	600337	美克家居	300	4,686.00	0.05
584	002221	东华能源	200	4,676.00	0.05
585	600614	鼎立股份	400	4,652.00	0.05
586	600409	三友化工	600	4,650.00	0.05
587	000961	中南建设	300	4,638.00	0.05
588	002180	艾派克	100	4,615.00	0.05
589	601005	重庆钢铁	1,400	4,606.00	0.05
590	000869	张裕A	100	4,578.00	0.04
591	000612	焦作万方	600	4,578.00	0.04
592	002373	千方科技	100	4,575.00	0.04
593	600062	华润双鹤	200	4,562.00	0.04
594	002242	九阳股份	200	4,536.00	0.04
595	600880	博瑞传播	600	4,500.00	0.04
596	002155	湖南黄金	500	4,495.00	0.04
597	600260	凯乐科技	300	4,482.00	0.04
598	600639	浦东金桥	200	4,478.00	0.04

599	603188	亚邦股份	200	4,476.00	0.04
600	600280	中央商场	400	4,468.00	0.04
601	000669	金鸿能源	200	4,466.00	0.04
602	002093	国脉科技	300	4,464.00	0.04
603	600282	南钢股份	1,400	4,438.00	0.04
604	000099	中信海直	300	4,434.00	0.04
605	600006	东风汽车	500	4,430.00	0.04
606	600545	新疆城建	400	4,428.00	0.04
607	600460	士兰微	500	4,425.00	0.04
608	600180	瑞茂通	200	4,416.00	0.04
609	000539	粤电力A	600	4,410.00	0.04
610	600993	马应龙	200	4,404.00	0.04
611	600736	苏州高新	400	4,400.00	0.04
612	600757	长江传媒	400	4,392.00	0.04
613	002653	海思科	200	4,378.00	0.04
614	002190	成飞集成	100	4,376.00	0.04
615	002681	奋达科技	100	4,370.00	0.04
616	603699	纽威股份	200	4,364.00	0.04
617	601010	文峰股份	600	4,362.00	0.04
618	000401	冀东水泥	400	4,360.00	0.04
619	000088	盐田港	500	4,310.00	0.04
620	600300	维维股份	600	4,302.00	0.04
621	000501	鄂武商A	200	4,280.00	0.04
622	600586	金晶科技	700	4,277.00	0.04
623	600004	白云机场	300	4,269.00	0.04
624	600073	上海梅林	300	4,245.00	0.04
625	600329	中新药业	200	4,236.00	0.04
626	600496	精工钢构	700	4,207.00	0.04
627	000900	现代投资	500	4,195.00	0.04
628	002277	友阿股份	300	4,167.00	0.04
629	600563	法拉电子	100	4,161.00	0.04

630	300039	上海凯宝	300	4,158.00	0.04
631	000528	柳 工	500	4,145.00	0.04
632	002029	七 匹 狼	300	4,101.00	0.04
633	600596	新安股份	400	4,080.00	0.04
634	600790	轻纺城	500	4,065.00	0.04
635	000726	鲁 泰 A	300	4,056.00	0.04
636	000620	新华联	400	4,044.00	0.04
637	600748	上实发展	300	4,026.00	0.04
638	002479	富春环保	300	4,020.00	0.04
639	601678	滨化股份	500	4,010.00	0.04
640	600761	安徽合力	300	4,005.00	0.04
641	002106	莱宝高科	300	4,002.00	0.04
642	002237	恒邦股份	400	3,992.00	0.04
643	601126	四方股份	300	3,984.00	0.04
644	000933	神火股份	800	3,984.00	0.04
645	002317	众生药业	300	3,972.00	0.04
646	600120	浙江东方	200	3,972.00	0.04
647	002663	普邦园林	500	3,970.00	0.04
648	000631	顺发恒业	400	3,968.00	0.04
649	600259	广晟有色	100	3,960.00	0.04
650	601233	桐昆股份	300	3,945.00	0.04
651	002078	太阳纸业	700	3,941.00	0.04
652	600509	天富能源	400	3,924.00	0.04
653	600998	九州通	200	3,920.00	0.04
654	002118	紫鑫药业	200	3,902.00	0.04
655	600809	山西汾酒	200	3,854.00	0.04
656	600869	智慧能源	400	3,820.00	0.04
657	002342	巨力索具	500	3,805.00	0.04
658	601886	江河创建	300	3,783.00	0.04
659	002309	中利科技	200	3,756.00	0.04
660	600236	桂冠电力	500	3,740.00	0.04

661	601158	重庆水务	400	3,732.00	0.04
662	600022	山东钢铁	1,200	3,732.00	0.04
663	601666	平煤股份	800	3,728.00	0.04
664	000693	华泽钴镍	200	3,726.00	0.04
665	600575	皖江物流	600	3,714.00	0.04
666	600392	盛和资源	300	3,693.00	0.04
667	002358	森源电气	200	3,690.00	0.04
668	000062	深圳华强	100	3,660.00	0.04
669	000596	古井贡酒	100	3,650.00	0.04
670	002293	罗莱生活	200	3,648.00	0.04
671	600773	西藏城投	200	3,640.00	0.04
672	000603	盛达矿业	200	3,610.00	0.04
673	002327	富安娜	300	3,609.00	0.04
674	600825	新华传媒	300	3,582.00	0.04
675	600350	山东高速	500	3,555.00	0.03
676	603555	贵人鸟	100	3,543.00	0.03
677	600720	祁连山	400	3,532.00	0.03
678	600750	江中药业	100	3,529.00	0.03
679	000937	冀中能源	700	3,528.00	0.03
680	603698	航天工程	100	3,505.00	0.03
681	600425	青松建化	600	3,504.00	0.03
682	601369	陕鼓动力	400	3,496.00	0.03
683	600657	信达地产	500	3,475.00	0.03
684	601002	晋亿实业	300	3,459.00	0.03
685	600826	兰生股份	100	3,444.00	0.03
686	000919	金陵药业	200	3,440.00	0.03
687	600483	福能股份	200	3,438.00	0.03
688	600776	东方通信	300	3,432.00	0.03
689	000636	风华高科	300	3,423.00	0.03
690	603885	吉祥航空	100	3,417.00	0.03
691	600251	冠农股份	300	3,390.00	0.03



692	600743	华远地产	500	3,390.00	0.03
693	002041	登海种业	200	3,370.00	0.03
694	603001	奥康国际	100	3,362.00	0.03
695	603369	今世缘	100	3,353.00	0.03
696	000703	恒逸石化	300	3,333.00	0.03
697	002122	天马股份	400	3,332.00	0.03
698	601001	大同煤业	600	3,330.00	0.03
699	601515	东风股份	200	3,316.00	0.03
700	002203	海亮股份	300	3,300.00	0.03
701	002551	尚荣医疗	100	3,297.00	0.03
702	600059	古越龙山	300	3,297.00	0.03
703	601908	京运通	400	3,288.00	0.03
704	600395	盘江股份	400	3,284.00	0.03
705	000156	华数传媒	100	3,280.00	0.03
706	000417	合肥百货	300	3,279.00	0.03
707	601801	皖新传媒	100	3,268.00	0.03
708	600618	氯碱化工	200	3,228.00	0.03
709	000877	天山股份	400	3,212.00	0.03
710	600132	重庆啤酒	200	3,198.00	0.03
711	600803	新奥股份	200	3,172.00	0.03
712	002503	搜于特	200	3,168.00	0.03
713	600874	创业环保	300	3,165.00	0.03
714	600699	均胜电子	100	3,125.00	0.03
715	002392	北京利尔	400	3,112.00	0.03
716	600546	山煤国际	700	3,101.00	0.03
717	002493	荣盛石化	200	3,100.00	0.03
718	600617	国新能源	200	3,066.00	0.03
719	000030	富奥股份	300	3,060.00	0.03
720	600298	安琪酵母	100	3,042.00	0.03
721	002332	仙琚制药	200	3,030.00	0.03
722	600088	中视传媒	100	3,011.00	0.03

723	002204	大连重工	300	3,000.00	0.03
724	000550	江铃汽车	100	2,998.00	0.03
725	600537	亿晶光电	200	2,996.00	0.03
726	603328	依顿电子	100	2,951.00	0.03
727	002233	塔牌集团	200	2,930.00	0.03
728	600141	兴发集团	200	2,924.00	0.03
729	600397	安源煤业	500	2,920.00	0.03
730	601231	环旭电子	200	2,892.00	0.03
731	600184	光电股份	100	2,891.00	0.03
732	600188	兖州煤业	300	2,835.00	0.03
733	000426	兴业矿业	400	2,824.00	0.03
734	601965	中国汽研	300	2,817.00	0.03
735	002056	横店东磁	100	2,811.00	0.03
736	002635	安洁科技	100	2,780.00	0.03
737	601139	深圳燃气	300	2,730.00	0.03
738	002419	天虹商场	200	2,700.00	0.03
739	002408	齐翔腾达	200	2,662.00	0.03
740	601226	华电重工	200	2,530.00	0.02
741	002267	陕天然气	200	2,520.00	0.02
742	600507	方大特钢	400	2,440.00	0.02
743	600510	黑牡丹	200	2,406.00	0.02
744	000418	小天鹅A	100	2,400.00	0.02
745	601101	昊华能源	300	2,358.00	0.02
746	002430	杭氧股份	200	2,300.00	0.02
747	002646	青青稞酒	100	2,282.00	0.02
748	002216	三全食品	200	2,278.00	0.02
749	600551	时代出版	100	2,275.00	0.02
750	000582	北部湾港	100	2,251.00	0.02
751	600997	开滦股份	400	2,232.00	0.02
752	002238	天威视讯	100	2,220.00	0.02
753	600429	三元股份	300	2,187.00	0.02

754	600864	哈投股份	200	2,176.00	0.02
755	002648	卫星石化	200	2,162.00	0.02
756	600195	中牧股份	100	2,138.00	0.02
757	000852	石化机械	100	2,136.00	0.02
758	002140	东华科技	100	2,130.00	0.02
759	600780	通宝能源	300	2,127.00	0.02
760	600640	号百控股	100	2,121.00	0.02
761	603366	日出东方	200	2,120.00	0.02
762	000719	大地传媒	100	2,040.00	0.02
763	600456	宝钛股份	100	2,030.00	0.02
764	000552	靖远煤电	200	2,016.00	0.02
765	002371	七星电子	100	1,928.00	0.02
766	600751	天海投资	200	1,924.00	0.02
767	000921	海信科龙	200	1,906.00	0.02
768	600971	恒源煤电	300	1,887.00	0.02
769	600335	国机汽车	100	1,874.00	0.02
770	603169	兰石重装	100	1,825.00	0.02
771	000951	中国重汽	100	1,810.00	0.02
772	600468	百利电气	100	1,772.00	0.02
773	002678	珠江钢琴	100	1,721.00	0.02
774	002194	武汉凡谷	100	1,700.00	0.02
775	000525	红太阳	100	1,694.00	0.02
776	002128	露天煤业	200	1,690.00	0.02
777	601016	节能风电	100	1,578.00	0.02
778	002461	珠江啤酒	100	1,527.00	0.01
779	600917	重庆燃气	100	1,519.00	0.01
780	601969	海南矿业	100	1,409.00	0.01
781	002249	大洋电机	100	1,326.00	0.01
782	600801	华新水泥	100	815.00	0.01

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

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

#### 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值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	601318	中国平安	335,574.00	3.28
2	600036	招商银行	246,204.00	2.41
3	600016	民生银行	234,395.00	2.29
4	601166	兴业银行	181,334.00	1.77
5	600030	中信证券	161,003.00	1.57
6	600000	浦发银行	150,768.00	1.47
7	601766	中国中车	139,894.00	1.37
8	601328	交通银行	132,454.00	1.29
9	600519	贵州茅台	127,366.00	1.24
10	600837	海通证券	121,902.00	1.19
11	000002	万科A	116,407.00	1.14
12	601989	中国重工	104,972.00	1.03
13	000651	格力电器	104,142.00	1.02
14	601288	农业银行	103,309.00	1.01
15	601398	工商银行	101,168.00	0.99
16	600887	伊利股份	96,834.00	0.95
17	601668	中国建筑	95,479.00	0.93
18	601988	中国银行	93,934.00	0.92
19	601818	光大银行	90,247.00	0.88
20	601169	北京银行	81,814.00	0.80

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

##### 8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值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	600036	招商银行	110,242.00	1.08
2	600519	贵州茅台	64,859.00	0.63
3	300033	同花顺	53,847.00	0.53
4	600000	浦发银行	44,600.00	0.44
5	601318	中国平安	43,702.00	0.43
6	000002	万科A	38,914.80	0.38
7	600016	民生银行	32,337.00	0.32
8	601166	兴业银行	31,426.00	0.31
9	601818	光大银行	30,686.00	0.30
10	600570	恒生电子	29,660.00	0.29
11	600030	中信证券	27,890.00	0.27
12	300059	东方财富	25,074.00	0.25
13	601766	中国中车	24,661.00	0.24
14	601398	工商银行	24,162.00	0.24
15	000651	格力电器	23,163.00	0.23
16	601988	中国银行	22,068.00	0.22
17	002183	怡亚通	21,097.00	0.21
18	000550	江铃汽车	20,988.00	0.21
19	600887	伊利股份	20,985.00	0.21
20	600600	青岛啤酒	19,597.00	0.19

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。

#### 8.4.3 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

买入股票成本（成交）总额	13,280,189.83
卖出股票收入（成交）总额	2,811,702.80

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

#### 8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

**8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细**

本基金本报告期末未持有债券。

**8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细**

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

**8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细**

本基金本报告期末未持有贵金属。

**8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细**

本基金本报告期末未持有权证。

**8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明**

本基金本报告期末未持有股指期货。

**8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明**

本基金本报告期末未持有国债期货。

**8.12 投资组合报告附注**

**8.12.1**

本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。

**8.12.2**

基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

**8.12.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	9,811.26
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	144.32
5	应收申购款	379.07

6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	10,334.65

#### 8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.12.5 期末股票中存在流通受限情况的说明

##### 8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	000002	万科A	134,288.00	1.31	重大资产重组

##### 8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有积极投资股票。

#### 8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## §9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
天弘中证800A	1,147	5,460.70	5,000,080.16	79.83%	1,263,337.21	20.17%
天弘中	1	5,000,000.	5,000,000.	100.00%	—	—

证800C		00	00			
合计	1,148	9,811.34	10,000,080.16	88.78%	1,263,337.21	11.22%

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

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	天弘中证800A	249.05	0.000000%
	天弘中证800C	0.00	0.000000%
	合计	249.05	0.000000%

### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

本基金本报告期间未有本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人及基金经理持有本开放式基金份额的情况。

### 9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	88.78%	10,000,000.00	88.78%	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	88.78%	10,000,000.00	88.78%	

注：本报告期末持有份额总数为发起份额总数和截至本报告期末红利再投份额数的合计。



## § 10 开放式基金份额变动

单位：份

	天弘中证800A	天弘中证800C
基金合同生效日(2015年07月16日) 基金份额总额	5,000,000.00	5,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	—	—
本报告期基金总申购份额	3,904,353.94	—
减：本报告期基金总赎回份额	2,640,936.57	—
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期末基金份额总额	6,263,417.37	5,000,000.00

注：1、本基金合同于2015年7月16日生效；

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会决议。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，本基金的基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 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。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内应向普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）支付服务费2.5万元整。截至本报告期末，普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)已为天弘中证800指数型发起式证券投资基金提供审计服务半年。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人、托管人及其高级管理人员没有发生受稽查或处罚的情况。

## 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占股票成交总额比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
广发证券	2	16,091,892.63	100.00%	3,595.85	100.00%	

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；

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、本期新租用交易单元2个，其中包括：广发证券上海交易单元1个、广发证券深圳交易单元1个；

4、本基金报告期内停止租用交易单元：无。

## 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	天弘中证800指数型发起式证券投资基金基金合同生效公告	中国证监会指定媒介	2015-07-17
2	天弘基金管理有限公司关于天弘中证800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	中国证监会指定媒介	2015-07-18
3	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	中国证监会指定媒介	2015-07-21
4	天弘基金管理有限公司关于旗下基金所持“绿盟科技”、“东方	中国证监会指定媒介	2015-07-28

	航空”估值方法调整的提示性公告		
5	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会指定媒介	2015-07-28
6	天弘基金管理有限公司关于旗下基金所持“大华农”、“蓝鼎控股”估值方法调整的提示性公告	中国证监会指定媒介	2015-07-29
7	天弘基金管理有限公司关于旗下基金所持“宁波港”估值方法调整的提示性公告	中国证监会指定媒介	2015-08-05
8	天弘基金管理有限公司关于旗下基金所持“德尔家居”估值方法调整的提示性公告	中国证监会指定媒介	2015-08-08
9	天弘基金管理有限公司关于旗下基金所持“苏宁云商”估值方法调整的提示性公告	中国证监会指定媒介	2015-08-11
10	天弘基金管理有限公司关于增加广发证券股份有限公司为旗下基金代销机构并开通定投业务以及参加其相关申购及定投费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2015-08-11
11	天弘基金管理有限公司关于旗下基金所持“新研股份”、“中国远洋”、“中国集运”估值方法调整的提示性公告	中国证监会指定媒介	2015-08-18
12	天弘基金管理有限公司关于旗下基金所持“华谊兄弟”、“四川长虹”估值方法调整的提示性公告	中国证监会指定媒介	2015-08-22
13	天弘基金管理有限公司关于旗下基金所持“中海发展”、“广联达”、“千山药机”、“蓝色光标”、“通富微电”、“中远航运”、“巨化股份”估值方法调	中国证监会指定媒介	2015-08-25

	整的提示性公告		
14	天弘基金管理有限公司关于旗下基金所持部分股票估值方法调整的提示性公告	中国证监会指定媒介	2015-08-26
15	天弘基金管理有限公司关于旗下基金所持部分股票估值方法调整的提示性公告	中国证监会指定媒介	2015-08-27
16	天弘基金管理有限公司关于旗下基金所持“中科英华”估值方法调整的提示性公告	中国证监会指定媒介	2015-08-28
17	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会指定媒介	2015-09-01
18	天弘基金管理有限公司关于旗下基金所持“利亚德”估值方法调整的提示性公告	中国证监会指定媒介	2015-09-07
19	天弘基金管理有限公司关于增加杭州数米基金销售有限公司为旗下部分基金代销机构的公告	中国证监会指定媒介	2015-09-08
20	天弘基金管理有限公司关于旗下基金所持“雏鹰农牧”估值方法调整的提示性公告	中国证监会指定媒介	2015-09-09
21	天弘基金管理有限公司关于旗下基金所持“广博股份”估值方法调整的提示性公告	中国证监会指定媒介	2015-09-12
22	天弘基金管理有限公司关于旗下基金所持“平高电气”估值方法调整的提示性公告	中国证监会指定媒介	2015-09-16
23	关于注意防范冒用天弘基金名义进行非法金融活动的提示性公告	中国证监会指定媒介	2015-09-26
24	天弘基金管理有限公司关于旗下基金所持“万达信息”、“碧水源”、“蓝鼎控股”估值方法调整的提示性公告	中国证监会指定媒介	2015-10-13
25	天弘基金管理有限公司关于旗下	中国证监会指定媒介	2015-10-16

	基金所持“北京银行”、“航天信息”、“上海电气”、“银江股份”、“同方股份”估值方法调整的提示性公告		
26	天弘基金管理有限公司关于旗下基金所持“浦发银行”估值方法调整的提示性公告	中国证监会指定媒介	2015-10-17
27	天弘基金管理有限公司关于旗下基金所持“大华农”估值方法调整的提示性公告	中国证监会指定媒介	2015-10-24
28	天弘中证800指数型发起式证券投资基金2015年第3季度报告	中国证监会指定媒介	2015-10-24
29	天弘基金管理有限公司关于旗下基金所持“航天机电”估值方法调整的提示性公告	中国证监会指定媒介	2015-10-28
30	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会指定媒介	2015-11-06
31	天弘基金管理有限公司关于旗下基金所持“超图软件”估值方法调整的提示性公告	中国证监会指定媒介	2015-11-07
32	天弘基金管理有限公司关于旗下基金所持“杰赛科技”估值方法调整的提示性公告	中国证监会指定媒介	2015-11-10
33	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	中国证监会指定媒介	2015-11-10
34	天弘基金管理有限公司关于增加浙江同花顺基金销售有限公司为旗下基金代销机构并开通定投及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	2015-11-10
35	天弘基金管理有限公司关于增加珠海盈米财富管理有限公司为旗下基金代销机构并开通定投及转	中国证监会指定媒介	2015-11-10

	换业务以及参加其相关费率优惠活动的公告		
36	天弘基金管理有限公司关于增加上海天天基金销售有限公司为旗下基金代销机构并开通定投及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	2015-11-17
37	天弘基金管理有限公司关于旗下基金所持“天银机电”估值方法调整的提示性公告	中国证监会指定媒介	2015-11-26
38	天弘基金管理有限公司关于旗下基金所持“海通证券”估值方法调整的提示性公告	中国证监会指定媒介	2015-11-30
39	天弘基金管理有限公司关于增加深圳众禄金融控股股份有限公司为旗下基金代销机构并开通定投及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	2015-12-07
40	天弘基金管理有限公司关于增加和讯信息科技有限公司为旗下基金代销机构并开通定投及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	2015-12-11
41	天弘基金管理有限公司关于提醒投资者及时更新身份证件信息的提示性公告	中国证监会指定媒介	2015-12-16
42	天弘基金管理有限公司关于旗下基金所持“乐视网”估值方法调整的提示性公告	中国证监会指定媒介	2015-12-18
43	天弘基金管理有限公司关于旗下基金所持“金运激光”、“招商地产”、“梅花生物”估值方法调整的提示性公告	中国证监会指定媒介	2015-12-22

44	天弘基金管理有限公司关于旗下基金所持“万科A”估值方法调整的提示性公告	中国证监会指定媒介	2015-12-23
45	天弘基金管理有限公司关于参加上海天天基金销售有限公司相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2015-12-24
46	天弘基金管理有限公司关于对使用余额宝支付功能申购的投资者开展费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2015-12-25
47	天弘基金管理有限公司关于增加深圳富济财富管理有限公司为旗下基金代销机构并开通定投及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	2015-12-25
48	天弘基金管理有限公司关于增加中证金牛（北京）投资咨询有限公司为旗下基金代销机构并开通定投及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	2015-12-29
49	天弘基金管理有限公司关于指数熔断机制实施后旗下基金开放时间调整的公告	中国证监会指定媒介	2015-12-31
50	天弘基金管理有限公司关于增加诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司为旗下基金代销机构并开通定投及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	2015-12-31
51	天弘基金管理有限公司旗下基金2015年12月31日基金资产净值公告	中国证监会指定媒介	2015-12-31

### § 12 影响投资者决策的其他重要信息

1、2015年度内，天弘基金管理有限公司（以下简称“公司”）注册资本由1.8亿元人民币增加至5.143亿元人民币，浙江蚂蚁小微金融服务集团有限公司持有公司51%的股

权。

2、2015年度内，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；公司董事会选举井贤栋先生为新一届董事会董事长（公司法定代表人）。

3、2015年度内，公司住所由“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”变更为“天津自贸区（中心商务区）响螺湾旷世国际大厦A座1704-241号”，上述住所变更已办理完毕工商变更登记。

## § 13 备查文件目录

### 13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准天弘中证800指数型发起式证券投资基金募集的文件
- 2、天弘中证800指数型发起式证券投资基金基金合同
- 3、天弘中证800指数型发起式证券投资基金招募说明书
- 4、天弘中证800指数型发起式证券投资基金托管协议
- 5、天弘基金管理有限公司批准成立批件及营业执照

### 13.2 存放地点

天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层。

### 13.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的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印件或复印件。

公司网站：[www.thfund.com.cn](http://www.thfund.com.cn)

天弘基金管理有限公司

二〇一六年三月三十日