

天弘量化驱动股票型证券投资基金
(原天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金转型)

2018年半年度报告摘要

2018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：招商证券股份有限公司

送出日期：2018年08月27日

§ 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。

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年8月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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

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

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

2018年1月18日天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金正式更名为“天弘量化驱动股票型证券投资基金”。原天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金本报告期自2018年1月1日至2018年1月17日止，天弘量化驱动股票型证券投资基金本报告期自2018年1月18日至2018年6月30日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

2.1.1 天弘量化驱动股票型证券投资基金（转型后）		
基金简称	天弘量化驱动股票	
基金主代码	001556	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年1月18日	
基金管理人	天弘基金管理有限公司	
基金托管人	招商证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	59,678,896.57份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	天弘量化驱动股票A	天弘量化驱动股票C
下属分级基金的交易代码	001556	001557
报告期末下属分级基金的份 额总额	18,182,406.44份	41,496,490.13份
2.1.2 天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金（转型前）		
基金简称	天弘中证全指房地产	
基金主代码	001556	
基金运作方式	契约型开放式、发起式	
基金合同生效日	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	招商证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	104,163,445.56份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	天弘中证全指房地产A	天弘中证全指房地产C
下属分级基金的交易代码	001556	001557
报告期末下属分级基金的份 额总额	19,649,870.98份	84,513,574.58份

2.2 基金产品说明

2.2.1 天弘量化驱动股票型证券投资基金（转型后）	
投资目标	本基金采用量化投资策略构建投资组合，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金采用量化投资策略构建投资组合，利用数量化投资信息反应速度快、投资覆盖范围广、风险水平可控性强、投资纪律执行力高等优势，以自上而下的资产配置策略和自下而上的个股选择的组合构建方式，在控制整体风险的基础上追求组合收益的最大化。
业绩比较基准	中证500指数收益率×85%+中证综合债券指数收益×15%
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于较高风险、较高收益预期的基金品种，其风险收益预期高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。
2.2.2 天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金（转型前）	
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	中证全指房地产指数收益率×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
天弘量化驱动股票型证券投资基金（转型后）	天弘基金管理有限公司	招商证券股份有限公司
天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金（转型）	天弘基金管理有限公司	招商证券股份有限公司

前)			
信息披露负责人	姓名	童建林	郭杰
	联系电话	022-83310208	0755-82943666
	电子邮箱	service@thfund.com.cn	tgb@cmschina.com.cn
客户服务电话		95046	95565
传真		022-83865569	0755-82960794

2.4 信息披露方式

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

§ 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（转型后）

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2018年1月18日-2018年6月30日）	
	天弘量化驱动股票A	天弘量化驱动股票C
本期已实现收益	88,986.62	3,061,200.50
本期利润	-2,831,957.81	-6,857,432.49
加权平均基金份额本期利润	-0.1396	-0.1910
本期基金份额净值增长率	-15.71%	-15.88%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末（2018年6月30日）	
期末可供分配基金份额利润	-0.2239	-0.2309
期末基金资产净值	14,110,761.09	31,916,851.40
期末基金份额净值	0.7761	0.7691

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、天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金自2018年1月18日转型为天弘量化驱动股票型证券投资基金。新基金合同生效日，指《天弘量化驱动股票型证券投资基金基金合同》生效日，即

2018年1月18日，下同。

3.2 主要会计数据和财务指标（转型前）

金额单位：人民币元

3.2.1 期间数据和指标	报告期（2018年1月1日-2018年1月17日）	
	天弘中证全指房地产A	天弘中证全指房地产C
本期已实现收益	328,517.62	1,437,103.83
本期利润	1,738,343.89	7,906,421.90
加权平均基金份额本期利润	0.1173	0.1149
本期基金份额净值增长率	14.83%	14.82%
3.2.2 期末数据和指标	报告期末（2018年1月17日）	
期末可供分配基金份额利润	-0.1560	-0.1611
期末基金资产净值	18,093,663.62	77,267,894.26
期末基金份额净值	0.9208	0.9143

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、天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金自2018年1月18日转型为天弘量化驱动股票型证券投资基金。

3.3 基金净值表现(天弘量化驱动股票型证券投资基金)

3.3.1 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（转型后）

天弘量化驱动股票A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-7.64%	1.79%	-7.86%	1.58%	0.22%	0.21%
过去三个月	-11.32%	1.31%	-12.29%	1.17%	0.97%	0.14%
自基金转型日起至今	-15.71%	1.34%	-13.79%	1.26%	-1.92%	0.08%

(2018年1月18日 -2018年6月30日)						
-----------------------------	--	--	--	--	--	--

天弘量化驱动股票C

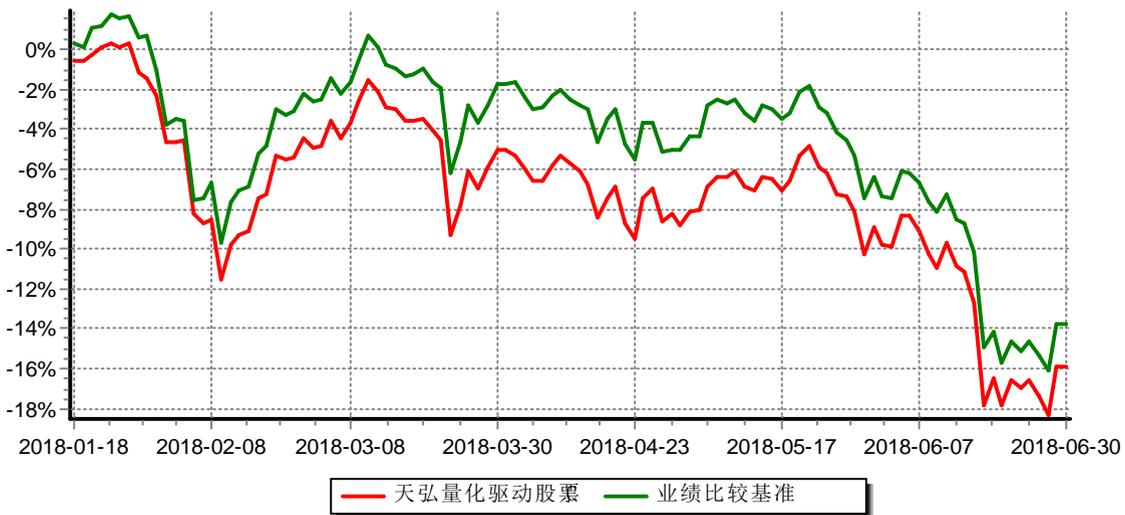
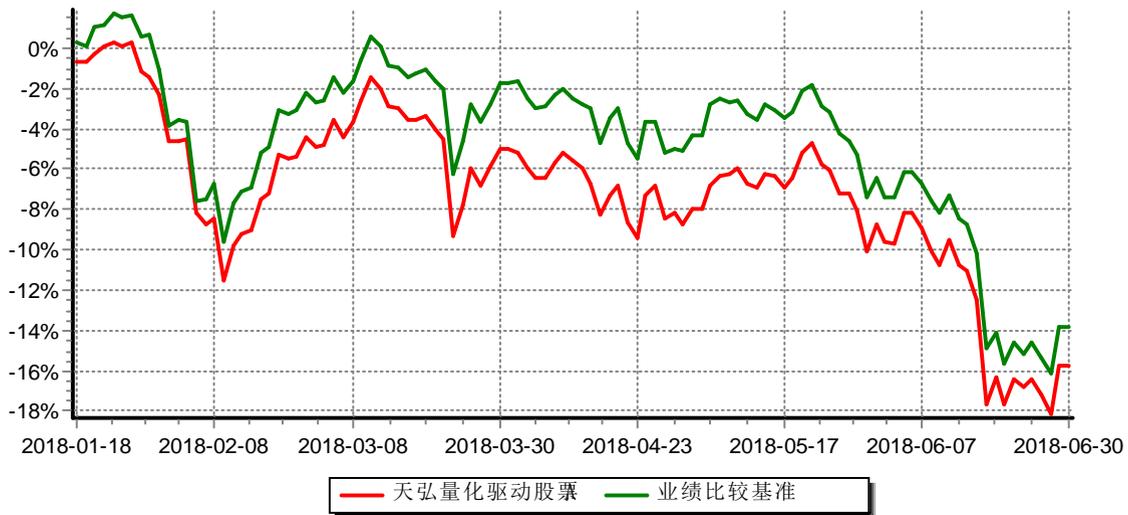
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-7.68%	1.79%	-7.86%	1.58%	0.18%	0.21%
过去三个月	-11.41%	1.31%	-12.29%	1.17%	0.88%	0.14%
自基金转型日起至今 (2018年1月18日 -2018年6月30日)	-15.88%	1.34%	-13.79%	1.26%	-2.09%	0.08%

注：1、业绩比较基准：中证500指数收益率×85%+中证综合债券指数收益×15%。中证500指数包含了沪深300指数成份股之外的A股市场中流动性好、代表性强的中小盘股票，综合反映了沪深证券市场内中小市值公司的整体情况，对沪深股市中小盘的整体走势具有较强代表性且该指数认可度较高；中证综合债指数是综合反映 银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央票及短融整体走势的跨市场债券指数，可以更全面地反映我国债券市场的整体价格变动趋势。

2、基金转型日，指天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金转型为天弘量化驱动股票型证券投资基金的日期，即2018年1月18日，下同。

3.3.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较（转型后）

天弘量化驱动股票型证券投资基金
基金份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2018年1月18日-2018年6月30日)



注：1、本基金于2018年1月18日由天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金转型而成，名称变更为“天弘量化驱动股票型证券投资基金”，自本基金转型起至披露时点不满一年。

2、按照本基金合同的约定，基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。本基金的建仓期为2018年1月18日—2018年7月17日，截止本报告期末本基金仍处于建仓期。

3.4 基金净值表现(天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金)

3.4.1 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（转型前）

天弘中证全指房地产A

阶段	份额净值增长	份额净值增长	业绩比较基准	业绩比较基准	①-③	②-④
----	--------	--------	--------	--------	-----	-----

	率①	率标准差②	收益率③	收益率标准差④		
过去六个月（2018年1月1日-2018年1月17日）	14.83%	1.80%	14.65%	1.80%	0.18%	0.00%
过去一年（2017年7月1日-2018年1月17日）	18.11%	1.15%	17.82%	1.12%	0.29%	0.03%
过去三年（2015年7月1日-2018年1月17日）	-7.92%	1.87%	-5.99%	1.78%	-1.93%	0.09%
自基金合同生效日2015年6月30日起至2018年1月17日	-7.92%	1.87%	-1.56%	1.79%	-6.36%	0.08%

天弘中证全指房地产C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去六个月（2018年1月1日-2018年1月17日）	14.82%	1.81%	14.65%	1.80%	0.17%	0.01%
过去一年（2017年7月1日-2018年1月17日）	17.96%	1.15%	17.82%	1.12%	0.14%	0.03%
过去三年（2015年7月1日-2018年1月17日）	-8.57%	1.87%	-5.99%	1.78%	-2.58%	0.09%
自基金合同生效日起至2018年1月17日	-8.57%	1.87%	-1.56%	1.79%	-7.01%	0.08%

注：1、天弘中证全指房地产基金业绩比较基准：中证全指房地产指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。中证全指房地产指数由中证全指指数成份中归属于房地产二级行业的全部股票组成，反映了沪深A股市场中房地产业股票的整体表现，并为指数化产品提供新的标的指数。

2、上述表格中的基金合同生效日，指《天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金基金合同》生效日，即2015年6月30日。

3.4.2 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（转型前）

天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金
基金份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2015年6月30日-2018年1月17日)



注：1、天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金基金合同于2015年6月30日生效。
2、本报告期内，本基金的各项投资比例达到基金合同约定的各项比例要求。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

截至2018年6月30日，本基金管理人共管理54只基金：天弘精选混合型证券投资基金、天弘永利债券型证券投资基金、天弘永定价值成长混合型证券投资基金、天弘周期策略混合型证券投资基金、天弘文化新兴产业股票型证券投资基金、天弘添利债券型证券投资基金（LOF）、天弘丰利债券型证券投资基金（LOF）、天弘现金管家货币市场基金、天弘债券型发起式证券投资基金、天弘安康颐养混合型证券投资基金（原“天弘安康养老混合型证券投资基金”）、天弘余额宝货币市场基金、天弘稳利定期开放债券型证券投资基金、天弘弘利债券型证券投资基金、天弘通利混合型证券投资基金、天弘同利债券型证券投资基金（LOF）、天弘沪深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、天弘云端生活优选灵活配置混合型证券投资基金、天弘新活力灵活配置混合型发起式证券投资基金、天弘互联网灵活配置混合型证券投资基金、天弘惠利灵活配置混合型证券投资基金、天弘新价值灵活配置混合型证券投资基金、天弘云商宝货币市场基金、天弘医疗健康混合型证券投资基金（原“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、天弘量化驱动股票型证券投资基金（原“天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金”）、天弘中证全指运输指数型发起式证券投资基金、天弘中证移动互联网指数型发

起式证券投资基金、天弘中证证券保险指数型发起式证券投资基金、天弘中证银行指数型发起式证券投资基金、天弘创业板指数型发起式证券投资基金、天弘中证高端装备制造指数型发起式证券投资基金、天弘上证50指数型发起式证券投资基金、天弘中证100指数型发起式证券投资基金、天弘中证800指数型发起式证券投资基金、天弘中证环保产业指数型发起式证券投资基金、天弘中证电子指数型发起式证券投资基金、天弘中证休闲娱乐指数型发起式证券投资基金、天弘中证计算机指数型发起式证券投资基金、天弘中证食品饮料指数型发起式证券投资基金、天弘弘运宝货币市场基金、天弘裕利灵活配置混合型证券投资基金、天弘乐享保本混合型证券投资基金、天弘价值精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、天弘安盈灵活配置混合型证券投资基金、天弘喜利灵活配置混合型证券投资基金、天弘信利债券型证券投资基金、天弘金利灵活配置混合型证券投资基金、天弘金明灵活配置混合型证券投资基金、天弘策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、天弘优选债券型证券投资基金、天弘尊享定期开放债券型发起式证券投资基金、天弘悦享定期开放债券型发起式证券投资基金、天弘荣享定期开放债券型发起式证券投资基金。

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		
张子法	本基金基金经理。	2018年1月	—	16年	男，软件工程硕士。历任华夏基金管理有限公司金融工程师量化研究员。2014年3月加盟本公司，历任股票研究员、基金经理助理。
沙川	本基金基金经理。	2018年1月	—	8年	男，数学硕士。历任中国中投证券有限责任公司量化分析师。2013年9月加盟本公司，历任金融工程研究员。

注：1、上述任职日期为转型后基金合同生效日期。

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遵规守信情况的说明

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说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金转型为量化驱动股票型基金后，本基金采用了招募说明书中的自上而下的投资策略。首先，对各类资产的收益率进行预测，包括股票（大、中、小盘），债券（长、短债），货币资产等，在约束相对基准偏离幅度的前提下，通过优化方法计算股票资产权重和优势风格指数。然后，对标该优势风格指数，采用因子模型和优化方法构建股票组合。具体方法是约束风险因子的前提下，最大化组合的预期收益率（个股的预期收益率由因子模型估计得出，采用了估值、成长、盈利、流动性等多个因子，并采用特定的算法进行加权组合）。

本报告期内，基金整体运行相对平稳，单位净值随股票市场整体情况波动，1季度跑输基准、2季度战胜基准。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2018年6月30日（2018年1月18日至2018年6月30日），天弘量化驱动股票A基金份额净值为0.7761元，天弘量化驱动股票C基金份额净值为0.7691元。报告期内份额净值增长率天弘量化驱动股票A为-15.71%，天弘量化驱动股票C为-15.88%，同期业绩比较基准增长率均为-13.79%。

截至2018年1月17日（2018年1月1日至2018年1月17日），天弘中证全指房地产A基金份额净值为0.9208元，天弘中证全指房地产C基金份额净值为0.9143元。报告期内份额净值增长率天弘中证全指房地产A为14.83%，天弘中证全指房地产C为14.82%，同期业绩比较基准增长率均为14.65%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

宏观经济，我们认为贸易摩擦和金融及融资平台去杠杆的叠加或将拖累经济增长，预期经济还将保持温和回落态势，名义GDP下跌空间大于实际GDP。随着去杠杆进程从金融体系延伸到实体经济部门，基建、房地产和企业存货投资先后逐步显现。下半年房地产投资增速会放缓，但国务院常务会议明确要求积极的财政政策要更加积极，稳健的货币政策要松紧适度。政策的边际放松让下半年基建触底回升成为可能，但是到目前为止所有的政策更多的是托底，而不是强刺激或者大放水，经济放缓或贯穿全年。

证券市场，虽然预测经济放缓，但市场所面临的宏观经济形势正在出现边际好转信号，年内3次降准、理财新规节奏调整、国务院常务会议释放积极财政信号等，都对远期经济的修复积蓄力量；市场状态来看，全A整体和行业估值结构已经接近历史几次大底部区域的位置，市场中长期配置价值正在逐步显现，但同时也提示关注下半年贸易摩

擦升级和经济韧性调整过程中，市场存在一定反复的可能。

行业方面，我们将关注，前期受宏观预期压制但估值或已步入底部区域的金融地产板块、具备较强供给约束盈利仍好的细分周期板块（建材、钢铁）、符合中长期经济转型升级的新兴产业（计算机）。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

报告期内，本基金管理人未与任何第三方签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

自2018年3月1日至2018年5月25日止，本基金连续20个工作日以上基金资产净值低于人民币5000万元，但并未连续60个工作日出现上述情形。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

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

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

§ 6 半年度财务会计报告（天弘量化驱动股票型证券投资基金）(未经审计)

转型后：

报告期（2018年1月18日-2018年6月30日）

6.1 资产负债表（转型后）

会计主体：天弘量化驱动股票型证券投资基金

报告截止日：2018年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018年6月30日
资产：		
银行存款	6.4.7.1	4,081,797.49
结算备付金		276,365.19
存出保证金		201,390.07
交易性金融资产	6.4.7.2	41,625,960.81
其中：股票投资		41,625,960.81

基金投资		—
债券投资		—
资产支持证券投资		—
贵金属投资		—
衍生金融资产	6.4.7.3	—
买入返售金融资产	6.4.6.4	—
应收证券清算款		147,296.44
应收利息	6.4.7.5	2,133.93
应收股利		—
应收申购款		56,880.06
递延所得税资产		—
其他资产	6.4.7.6	—
资产总计		46,391,823.99
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年6月30日
负 债：		
短期借款		—
交易性金融负债		—
衍生金融负债	6.4.7.3	—
卖出回购金融资产款		—
应付证券清算款		—
应付赎回款		160,673.01
应付管理人报酬		59,317.98
应付托管费		9,886.34
应付销售服务费		10,894.38
应付交易费用	6.4.7.7	43,995.98
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	79,443.81
负债合计		364,211.50
所有者权益：		
实收基金	6.4.7.9	59,678,896.57
未分配利润	6.4.7.10	-13,651,284.08
所有者权益合计		46,027,612.49
负债和所有者权益总计		46,391,823.99

注：1、报告截止日2018年6月30日，天弘量化驱动股票型证券投资基金A类基金份额净值0.7761元，天弘量化驱动股票型证券投资基金C类基金份额净值0.7691元；基金份额总额59,678,896.57份，其中天弘量化驱动股票型证券投资基金A类基金份额18,182,406.44份，天弘量化驱动股票型证券投资基金C类基金份额41,496,490.13份。

2、天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金于2018年1月18日转型为天弘量化驱动股票型证券投资基金。本财务报表的实际编制期间为2018年1月18日(新基金合同生效日)至2018年6月30日，上年度完整期间的数据将在转型前表格中一并披露。

6.2 利润表（转型后）

会计主体：天弘量化驱动股票型证券投资基金

本报告期：2018年1月18日（新基金合同生效日）至2018年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018年1月18日（新基金合同生效日）至2018 年6月30日
一、收入		-8,781,939.92
1.利息收入		60,453.35
其中：存款利息收入	6.4.7.11	41,942.11
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		18,511.24

其他利息收入		—
2.投资收益(损失以“-”填列)		3,625,595.50
其中：股票投资收益	6.4.7.12	3,316,219.85
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	309,375.65
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-12,839,577.42
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		—
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	371,588.65
减：二、费用		907,450.38
1. 管理人报酬	6.4.10.2 .1	324,501.41
2. 托管费	6.4.10.2 .2	54,083.59
3. 销售服务费	6.4.10.2 .3	55,316.27
4. 交易费用	6.4.7.19	400,773.51
5. 利息支出		—
其中：卖出回购金融资产支出		—
6. 税金及附加		—
7. 其他费用	6.4.7.20	72,775.60

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-9,689,390.30
减：所得税费用		—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-9,689,390.30

6.3 所有者权益（基金净值）变动表（转型后）

会计主体：天弘量化驱动股票型证券投资基金

本报告期：2018年1月18日（新基金合同生效日）至2018年6月30日

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月18日（新基金合同生效日）至2018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）	104,163,445.56	-8,801,887.68	95,361,557.88
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	-9,689,390.30	-9,689,390.30
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）	-44,484,548.99	4,839,993.90	-39,644,555.09
其中：1.基金申购款	76,648,621.84	-10,250,400.29	66,398,221.55
2.基金赎回款	-121,133,170.83	15,090,394.19	-106,042,776.64
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）	59,678,896.57	-13,651,284.08	46,027,612.49

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（转型后）

6.4.1 基金基本情况

天弘量化驱动股票型证券投资基金系由天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金于本报告期内转型而来。新基金合同生效日为2018年1月18日，合同生效日的基金份额总额为104,163,445.56份基金份额；基金管理人为天弘基金管理有限公司，基金托管人为招商证券股份有限公司。

根据天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金基金份额持有人大会以通讯方式通过的《关于天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金转型有关事项的议案》，基金管理人天弘基金管理有限公司于2018年1月18日发布了《关于天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金基金份额持有人大会决议生效的公告》。根据《天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金转型方案说明书》以及相关法律法规的规定，经与基金托管人招商证券股份有限公司协商一致，基金管理人已将《天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金基金合同》、《天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金托管协议》修订为《天弘量化驱动股票型证券投资基金基金合同》、《天弘量化驱动股票型证券投资基金托管协议》，并据此更新了《天弘量化驱动股票型证券投资基金招募说明书》，上述文件已经中国证监会变更注册。《天弘量化驱动股票型证券投资基金基金合同》和《天弘量化驱动股票型证券投资基金托管协议》自《关于天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金基金份额持有人大会决议生效的公告》发布之日起，即2018年1月18日起生效，原《天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金基金合同》、《天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金托管协议》将自同日失效。

根据《天弘量化驱动股票型证券投资基金基金合同》和《天弘量化驱动股票型证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金根据申购费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。收取申购费用的，而不是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为天弘量化驱动股票型证券投资基金A类(以下简称“A类基金”)；不收取申购费用的，而是在本类别基金资产中计提销售服务费的，称为天弘量化驱动股票型证券投资基金C类(以下简称“C类基金”)。A类基金和C类基金两种收费模式并存，由于基金费用的不同，本基金A类基金份额及C类基金份额分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。投资者可自行选择申购某

一类别的基金份额，但各类别基金份额之间不能相互转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘量化驱动股票型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，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、地方政府债券、中小企业私募债券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交易债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、债券回购、资产支持证券、银行存款、同业存单、货币市场工具、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金投资于股票的资产比例不低于基金资产的80%；投资于权证的资产比例不低于基金资产的3%，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，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款。本基金的业绩比较基准：中证500指数收益率 \times 85%+中证综合债券指数收益 \times 15%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和半年度报告〉》、中国证券投资基金业协会（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》、《天弘量化驱动股票型证券投资基金基金合同（原天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金）》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2018年1月18日（新基金合同生效日）至2018年6月30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2018年6月30日的财务状况以及2018年1月18日（新基金合同生效日）至2018年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表所

采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》、国发[1985]19号发布和国务院令[2011]第588号修订的《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例》、国务院令[2005]第448号《国务院关于修改〈征收教育费附加的暂行规定〉的决定》其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(a) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

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

持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(d) 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。

(e) 本基金分别按实际缴纳的增值税额的7%、3%、2%和1%缴纳城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加和防洪工程维护费。

6.4.7 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月18日（新基金合同生效日）至2018年6月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
招商证券股份 有限公司	34,996,234.41	9.06%

6.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期内未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月18日（新基金合同生效日）至2018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
招商证券股份有限公司	8,094.07	5.07%	8,094.07	18.40%

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

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

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月18日（新基金合同生效日）至2018年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	324,501.41
其中：支付销售机构的客户维护费	70,256.90

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1.50%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： $\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 1.50\% / \text{当年天数}$ 。

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

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月18日（新基金合同生效日）至2018年6月30日
----	---------------------------------------

当期发生的基金应支付的托管费	54,083.59
----------------	-----------

注：支付基金托管人招商证券股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值0.25%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X0.25%/当年天数。

6.4.8.2.3 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 2018年1月18日（新基金合同生效日）至2018年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	天弘量化驱动股票 A	天弘量化驱动股票 C	合计
天弘基金管理有限公司	—	32,413.74	32,413.74
招商证券股份有限公司	—	—	—
合计	—	32,413.74	32,413.74

注：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0.40%。其计算公式为：日销售服务费=前一日基金资产净值X0.40%/当年天数。

6.4.8.3 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过银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 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 2018年1月18日（新基金合同生效日）至2018年6月30日	
	天弘量化驱动股票A	天弘量化驱动股票C
基金转型日（2018年1月18	5,000,000.00	5,000,000.00

日)持有的基金份额		
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	8.38%	8.38%

6.4.8.4.2 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

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。

6.4.8.5 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 2018年1月18日（新基金合同生效日）至2018年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
招商证券股份有限公司	4,081,797.49	37,240.70

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

6.4.8.6 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。

6.4.8.7 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。

6.4.9 期末（2018年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 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/增发而流通受限的证券。

6.4.9.2 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
600022	山东钢铁	2018-03-27	重大资产重组	2.02	2018-08-16	1.83	90,700	199,365.15	183,214.00
600515	海航基础	2018-01-23	重大资产重组	11.16	2018-08-13	10.04	5,100	65,536.73	56,916.00
000029	深深房A	2016-09-14	重大资产重组	11.17	-	-	6,704	78,333.49	74,883.68
000540	中天金融	2017-08-21	重大资产重组	4.87	-	-	80,700	395,633.39	393,009.00
002051	中工国际	2018-04-09	重大资产重组	15.27	-	-	14,900	257,488.46	227,523.00
002147	新光圆成	2018-01-18	重大资产重组	10.28	-	-	38,425	514,732.33	395,009.00
002699	美盛文化	2018-02-05	重大资产重组	18.76	2018-07-02	16.88	2,800	48,927.59	52,528.00
合计								1,560,017.14	1,383,082.68

注：本基金截至2018年6月30日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2018年6月30日，本基金未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2018年6月30日，本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.10 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2018年6月30日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为40,242,878.13元，属于第二层次的余额为1,383,082.68元，无属于第三层次的余额。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

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

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2018年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 半年度财务会计报告(天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金)(未经审计)
转型前:

报告期（2018年1月1日-2018年1月17日）

7.1 资产负债表（转型前）

会计主体：天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金

报告截止日：2018年1月17日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018年1月17日	上年度末 2017年12月31日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	9,438,432.96	8,700,297.96
结算备付金		550,464.30	39,915.81
存出保证金		77,165.10	42,974.23
交易性金融资产	7.4.7.2	78,350,517.82	81,531,913.18
其中：股票投资		78,350,517.82	81,531,913.18
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	26,002.35	15,480.13
应收股利		—	—
应收申购款		15,974,765.32	174,647.78
递延所得税资产		—	—
其他资产	7.4.7.6	—	—
资产总计		104,417,347.85	90,505,229.09
负债和所有者权益	附注号	本期末	上年度末

		2018年1月17日	2017年12月31日
负 债:			
短期借款		—	—
交易性金融负债		—	—
衍生金融负债	7.4.7.3	—	—
卖出回购金融资产款		—	—
应付证券清算款		—	253,106.40
应付赎回款		8,853,006.78	551,920.75
应付管理人报酬		16,538.56	22,805.22
应付托管费		3,307.71	4,561.05
应付销售服务费		6,783.46	9,005.47
应付交易费用	7.4.7.7	26,585.19	31,555.11
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	149,568.27	138,106.27
负债合计		9,055,789.97	1,011,060.27
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	104,163,445.56	112,279,439.14
未分配利润	7.4.7.10	-8,801,887.68	-22,785,270.32
所有者权益合计		95,361,557.88	89,494,168.82
负债和所有者权益总计		104,417,347.85	90,505,229.09

注：1. 报告截止日2018年1月17日，天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金A类基金份额净值0.9208元，天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金C类基金份额净值0.9143元；基金份额总额104,163,445.56份，其中天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金A类基金份额19,649,870.98份，天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金C类基金份额84,513,574.58份。
2. 本财务报表的实际编制期间为2018年1月1日至2018年1月17日。

7.2 利润表（转型前）

会计主体：天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金

本报告期：2018年1月1日至2018年1月17日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018年1月1日至 2018年1月17日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017 年6月30日
一、收入		9,748,884.24	190,955.01
1.利息收入		10,522.22	10,808.21
其中：存款利息收入	7.4.7.11	10,522.22	10,808.21
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)		1,843,051.36	-145,531.27
其中：股票投资收益	7.4.7.12	1,843,051.36	-358,684.19
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	7.4.7.13.2	—	—
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	—	213,152.92
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	7.4.7.17	7,879,144.34	317,020.18
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	16,166.32	8,657.89
减：二、费用		104,118.45	161,379.17

1. 管理人报酬	7.4.10.2.1	16,538.56	42,684.93
2. 托管费	7.4.10.2.2	3,307.71	8,537.02
3. 销售服务费	7.4.10.2.3	6,783.46	8,694.35
4. 交易费用	7.4.7.19	69,322.97	20,997.91
5. 利息支出		—	—
其中：卖出回购金融资产支出		—	—
6. 税金及附加		—	—
7. 其他费用	7.4.7.20	8,165.75	80,464.96
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		9,644,765.79	29,575.84
减：所得税费用		—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		9,644,765.79	29,575.84

7.3 所有者权益（基金净值）变动表（转型前）

会计主体：天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金

本报告期：2018年1月1日至2018年1月17日

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年1月17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）	112,279,439.14	-22,785,270.32	89,494,168.82
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	9,644,765.79	9,644,765.79
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减	-8,115,993.58	4,338,616.85	-3,777,376.73

少以“-”号填列)			
其中：1.基金申购款	66,263,381.98	-7,547,331.44	58,716,050.54
2.基金赎回款	-74,379,375.56	11,885,948.29	-62,493,427.27
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）	104,163,445.56	-8,801,887.68	95,361,557.88
项 目	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	21,430,602.87	-4,758,003.86	16,672,599.01
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	29,575.84	29,575.84
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）	4,245,691.71	-988,621.25	3,257,070.46
其中：1.基金申购款	36,603,609.90	-8,010,819.60	28,592,790.30
2.基金赎回款	-32,357,918.19	7,022,198.35	-25,335,719.84
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）	25,676,294.58	-5,717,049.27	19,959,245.31

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（转型前）

7.4.1 基金基本情况

天弘中证全指房地产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]1296号《关于准予天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金注册的批复》注册，由天弘基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘中证全指房地产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、发起式，存续期限不定，首次募集期间为2015年6月29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858号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金基金合同》于2015年6月30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，基金托管人为招商证券股份有限公司。

根据《天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金基金合同》和《天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金根据申购费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。收取申购费用的，而不是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金A类（以下简称“A类基金”）；不收取申购费用的，而是在本类别基金资产中计提销售服务费的，称为天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金C类（以下简称“C类基金”）。A类基金和C类基金两种收费模式并存，由于基金费用的不同，本基金A类基金份额及C类基金份额分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。投资者可自行选择申购某一类别的基金份额，但各类别基金份额之间不能相互转换。

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《天弘中证全指房地产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，以中证全指房地产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%，投资于中证全指房地产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：中证全指房地产指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。

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>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《天弘中证全指房地产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。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定，发起式基金的基金合同生效三年后，若基金资产净值低于人民币两亿元的，基金管理人应当向中国证监会报告并提出解决方案，如转换运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等，并召开基金份额持有人大会进行表决。于2018年1月17日，本基金的基金资产净值为人民币95,361,557.88元，且本基金的基金合同将于未来6个月内生效满三年，基金管理人天弘基金管理有限公司根据法律法规及《基金合同》相关规定以通讯方式召开基金份额持有人大会，大会审议通过《关于天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金基金份额持有人大会决议生效的公告》，自2018年1月18日起，天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金正式转型为天弘量化驱动股票型证券投资基金，故本财务报表以持续经营为基础编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2018年1月1日至2018年1月17日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2018年1月17日的财务状况以及2018年1月1日至2018年1月17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 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

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

7.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》、国发[1985]19号发布和国务院令[2011]第588号修订的《中华人民共和国城市维护建设税暂行条例》、国务院令[2005]第448号《国务院关于修改〈征收教育费附加的暂行规定〉的决定》其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(a) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。

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

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

(d) 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。

(e) 本基金分别按实际缴纳的增值税额的7%、3%、2%和1%缴纳城市维护建设税、教育费附加、地方教育附加和防洪工程维护费。

7.4.7 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

7.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年1月1日至2018年1月17日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例
招商证券股份 有限公司	—	—	14,722,315.06	100.00%

7.4.8.1.2 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。

7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期

	2018年1月1日至2018年1月17日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
招商证券股份有限公司	—	—	—	—
关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
招商证券股份有限公司	13,711.63	100.00%	10,925.79	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。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2018年1月1日至2018年1月17日	2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	16,538.56	42,684.93
其中：支付销售机构的客户维护费	2,347.38	7,620.81

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。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年1月1日至2018年1月17日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	3,307.71	8,537.02

注：支付基金托管人招商证券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 X 0.1% / 当年天数。

7.4.8.2.3 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 2018年1月1日至2018年1月17日		
	天弘中证全指房地产A	天弘中证全指房地产C	合计
天弘基金管理有限公司	—	4,327.05	4,327.05
招商证券股份有限公司	—	—	—
合计	—	4,327.05	4,327.05
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日		
	天弘中证全指房地产A	天弘中证全指房地产C	合计
天弘基金管理有限公司	—	4,776.59	4,776.59
招商证券股份有限公司	—	3.66	3.66
合计	—	4,780.25	4,780.25

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。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 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 2018年1月1日至2018年1月17日		上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日	
	天弘中证全指 房地产A	天弘中证全 指房地产C	天弘中证全指 房地产A	天弘中证全 指房地产C
期初持有的基金份额	5,000,000.00	5,000,000.00	5,000,000.00	5,000,000.00
期间申购/买入总份额	—	—	—	—
期间因拆分变动份额	—	—	—	—
减：期间赎回/卖出总 份额	—	—	—	—
期末持有的基金份额	5,000,000.00	5,000,000.00	5,000,000.00	5,000,000.00
占基金总份额比例	4.80%	4.80%	19.47%	19.47%

7.4.8.4.2 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

本基金本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.8.5 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2018年1月1日至2018年1月17日	上年度可比期间 2017年1月1日至2017年6月30日

	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商证券股份有限公司	9,438,432.96	10,091.01	1,606,011.24	10,523.80

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

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券交易。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

7.4.9 期末（2018年1月17日）本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 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。

7.4.9.2 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
600807	*ST天业	2017-12-25	重大事项	10.01	2018-05-16	9.51	29,902	313,907.78	299,319.02
000029	深深房A	2016-09-14	重大资产重组	11.17	-	-	6,704	78,333.49	74,883.68
000006	深振业A	2017-09-11	重大资产重组	9.85	2018-03-08	8.87	16,811	152,741.79	165,588.35
000031	中粮地产	2017-07-24	重大资产重组	8.00	2018-04-17	7.95	18,701	182,716.98	149,608.00
000046	泛海控股	2018-01-	重大资产重组	7.92	2018-04-	7.39	125,200	953,943.29	991,584.00

		15			13				
000540	中天金融	2017-08-21	重大资产重组	7.35	-	-	53,800	395,633.39	395,430.00
000979	中弘股份	2017-09-07	重大资产重组	1.94	2018-02-14	1.75	82,680	170,887.71	160,399.20
合计								2,248,164.43	2,236,812.25

注：本基金截至2018年1月17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。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2018年1月17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。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2018年1月17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。

7.4.10 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2018年1月17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76,113,705.57元，属于第二层次的余额为2,236,812.25元，无

属于第三层次的余额（2017年12月31日：第一层次的余额为79,267,202.04元，第二层次的余额为2,264,711.14元，无第三层次）。

(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债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间及交易不活跃期间将相关债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于2018年1月17日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2017年12月31日：同)。

(d)不以公允价值计量的金融工具

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

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告(天弘量化驱动股票型证券投资基金)

转型后:

报告期（2018年1月18日-2018年6月30日）

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	41,625,960.81	89.73
	其中：股票	41,625,960.81	89.73
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	4,358,162.68	9.39
8	其他资产	407,700.50	0.88
9	合计	46,391,823.99	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	362,100.00	0.79
B	采矿业	2,071,953.10	4.50
C	制造业	25,128,228.73	54.59
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,251,586.00	2.72

E	建筑业	766,517.00	1.67
F	批发和零售业	1,878,662.80	4.08
G	交通运输、仓储和邮政业	1,062,354.00	2.31
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,352,225.00	5.11
J	金融业	496,712.00	1.08
K	房地产业	3,114,588.68	6.77
L	租赁和商务服务业	919,831.50	2.00
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	357,483.00	0.78
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	1,863,719.00	4.05
S	综合	—	—
	合计	41,625,960.81	90.44

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	603369	今世缘	30,600	698,598.00	1.52
2	603658	安图生物	8,100	667,926.00	1.45
3	000661	长春高新	2,900	660,330.00	1.43
4	600277	亿利洁能	116,200	608,888.00	1.32
5	600176	中国巨石	59,460	608,275.80	1.32
6	600872	中炬高新	21,700	607,600.00	1.32
7	000786	北新建材	31,700	587,401.00	1.28
8	600256	广汇能源	142,890	584,420.10	1.27

9	603589	口子窖	9,400	577,630.00	1.25
10	603025	大豪科技	29,800	576,332.00	1.25

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于本公司网站的半年度报告正文。

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	2,148,380.00	4.67
2	000786	北新建材	1,757,457.00	3.82
3	002271	东方雨虹	1,574,364.00	3.42
4	600195	中牧股份	1,531,549.65	3.33
5	603025	大豪科技	1,418,194.40	3.08
6	000488	晨鸣纸业	1,356,827.00	2.95
7	600410	华胜天成	1,345,255.00	2.92
8	603589	口子窖	1,326,918.58	2.88
9	603658	安图生物	1,248,678.00	2.71
10	603816	顾家家居	1,247,635.48	2.71
11	002221	东华能源	1,231,844.60	2.68
12	600511	国药股份	1,231,227.00	2.67
13	600346	恒力股份	1,224,293.00	2.66
14	000099	中信海直	1,207,409.00	2.62
15	000661	长春高新	1,193,441.90	2.59
16	601020	华钰矿业	1,183,765.00	2.57
17	002078	太阳纸业	1,157,917.00	2.52
18	600201	生物股份	1,143,200.31	2.48
19	600516	方大炭素	1,130,134.00	2.46
20	000685	中山公用	1,120,817.99	2.44

21	000596	古井贡酒	1,109,372.53	2.41
22	600978	宜华生活	1,107,832.00	2.41
23	002340	格林美	1,104,647.00	2.40
24	300088	长信科技	1,093,181.00	2.38
25	002373	千方科技	1,092,277.00	2.37
26	300297	蓝盾股份	1,078,781.45	2.34
27	600155	华创阳安	1,073,723.00	2.33
28	000021	深科技	1,072,908.00	2.33
29	600056	中国医药	1,058,773.00	2.30
30	600611	大众交通	1,057,203.50	2.30
31	603369	今世缘	1,056,436.23	2.30
32	600565	迪马股份	1,042,339.00	2.26
33	600240	华业资本	1,039,852.00	2.26
34	601200	上海环境	1,034,128.65	2.25
35	600312	平高电气	1,024,254.00	2.23
36	600260	凯乐科技	1,021,877.00	2.22
37	600628	新世界	1,014,627.00	2.20
38	600292	远达环保	983,861.44	2.14
39	600566	济川药业	982,787.00	2.14
40	600079	人福医药	981,466.00	2.13
41	002416	爱施德	979,169.00	2.13
42	000581	威孚高科	978,415.54	2.13
43	002681	奋达科技	974,491.00	2.12
44	002551	尚荣医疗	969,187.49	2.11
45	000418	小天鹅A	953,565.00	2.07
46	000598	兴蓉环境	947,516.00	2.06
47	000998	隆平高科	941,923.00	2.05
48	600380	健康元	940,745.12	2.04
49	002032	苏泊尔	930,515.00	2.02

50	002019	亿帆医药	927,406.63	2.01
----	--------	------	------------	------

注：本项“买入金额”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。

8.4.2 累计卖出金额超期末基金资产净值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	000002	万科A	9,388,573.62	20.40
2	600048	保利地产	8,863,414.11	19.26
3	001979	招商蛇口	4,102,047.60	8.91
4	600340	华夏幸福	3,637,806.01	7.90
5	600383	金地集团	2,458,582.87	5.34
6	600606	绿地控股	2,404,917.00	5.22
7	601155	新城控股	2,323,308.54	5.05
8	601318	中国平安	1,804,707.00	3.92
9	600208	新湖中宝	1,625,877.80	3.53
10	002271	东方雨虹	1,580,966.00	3.43
11	002146	荣盛发展	1,467,953.09	3.19
12	600240	华业资本	1,342,024.48	2.92
13	600410	华胜天成	1,326,203.00	2.88
14	002285	世联行	1,281,557.06	2.78
15	600516	方大炭素	1,204,010.00	2.62
16	000596	古井贡酒	1,191,520.89	2.59
17	002340	格林美	1,182,655.75	2.57
18	002078	太阳纸业	1,123,038.00	2.44
19	000786	北新建材	1,080,713.00	2.35
20	600657	信达地产	1,075,235.00	2.34
21	600611	大众交通	1,066,635.00	2.32
22	600201	生物股份	1,064,230.00	2.31
23	600663	陆家嘴	1,054,295.26	2.29

24	002681	奋达科技	1,044,664.00	2.27
25	002221	东华能源	1,019,282.00	2.21
26	600195	中牧股份	1,016,845.00	2.21
27	601200	上海环境	1,005,435.00	2.18
28	600565	迪马股份	1,004,462.55	2.18
29	000402	金融街	1,003,990.21	2.18
30	600773	西藏城投	1,002,091.95	2.18
31	600155	华创阳安	981,019.00	2.13
32	600325	华发股份	977,212.10	2.12
33	000732	泰禾集团	962,295.00	2.09
34	603816	顾家家居	959,659.00	2.08
35	000671	阳光城	944,818.60	2.05
36	000021	深科技	944,801.00	2.05
37	600376	首开股份	941,764.60	2.05
38	000046	泛海控股	941,486.00	2.05
39	000656	金科股份	939,242.00	2.04
40	600266	北京城建	936,811.54	2.04
41	000997	新大陆	924,189.00	2.01

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

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	179,636,419.35
卖出股票收入（成交）总额	206,837,618.79

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名的前十名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 本报告期投资基金情况

本基金本报告期末未投资基金。

8.13 投资组合报告附注

8.13.1 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。

8.13.2 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。

8.13.3 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	201,390.07
2	应收证券清算款	147,296.44
3	应收股利	—
4	应收利息	2,133.93
5	应收申购款	56,880.06

6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	407,700.50

8.13.4 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。

8.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.13.6 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 投资组合报告(天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金)

转型前:

报告期（2018年01月01日-2018年01月17日）

9.1 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	78,350,517.82	75.04
	其中：股票	78,350,517.82	75.04
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	9,988,897.26	9.57
8	其他资产	16,077,932.77	15.40
9	合计	104,417,347.85	100.00

9.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

9.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	594,572.02	0.62

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	1,680,853.38	1.76
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	197,800.35	0.21
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	—	—
J	金融业	197,254.50	0.21
K	房地产业	73,691,131.34	77.28
L	租赁和商务服务业	574,605.93	0.60
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	1,339,416.62	1.40
	合计	78,275,634.14	82.08

9.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	—	—
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—

G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	—	—
J	金融业	—	—
K	房地产业	74,883.68	0.08
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	74,883.68	0.08

注：由于指数成份股调整，上表所列示股票被调出成份股后停牌，故以积极投资股票列示（下同）。

9.3 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

9.3.1 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前十名股票投资明细

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	000002	万科A	235,530	9,367,028.10	9.82
2	600048	保利地产	507,990	9,108,260.70	9.55
3	001979	招商蛇口	168,902	4,171,879.40	4.37
4	600340	华夏幸福	84,309	3,546,036.54	3.72
5	600383	金地集团	151,381	2,529,576.51	2.65
6	600606	绿地控股	244,900	2,365,734.00	2.48
7	601155	新城控股	64,605	2,287,017.00	2.40
8	600208	新潮中宝	288,300	1,553,937.00	1.63

9	002146	荣盛发展	116,501	1,512,182.98	1.59
10	600663	陆家嘴	51,483	1,068,787.08	1.12

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于本公司网站的半年度报告正文。

9.3.2 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前五名股票投资明细

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	000029	深深房A	6,704	74,883.68	0.08

9.4 报告期内股票投资组合的重大变动

9.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	000002	万科A	3,040,980.00	3.40
2	600048	保利地产	2,905,721.00	3.25
3	001979	招商蛇口	1,327,008.00	1.48
4	600340	华夏幸福	1,203,718.00	1.35
5	601155	新城控股	788,342.00	0.88
6	600383	金地集团	763,048.00	0.85
7	600606	绿地控股	697,927.57	0.78
8	600208	新湖中宝	483,850.00	0.54
9	002146	荣盛发展	409,245.00	0.46
10	600663	陆家嘴	362,335.00	0.40
11	000402	金融街	345,704.00	0.39
12	600266	北京城建	319,467.00	0.36
13	002285	世联行	305,726.57	0.34
14	000671	阳光城	303,753.00	0.34
15	600325	华发股份	302,274.00	0.34

16	000656	金科股份	293,553.00	0.33
17	600094	大名城	284,888.00	0.32
18	600376	首开股份	283,116.00	0.32
19	002244	滨江集团	278,286.00	0.31
20	000040	东旭蓝天	267,879.00	0.30

注：本项“买入金额”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。

9.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000002	万科A	4,302,914.57	4.81
2	600048	保利地产	3,957,879.20	4.42
3	001979	招商蛇口	1,849,691.00	2.07
4	600340	华夏幸福	1,515,543.00	1.69
5	600383	金地集团	1,181,868.00	1.32
6	600606	绿地控股	1,095,750.00	1.22
7	601155	新城控股	1,003,098.00	1.12
8	600208	新湖中宝	861,746.81	0.96
9	002146	荣盛发展	680,490.00	0.76
10	000046	泛海控股	597,788.00	0.67
11	600663	陆家嘴	544,253.00	0.61
12	000402	金融街	512,234.00	0.57
13	000671	阳光城	507,926.00	0.57
14	000656	金科股份	501,114.00	0.56
15	000040	东旭蓝天	496,186.00	0.55
16	600325	华发股份	490,526.00	0.55
17	600266	北京城建	488,261.00	0.55
18	002244	滨江集团	477,130.79	0.53
19	600376	首开股份	474,890.00	0.53

20	000961	中南建设	466,193.00	0.52
----	--------	------	------------	------

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。

9.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	24,366,640.34
卖出股票收入（成交）总额	37,270,231.40

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。

9.5 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。

9.6 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。

9.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名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。

9.8 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。

9.9 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。

9.10 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。

9.11 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。

9.12 本报告期投资基金情况

本基金本报告期末投资基金。

9.13 投资组合报告附注

9.13.1 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。

9.13.2 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。

9.13.3 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	77,165.10
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	26,002.35
5	应收申购款	15,974,765.32
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	16,077,932.77

9.13.4 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。

9.13.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

9.13.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限情况。

9.13.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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	000029	深深房A	74,883.68	0.08	重大资产重组

9.13.6 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。

§ 10 基金份额持有人信息(天弘量化驱动股票型证券投资基金)

转型后：

报告期（2018年1月18日-2018年6月30日）

10.1 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
天弘量 化驱动 股票A	4,921	3,694.86	5,000,000. 00	27.50%	13,182,406 .44	72.50%
天弘量 化驱动 股票C	2,948	14,076.15	29,039,174 .27	69.98%	12,457,315 .86	30.02%
合计	7,869	7,584.05	34,039,174 .27	57.04%	25,639,722 .30	42.96%

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）。

10.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

期末基金管理人的从业人员未持有本开放式基金。

10.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的 数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	天弘量化驱动股票A	0
	天弘量化驱动股票C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	天弘量化驱动股票A	0
	天弘量化驱动股票C	0

	合计	0
--	----	---

§ 11 基金份额持有人信息(天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金)
转型前:

报告期（2018年1月1日-2018年1月17日）

11.1 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 证全指 房地产A	4,688	4,191.53	5,000,000.00	25.45%	14,649,870.98	74.55%
天弘中 证全指 房地产C	4,002	21,117.83	43,387,715.93	51.34%	41,125,858.65	48.66%
合计	8,690	11,986.59	48,387,715.93	46.45%	55,775,729.63	53.55%

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）。

11.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

期末基金管理人的从业人员未持有本开放式基金。

11.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	天弘中证全指房地产A	0
	天弘中证全指房地产C	0

	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	天弘中证全指房地产A	0
	天弘中证全指房地产C	0
	合计	0

11.4 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	9.60%	10,000,000.00	9.60%	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	9.60%	10,000,000.00	9.60%	

注：转型后的天弘量化驱动股票型证券投资基金为非发起式基金。

§ 12 开放式基金份额变动

12.1 开放式基金份额变动(转型后)

报告期：2018年1月18日至2018年6月30日

单位：份

	天弘量化驱动股票A	天弘量化驱动股票C
基金转型日(2018年01月18日)基金份额总额	19,649,870.98	84,513,574.58
基金转型日起至报告期期末基金总申购份额	22,866,555.74	53,782,066.10
减：基金转型日起至报告期期末基金总赎回份额	24,334,020.28	96,799,150.55

基金转型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	18,182,406.44	41,496,490.13

注：1、本报告期内，基金管理人根据法律法规及《基金合同》相关规定以通讯方式召开基金份额持有人大会，大会审议通过《关于天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金转型有关事项的议案》，自2018年1月18日起，天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金正式转型为天弘量化驱动股票型证券投资基金。

2、总申购份额含转换转入份额；总赎回份额含转换转出份额。

12.2 开放式基金份额变动(转型前)

报告期：2018年1月1日至2018年1月17日

单位：份

	天弘中证全指房地产A	天弘中证全指房地产C
基金合同生效日(2015年6月30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	14,503,146.63	97,776,292.51
本报告期基金总申购份额	12,201,076.74	54,062,305.24
减：本报告期基金总赎回份额	7,054,352.39	67,325,023.17
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	19,649,870.98	84,513,574.58

注：总申购份额含转换转入份额；总赎回份额含转换转出份额。

§ 13 重大事件揭示

13.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金基金份额持有人大会以通讯方式召开，会议审议通过《关于天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金转型有关事项的议案》。根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的有关规定，基金份额持有人决定的事项自表决通过之日起生效。根据2018年1月16日的计票结果，本次会议议案获得通过，本次大会决议自2018年1月16日起生效。本基金管理人已将表决通过的事项报中国证监会备案。自2018年1月18日起，原《天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金基金合同》、《天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金托管协议》失效，《天弘量化驱动股票型证券投资基金基金合同》、《天弘量化驱动股票

型证券投资基金托管协议》同日起生效。

13.2 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和基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

13.3 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。

13.4 基金投资策略的改变

本报告期内，转型后的天弘量化驱动股票型证券投资基金与原天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金相比，在投资目标、投资范围、投资策略、投资限制、业绩比较基准、风险收益特征等内容均有所调整。调整后的上述内容可查阅本基金管理人于2018年1月18日在指定媒介披露的《天弘量化驱动股票型证券投资基金基金合同》中的相关约定。

13.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本报告期内本基金未持有基金。

13.6 基金改聘会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

13.7 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况

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。

13.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

13.8.1 天弘量化驱动股票型证券投资基金

13.8.1.1 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	佣金	占当期佣金总量的比例	

			例			
东方财富证券	2	—	—	—	—	—
光大证券	—	—	—	—	—	—
海通证券	—	—	—	—	—	—
华泰证券	1	177,762,345.90	46.01%	76,670.74	48.02%	—
兴业证券	1	173,626,623.33	44.94%	74,885.96	46.91%	—
招商证券	2	34,996,234.41	9.06%	8,094.07	5.07%	—

13.8.1.2 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
东方财富证券	—	—	—	—	—	—
光大证券	—	—	—	—	—	—
海通证券	—	—	—	—	—	—
华泰证券	—	—	101,000,000.00	100.00%	—	—
兴业证券	—	—	—	—	—	—
招商证券	—	—	—	—	—	—

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况稳定；经营行为规范，内控制度健全，最近两年未因重大违规行为受到监管机关的处罚；研究实力较强，能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、市场分析报告、行业研究报告、个股分析报告及全面的信息服务等。

2、基金专用交易单元的选择程序：本基金管理人根据上述标准进行考察后，确定选用交易席位的证券经营机构。然后基金管理人和被选用的证券经营机构签订交易席位租用协议。

3、本基金报告期内新租用交易单元：2个，其中包括光大证券上海交易单元1个，海通证券上海交易单元1个。

4、本基金报告期内停止租用交易单元：无。

13.8.2 天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金

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	
东方财富证券	2	16,300,326.81	26.45%	7,030.53	26.45%	—
华泰证券	1	25,678,284.77	41.66%	11,076.03	41.66%	—
兴业证券	1	19,658,260.16	31.89%	8,478.63	31.89%	—
招商证券	2	—	—	—	—	—

注：1、基金专用交易单元的选择标准为：该证券经营机构财务状况良好，各项财务指标显示公司经营情况稳定；经营行为规范，内控制度健全，最近两年未因重大违规行为受到监管机关的处罚；研究实力较强，能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、市场分析报告、行业研究报告、个股分析报告及全面的信息服务等。

2、基金专用交易单元的选择程序：本基金管理人根据上述标准进行考察后，确定选用交易席位的证券经营机构。然后基金管理人和被选用的证券经营机构签订交易席位租用协议。

3、本基金报告期内新租用交易单元：无。

4、本基金报告期内停止租用交易单元：无。

§ 14 影响投资者决策的其他重要信息

14.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2018/01/01-2018/01/03	25,588,536.34	-	25,588,536.34	-	-

2	2018/03/01-2018/05/21;2018/05/23-2018/05/27	10,000,000.00	-	-	10,000,000.00	16.76%
3	2018/01/01-2018/02/28	38,387,715.93	-	38,387,715.93	-	-

产品特有风险

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

- （1）超出基金管理人允许的单一投资者持有基金份额比例的申购申请不被确认的风险；
- （2）极端市场环境下投资者集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对赎回申请的风险；
- （3）持有基金份额占比较高的投资者大额赎回可能引发基金净值大幅波动的风险；
- （4）持有基金份额占比较高的投资者在召开基金份额持有人大会并对重大事项进行投票表决时，可能拥有较大话语权；
- （5）极端情况下，持有基金份额占比较高的投资者大量赎回后，可能出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元而面临的转换基金运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等风险。

14.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，基金管理人根据法律法规及《基金合同》相关规定以通讯方式召开基金份额持有人大会，大会审议通过《关于天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金转型有关事项的议案》，自2018年1月18日起，天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金正式转型为天弘量化驱动股票型证券投资基金。具体信息请参见基金管理人于2018年1月18日在指定媒介披露的《关于天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金基金份额持有人大会决议生效的公告》。

天弘基金管理有限公司
二〇一八年八月二十七日