

天弘中证800指数型发起式证券投资基金2017年半年度报告

2017年06月30日

基金管理人：天弘基金管理有限公司

基金托管人：广发证券股份有限公司

送出日期：2017年08月28日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 重要提示

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

基金托管人广发证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年8月24日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2017年1月1日起至2017年6月30日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介.....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	5
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告.....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
§5 托管人报告.....	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	13
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明.....	14
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	19
§7 投资组合报告.....	42
7.1 期末基金资产组合情况.....	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	43
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细.....	44
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	72
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	81
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细.....	81
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	81
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细.....	81
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细.....	81
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	81
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	81
7.12 投资组合报告附注.....	82
§8 基金份额持有人信息.....	83
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	83
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况.....	83
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	83
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	84
§9 开放式基金份额变动.....	84
§10 重大事件揭示.....	84
10.1 基金份额持有人大会决议.....	84

10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	85
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	85
10.4	基金投资策略的改变 .....	85
10.5	基金改聘会计师事务所情况 .....	85
10.6	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 .....	85
10.7	本期基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	85
10.8	其他重大事件 .....	86
§11	影响投资者决策的其他重要信息 .....	88
11.1	报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况 .....	88
11.2	影响投资者决策的其他重要信息 .....	89
§12	备查文件目录 .....	89
12.1	备查文件目录 .....	89
12.2	存放地点 .....	90
12.3	查阅方式 .....	90

## § 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	230,218,416.08份	
基金合同存续期	不定期	
下属两级基金的基金简称	天弘中证800A	天弘中证800C
下属两级基金的交易代码	001588	001589
报告期末下属两级基金的份 额总额	211,427,502.63份	18,790,913.45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	崔瑞娟
	联系电话	022-83310208	020-87555888
	电子邮箱	service@thfund.com.cn	cuirj@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	广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街2号618室
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	广东省广州市天河区河北路183-187号大都会广场40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
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.thfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公地址

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	天弘基金管理有限公司	天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层

## § 3 主要财务指标和基金净值表现

### 3.1 主要会计数据和财务指标

单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2017年01月01日-2017年06月30日）	
	天弘中证800A	天弘中证800C
本期已实现收益	537,385.45	-38,628.99
本期利润	4,824,924.46	809,859.37
加权平均基金份额本期利润	0.0505	0.0731
本期基金加权平均净值利润率	6.21%	9.01%
本期基金份额净值增长率	7.39%	7.26%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年06月30日)	
期末可供分配利润	-30,847,592.34	-2,821,794.71
期末可供分配基金份额利润	-0.1459	-0.1502
期末基金资产净值	180,579,910.29	15,969,118.74
期末基金份额净值	0.8541	0.8498
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2017年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	-14.59%	-15.02%

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。

## 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
过去一个月	5.71%	0.60%	4.84%	0.60%	0.87%	0.00%
过去三个月	4.30%	0.61%	2.94%	0.62%	1.36%	-0.01%
过去六个月	7.39%	0.57%	6.61%	0.57%	0.78%	0.00%

过去一年	11.85%	0.65%	10.83%	0.66%	1.02%	-0.01%
自基金合同生效日起 至今（2015年07月16 日-2017年06月30日）	-14.59%	1.57%	-9.63%	1.58%	-4.96%	-0.01%
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
过去一个月	5.68%	0.59%	4.84%	0.60%	0.84%	-0.01%
过去三个月	4.23%	0.61%	2.94%	0.62%	1.29%	-0.01%
过去六个月	7.26%	0.56%	6.61%	0.57%	0.65%	-0.01%
过去一年	11.57%	0.65%	10.83%	0.66%	0.74%	-0.01%
自基金合同生效日起 至今（2015年07月16 日-2017年06月30日）	-15.02%	1.57%	-9.63%	1.58%	-5.39%	-0.01%

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。

### 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。

2、本报告期内，本基金的各项投资比例达到基金合同约定的各项比例要求。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

伙)	
合计	100%

截至2017年6月30日，本基金管理人共管理55只基金：天弘精选混合型证券投资基金、天弘永利债券型证券投资基金、天弘永定价值成长混合型证券投资基金、天弘周期策略混合型证券投资基金、天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金、天弘添利债券型证券投资基金（LOF）、天弘丰利债券型证券投资基金（LOF）、天弘现金管家货币市场基金、天弘债券型发起式证券投资基金、天弘安康养老混合型证券投资基金、天弘余额宝货币市场基金、天弘稳利定期开放债券型证券投资基金、天弘弘利债券型证券投资基金、天弘通利混合型证券投资基金、天弘同利债券型证券投资基金（LOF）、天弘瑞利分级债券型证券投资基金、天弘沪深300指数型发起式证券投资基金、天弘中证500指数型发起式证券投资基金、天弘增益宝货币市场基金、天弘云端生活优选灵活配置混合型证券投资基金、天弘新活力灵活配置混合型发起式证券投资基金、天弘互联网灵活配置混合型证券投资基金、天弘惠利灵活配置混合型证券投资基金、天弘新价值灵活配置混合型证券投资基金、天弘云商宝货币市场基金、天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金、天弘中证医药100指数型发起式证券投资基金、天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金、天弘中证全指运输指数型发起式证券投资基金、天弘中证移动互联网指数型发起式证券投资基金、天弘中证证券保险指数型发起式证券投资基金、天弘中证银行指数型发起式证券投资基金、天弘创业板指数型发起式证券投资基金、天弘中证高端装备制造指数型发起式证券投资基金、天弘上证50指数型发起式证券投资基金、天弘中证100指数型发起式证券投资基金、天弘中证800指数型发起式证券投资基金、天弘中证环保产业指数型发起式证券投资基金、天弘中证电子指数型发起式证券投资基金、天弘中证休闲娱乐指数型发起式证券投资基金、天弘中证计算机指数型发起式证券投资基金、天弘中证食品饮料指数型发起式证券投资基金、天弘弘运宝货币市场基金、天弘鑫安宝保本混合型证券投资基金、天弘裕利灵活配置混合型证券投资基金、天弘乐享保本混合型证券投资基金、天弘价值精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、天弘安盈灵活配置混合型证券投资基金、天弘喜利灵活配置混合型证券投资基金、天弘信利债券型证券投资基金、天弘聚利灵活配置混合型证券投资基金、天弘金利灵活配置混合型证券投资基金、天弘金明灵活配置混合型证券投资基金、天弘天盈灵活配置混合型证券投资基金、天弘策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘冬	本基金基金经理	2015年07月	2017年04月	11年	男，经济学硕士。2007年7月至2008年10月在长江证

	理。				券股份有限公司研究部任宏观策略研究员。2008年11月加盟本公司，历任本公司投资部固定收益研究员、宏观策略研究员、基金经理助理等。
张子法	本基金基金经理。	2017年04月	—	15年	男，软件工程硕士。历任华夏基金管理有限公司金融工程师量化研究员。2014年3月加盟本公司，历任股票研究员、基金经理助理。

注：1、上述任职日期为基金合同生效日或本基金管理人对外披露的任职日期。

2、上述离任日期为本基金管理人对外披露的离任日期。

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

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

本报告期内，本基金运作合法合规，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

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

#### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

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

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

#### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

##### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

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

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截止2017年6月30日,本基金A级份额净值为0.8541元,C级份额净值为0.8498元。报告期内份额净值增长率A级为7.39%,C级为7.26%,同期业绩比较基准增长率为6.61%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

下半年,按照全国金融工作会议精神,经济去杠杆特别是国有企业去杠杆将被作为重点工作,在非金融企业债务偏高,楼市整体仍属偏热的情况下,货币政策预计会保

持稳健，短期内难再宽松。再加上固定资产投资，工业生产和PPP在二季度出现了放缓，企业盈利增长的放缓压力可能会逐步显现，市场出现整体性机会的要素尚不充分。但市场上也有不少积极因素，6月底MSCI宣布纳入A股将为股市注入新的资金和活力，政治局会议要求实施好积极的财政政策，结构性减税政策的持续落实也将减轻企业税负，十九大的召开又将释放改革开放想象空间，故市场大概率还是以结构性机会为主。

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

#### 4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

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

本报告期内本基金管理人无应说明预警信息。

### § 5 托管人报告

#### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，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合规守信、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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本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2017年半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 半年度财务会计报告（未经审计）

### 6.1 资产负债表

会计主体：天弘中证800指数型发起式证券投资基金

报告截止日：2017年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017年06月30日	上年度末 2016年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	13,072,714.03	748,453.38
结算备付金		80,856.00	2,184.20
存出保证金		127,616.69	1,317.91
交易性金融资产	6.4.7.2	183,434,952.60	9,716,027.39
其中：股票投资		183,434,952.60	9,716,027.39
基金投资		—	—
债券投资		—	—
资产支持证券投资		—	—

贵金属投资		—	—
衍生金融资产	6.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	—	—
应收证券清算款		107,699.36	—
应收利息	6.4.7.5	2,674.29	167.82
应收股利		—	—
应收申购款		23,758.35	14,747.24
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.6	—	—
资产总计		196,850,271.32	10,482,897.94
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017年06月30日</b>	<b>上年度末 2016年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
短期借款		—	—
交易性金融负债		—	—
衍生金融负债	6.4.7.3	—	—
卖出回购金融资产款		—	—
应付证券清算款		—	15.95
应付赎回款		54,794.82	20,125.49
应付管理人报酬		78,088.28	4,380.81
应付托管费		15,617.62	876.15
应付销售服务费		3,111.94	978.59
应付交易费用	6.4.7.7	47,154.09	624.20
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	102,475.54	138,003.88
负债合计		301,242.29	165,005.07
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	6.4.7.9	230,218,416.08	12,995,799.45

未分配利润	6.4.7.10	-33,669,387.05	-2,677,906.58
所有者权益合计		196,549,029.03	10,317,892.87
负债和所有者权益总计		196,850,271.32	10,482,897.94

注：报告截止日2017年6月30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0.8541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0.8498元，基金份额总额230,218,416.08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211,427,502.63份，天弘中证800指数型发起式证券投资基金C类基金份额18,790,913.45份。

## 6.2 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：2017年01月01日-2017年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017年01月01日-2017 年06月30日	上年度可比期间2016 年01月01日-2016年06 月30日
一、收入		6,062,592.02	-1,505,463.52
1. 利息收入		34,152.03	3,075.71
其中：存款利息收入	6.4.7 .11	34,152.03	3,075.71
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		890,733.29	-136,971.46
其中：股票投资收益	6.4.7 .12	-432,442.86	-208,602.70
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	1,323,176.15	71,631.24
3. 公允价值变动收益	6.4.7 .17	5,136,027.37	-1,372,330.52
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7 .18	1,679.33	762.75
<b>减：二、费用</b>		427,808.19	113,028.84
1. 管理人报酬		209,631.04	22,797.76
2. 托管费		41,926.12	4,559.50
3. 销售服务费		10,972.15	4,719.36
4. 交易费用	6.4.7 .19	84,813.92	2,133.52
5. 利息支出		—	—
其中：卖出回购金融资产支出		—	—
6. 其他费用	6.4.7 .20	80,464.96	78,818.70
<b>三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）</b>		5,634,783.83	-1,618,492.36
减：所得税费用		—	—
<b>四、净利润（净亏损以“-”号填列）</b>		5,634,783.83	-1,618,492.36

### 6.3 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：2017年01月01日-2017年06月30日

单位：人民币元

项目	本期
----	----

	2017年01月01日-2017年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	12,995,799.45	-2,677,906.58	10,317,892.87
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	5,634,783.83	5,634,783.83
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)	217,222,616.63	-36,626,264.30	180,596,352.33
其中：1. 基金申购款	226,101,513.00	-38,251,329.14	187,850,183.86
2. 基金赎回款	-8,878,896.37	1,625,064.84	-7,253,831.53
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)	230,218,416.08	-33,669,387.05	196,549,029.03
项 目	上年度可比期间 2016年01月01日-2016年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	11,263,417.37	-1,029,205.25	10,234,212.12
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	-1,618,492.36	-1,618,492.36
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)	1,060,036.97	-275,163.75	784,873.22
其中：1. 基金申购款	4,633,924.73	-1,146,642.76	3,487,281.97
2. 基金赎回款	-3,573,887.76	871,479.01	-2,702,408.75
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	12,323,454.34	-2,922,861.36	9,400,592.98

(基金净值)			
--------	--	--	--

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

郭树强

韩海潮

薄贺龙

-----  
基金管理人负责人-----  
主管会计工作负责人-----  
会计机构负责人

## 6.4 报表附注

### 6.4.1 基金基本情况

天弘中证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。

根据《天弘中证800指数型发起式证券投资基金基金合同》和《天弘中证800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800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800指数型发起式证券投资基金C类(以下简称“C类基金”)。本基金A类和C类两种收费模式并存,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×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定（以下合称“企业会计准则”）、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号〈年度报告和半年度报告〉》、中国证券投资基金业协会（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。

#### 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2017年度上半年财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2017年6月30日的财务状况以及2017上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一年度会计报告所采用的会计政策、会计估计一致。

#### 6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

#### 6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号

《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

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

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017年06月30日
活期存款	13,072,714.03
定期存款	—
其中：存款期限1-3个月	—
其他存款	—
合计	13,072,714.03

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末2017年06月30日		
	成本	公允价值	估值增值
股票	179,650,507.69	183,434,952.60	3,784,444.91
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	—	—	—
其他	—	—	—
合计	179,650,507.69	183,434,952.60	3,784,444.91

注：截至2017年6月30日，股票投资余额中包含按照指数收益法估值的特殊事项停牌相关股票。

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有因买断式逆回购而取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末:2017年06月30日
应收活期存款利息	2,580.49
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	36.40
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	57.40
合计	2,674.29

#### 6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年06月30日
交易所市场应付交易费用	47,154.09
银行间市场应付交易费用	—
合计	47,154.09

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2017年06月30日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	10.58
预提费用	94,464.96
其他应付	8,000.00
合计	102,475.54

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目 (天弘中证800A)	本期 2017年01月01日-2017年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	7,120,937.77	7,120,937.77
本期申购	205,860,187.16	205,860,187.16
本期赎回	-1,553,622.30	-1,553,622.30

期末数	211,427,502.63	211,427,502.63
项目 (天弘中证800C)	基金份额(份)	账面金额
上年度末	5,874,861.68	5,874,861.68
本期申购	20,241,325.84	20,241,325.84
本期赎回	-7,325,274.07	-7,325,274.07
期末数	18,790,913.45	18,790,913.45

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目 (天弘中证800A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-520,686.96	-936,933.67	-1,457,620.63
本期利润	537,385.45	4,287,539.01	4,824,924.46
本期基金份额交易产生的变动数	-17,957,835.14	-16,257,061.03	-34,214,896.17
其中：基金申购款	-18,086,288.29	-16,413,746.24	-34,500,034.53
基金赎回款	128,453.15	156,685.21	285,138.36
本期已分配利润	—	—	—
本期末	-17,941,136.65	-12,906,455.69	-30,847,592.34

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
上年度末	-446,884.35	-773,401.60	-1,220,285.95
本期利润	-38,628.99	848,488.36	809,859.37
本期基金份额交易产生的变	-1,181,868.06	-1,229,500	-2,411,368.13



动数		.07	
其中：基金申购款	-1,805,037.75	-1,946,256.86	-3,751,294.61
基金赎回款	623,169.69	716,756.79	1,339,926.48
本期已分配利润	—	—	—
本期末	-1,667,381.40	-1,154,413.31	-2,821,794.71

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日-2017年06月30日
活期存款利息收入	31,175.38
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	2,646.29
其他	330.36
合计	34,152.03

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日-2017年06月30日
股票投资收益——买卖股票 差价收入	-432,442.86
股票投资收益——赎回差价 收入	—
合计	-432,442.86

##### 6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017年01月01日-2017年06月30日
卖出股票成交总额	18,848,072.86
减：卖出股票成本总额	19,280,515.72
买卖股票差价收入	-432,442.86

#### 6.4.7.13 债券投资收益

##### 6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期未取得债券投资收益。

##### 6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

本基金本报告期未取得资产支持证券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期未取得贵金属投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期未取得衍生工具投资收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2017年01月01日-2017年06月30日
股票投资产生的股利收益	1,323,176.15
基金投资产生的股利收益	—
合计	1,323,176.15

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2017年01月01日-2017年06月30日
1. 交易性金融资产	5,136,027.37
——股票投资	5,136,027.37

——债券投资	—
——资产支持证券投资	—
——贵金属投资	—
2. 衍生工具	—
——权证投资	—
3. 其他	—
合计	5,136,027.37

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2017年01月01日-2017年06月30日
基金赎回费收入	1,678.54
基金转换费收入	0.79
合计	1,679.33

注：1. 本基金的赎回费率按持有期间递减，本基金对持续持有A类基金份额少于7天的投资人收取的赎回费，将不低于赎回费总额的25%计入基金资产，C类基金份额的赎回费总额全部归入基金资产。

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，其中对持续持有A类基金份额少于7天的投资人，转出A类基金份额的赎回费总额的不低于25%归入基金资产，转出C类基金份额的赎回费总额全部归入基金资产。

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2017年01月01日-2017年06月30日
交易所市场交易费用	84,813.92
银行间市场交易费用	—
合计	84,813.92

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
----	----

2017年01月01日-2017年06月30日	
审计费用	14,876.39
信息披露费	49,588.57
指数使用费	16,000.00
合计	80,464.96

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

##### 6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
天弘基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

##### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年01月01日-2017年06月30日		上年度可比期间 2016年01月01日-2016年06月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
广发证券	206,138,378.34	100.00%	3,118,689.83	100.00%

#### 6.4.10.1.2 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。

#### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年01月01日-2017年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占应付佣金余额的比例
广发证券	47,679.76	100.00%	47,154.09	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2016年01月01日-2016年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占应付佣金余额的比例
广发证券	721.54	100.00%	423.18	100.00%

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

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

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年01月01日-2017年06月30日	上年度可比期间 2016年01月01日-2016年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	209,631.04	22,797.76
其中：支付销售机构的客户维护费	1,840.06	545.39

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。

#### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年01月01日-2017 年06月30日	上年度可比期间 2016年01月01日-2016 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	41,926.12	4,559.50

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。

#### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的 各关联方名称	本期 2017年01月01日-2017年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	天弘中证800A	天弘中证800C	合计
天弘基金管理有限公司	—	9,861.12	9,861.12
广发证券	—	20.37	20.37
合计	—	9,881.49	9,881.49
获得销售服务费的 各关联方名称	上年度可比期间2016年01月01日-2016年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	天弘中证800A	天弘中证800C	合计
天弘基金管理有限公司	—	4,659.37	4,659.37
合计	—	4,659.37	4,659.37

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。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2017年01月01日-2017年06月 30日		上年度可比期间 2016年01月01日-2016年06月 30日	
	天弘中证800A	天弘中证 800C	天弘中证800A	天弘中证 800C
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	2.17%	2.17%	40.57%	40.57%

##### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本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。

##### 6.4.10.5 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 2017年01月01日-2017年06月30 日		上年度可比期间 2016年01月01日-2016年06月30 日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
广发证券活期 存款	13,072,714.03	31,175.38	660,501.86	3,013.85

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。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期未在承销期内参与关联方承销证券交易。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配。

#### 6.4.12 期末（2017年06月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.2.9.1.1 受限证券类别：股票									
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量	期末成本总额	期末估值总额
603305	旭升股份	2017-06-30	2017-07-10	新股尚未上市流通	11.26	11.26	1,351	15,212.26	15,212.26
603331	百达精工	2017-06-27	2017-07-05	新股尚未上市流通	9.63	9.63	999	9,620.37	9,620.37
603617	君禾股份	2017-06-23	2017-07-03	新股尚未上市流通	8.93	8.93	832	7,429.76	7,429.76
603933	睿能科技	2017-06-28	2017-07-06	新股尚未上市流通	20.20	20.20	857	17,311.40	17,311.40
002879	长缆科技	2017-06-05	2017-07-07	新股尚未上市流通	18.02	18.02	1,313	23,660.26	23,660.26
002882	金龙羽	2017-06-15	2017-07-17	新股尚未上市流通	6.20	6.20	2,966	18,389.20	18,389.20
300670	大烨智能	2017-06-26	2017-07-03	新股尚未上市流通	10.93	10.93	1,259	13,760.87	13,760.87
300671	富满电子	2017-06-27	2017-07-05	新股尚未上市流通	8.11	8.11	942	7,639.62	7,639.62
300672	国科微	2017-06-30	2017-07-13	新股尚未上市流通	8.48	8.48	1,257	10,659.36	10,659.36

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票

金额单位：人民币元

股票	股票	停牌	停牌原因	期末	复牌	复牌	数量	期末	期末
----	----	----	------	----	----	----	----	----	----



代码	名称	日期		估值单价	日期	开盘单价		成本总额	估值总额
600468	百利电气	2017-05-16	重大资产重组	6.50			4,055	33,341.76	26,357.50
600654	*ST中安	2017-06-07	重大资产重组	13.48			700	13,470.69	9,436.00
600666	奥瑞德	2017-04-27	重大资产重组	17.40			9,600	167,135.00	167,040.00
600050	中国联通	2017-04-05	重大事项	7.47	2017-08-21	8.22	7,200	48,176.81	53,784.00
600100	同方股份	2017-04-21	重大资产重组	14.37			23,300	347,668.86	334,821.00
600277	亿利洁能	2017-03-06	重大资产重组	7.83			600	3,911.25	4,698.00
600289	亿阳信通	2017-05-10	重大事项	10.94	2017-08-18	12.03	5,700	72,415.31	62,358.00
600460	士兰微	2017-05-12	重大资产重组	6.07	2017-08-15	6.68	9,400	58,123.70	57,058.00
600485	信威集团	2016-12-26	重大资产重组	14.59			900	22,317.22	13,131.00
600545	新疆城建	2017-06-22	重大事项	11.96	2017-07-03	12.44	6,702	87,433.33	80,155.92
600643	爱建集团	2017-04-17	重大资产重组	14.98	2017-08-02	16.48	14,800	223,246.32	221,704.00
600655	豫园商城	2016-12-20	重大资产重组	11.32			701	11,757.70	7,935.32
600657	信达地产	2017-02-20	重大资产重组	5.76	2017-08-10	6.19	500	2,945.69	2,880.00
600673	东阳光科	2016-11-15	重大资产重组	7.29			1,500	12,382.23	10,935.00
600795	国电电力	2017-06-05	重大资产重组	3.60			149,900	528,891.41	539,640.00
600959	江苏有线	2017-06-19	重大资产重组	10.57			19,320	202,751.68	204,212.40
601001	大同煤业	2017-06-22	重大事项	5.25	2017-07-21	5.78	10,400	63,224.77	54,600.00
601088	中国神华	2017-06-05	重大事项	22.29			24,800	476,177.62	552,792.00
601608	中信重工	2017-04-19	重大事项	5.54	2017-07-26	5.26	13,500	79,506.63	74,790.00
601717	郑煤机	2017-04-24	重大资产重组	7.79			11,600	98,722.03	90,364.00
601722	上海	2017-	重大资产	7.57	2017-	7.54	40,20	351,526.3	304,314.0

7	电气	06-22	重组		07-03		0	9	0
601872	招商 轮船	2017- 05-02	重大事项	5.16			27,70 0	152,232.1 2	142,932.0 0
601919	中远 海控	2017- 05-17	重大资产 重组	5.35	2017- 07-26	5.89	48,70 0	298,966.3 8	260,545.0 0
601989	中国 重工	2017- 05-31	重大资产 重组	6.21			115,0 00	916,369.6 1	714,150.0 0
000693	*ST华 泽	2016- 03-01	重大事项	12.50			200	3,902.00	2,500.00
002025	航天 电器	2016- 09-12	重大资产 重组	24.95	2017- 07-04	22.46	200	6,157.00	4,990.00
002129	中环 股份	2016- 04-25	重大事项	8.27			1,000	15,541.30	8,270.00
002168	深圳 惠程	2017- 01-23	重大资产 重组	16.99			600	7,064.93	10,194.00
002399	海普 瑞	2017- 04-28	重大事项	20.23			4,920	104,674.9 5	99,531.60
000061	农产 品	2017- 06-28	重大事项	9.06			9,200	104,015.4 0	83,352.00
000099	中信 海直	2017- 05-04	重大资产 重组	11.26			5,500	69,351.00	61,930.00
000100	TCL 集团	2017- 04-21	重大事项	3.48	2017- 07-26	3.72	97,60 0	358,650.0 7	339,648.0 0
000503	海虹 控股	2017- 05-11	重大资产 重组	24.93			10,00 0	329,728.6 1	249,300.0 0
000656	金科 股份	2017- 05-05	重大事项	6.54	2017- 07-05	5.92	51,10 1	306,256.3 2	334,200.5 4
002013	中航 机电	2017- 05-12	重大事项	10.33	2017- 08-02	11.36	13,27 5	162,372.8 4	137,130.7 5
002049	紫光 国芯	2017- 02-20	重大资产 重组	30.82	2017- 07-17	27.74	300	12,090.25	9,246.00
002122	天马 股份	2017- 04-24	重大资产 重组	10.30	2017- 07-24	11.15	8,002	80,701.10	82,420.60
002127	南极 电商	2017- 06-29	重大事项	12.08	2017- 07-06	12.61	9,700	117,187.0 0	117,176.0 0
002128	露天 煤业	2017- 03-17	重大资产 重组	8.70	2017- 08-14	9.57	500	4,088.27	4,350.00
002252	上海 莱士	2017- 04-21	重大事项	20.24			12,92 0	260,493.8 6	261,500.8 0
002358	森源 电气	2017- 05-12	重大资产 重组	17.02	2017- 07-12	16.68	5,100	96,670.00	86,802.00
00242	胜利	2017-	重大事项	7.68			1,200	11,671.80	9,216.00

6	精密	01-16							
002505	大康农业	2017-03-13	重大资产重组	3.50			1,240	4,556.40	4,340.00
002642	荣之联	2017-04-10	重大事项	25.06	2017-07-07	22.54	250	7,054.00	6,265.00
002681	奋达科技	2017-06-22	重大事项	12.59	2017-07-03	12.70	5,101	72,144.92	64,221.59
300088	长信科技	2016-09-12	重大资产重组	15.75	2017-08-09	14.50	600	6,167.10	9,450.00
300104	乐视网	2017-04-17	重大资产重组	28.64			12,701	402,865.75	363,756.64
300134	大富科技	2017-02-09	重大资产重组	23.36			300	7,851.00	7,008.00
300291	华录百纳	2017-04-19	重大资产重组	20.02			3,200	65,086.33	64,064.00

注：本基金截至2017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。

### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2017年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。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2017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。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为指数型基金，采用指数复制投资策略，标的指数为中证800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。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在具有基金托管资格的中国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2017年6月30日，本基金未持有债券。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金

的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场上出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

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

于2017年6月30日，本基金所承担的全部金融负债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。

#### 6.4.13.4 市场风险

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

##### 6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2017年06月30 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	13,072,714 .03	—	—	—	13,072,714 .03
结算备付金	80,856.00	—	—	—	80,856.00
存出保证金	127,616.69	—	—	—	127,616.69
交易性金融资产	—	—	—	183,434,95 2.60	183,434,95 2.60
应收证券清算款	—	—	—	107,699.36	107,699.36
应收利息	—	—	—	2,674.29	2,674.29
应收申购款	—	—	—	23,758.35	23,758.35
资产总计	13,281,186 .72	—	—	183,569,08 4.60	196,850,27 1.32
负债					
应付赎回款	—	—	—	54,794.82	54,794.82
应付管理人报酬	—	—	—	78,088.28	78,088.28
应付托管费	—	—	—	15,617.62	15,617.62
应付销售服务费	—	—	—	3,111.94	3,111.94
应付交易费用	—	—	—	47,154.09	47,154.09
其他负债	—	—	—	102,475.54	102,475.54
负债总计	—	—	—	301,242.29	301,242.29
利率敏感度缺口	13,281,186 .72	—	—	183,267,84 2.31	196,549,02 9.03
上年度末 2016年12月31 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

资产					
银行存款	748,453.38	—	—	—	748,453.38
结算备付金	2,184.20	—	—	—	2,184.20
存出保证金	1,317.91	—	—	—	1,317.91
交易性金融资产	—	—	—	9,716,027.39	9,716,027.39
应收利息	—	—	—	167.82	167.82
应收申购款	—	—	—	14,747.24	14,747.24
资产总计	751,955.49	—	—	9,730,942.45	10,482,897.94
负债					
应付证券清算款	—	—	—	15.95	15.95
应付赎回款	—	—	—	20,125.49	20,125.49
应付管理人报酬	—	—	—	4,380.81	4,380.81
应付托管费	—	—	—	876.15	876.15
应付销售服务费	—	—	—	978.59	978.59
应付交易费用	—	—	—	624.20	624.20
其他负债	—	—	—	138,003.88	138,003.88
负债总计	—	—	—	165,005.07	165,005.07
利率敏感度缺口	751,955.49	—	—	9,565,937.38	10,317,892.87

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

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2017年6月30日，本基金未持有交易性债券投资（2016年12月31日：同），因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响（2016年12月31日：同）。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

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

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

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

##### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2017年06月30日		上年度末 2016年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	183,434,952.60	93.33	9,716,027.39	94.17
交易性金融资产-债券投资	—	—	—	—
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	183,434,952.60	93.33	9,716,027.39	94.17

##### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注6.4.1)以外的其他市场变量保持不变
----	-------------------------------



分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的 影响金额（单位：人民币元）	
		本期末 2017年06月30日	上年度末 2016年12月31日
	1. 业绩比较基准上升5%	9,796,165.76	527,539.88
	2. 业绩比较基准下降5%	-9,796,165.76	-527,539.88

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i) 各层次金融工具公允价值

于2017年6月30日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为176,899,772.84元，属于第二层次的余额为6,535,179.76元，无属于第三层次的余额。（2016年12月31日：第一层次的余额为9,333,898.53元，第二层次382,128.86元，无属于第三层次的余额）。

##### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

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

##### (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

##### (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2017年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（2016年12月31日：同）。

##### (d) 不以公允价值计量的金融工具

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

## (2) 增值税

根据财政部、国家税务总局于2016年12月21日颁布的财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定：(1) 金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益)，不征收增值税；(2) 纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；(3) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。上述政策自2016年5月1日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于2017年1月6日颁布的财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及2017年6月30日颁布的财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	183,434,952.60	93.19
	其中：股票	183,434,952.60	93.19
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	13,153,570.03	6.68
6	其他资产	261,748.69	0.13
7	合计	196,850,271.32	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	905,917.01	0.46
B	采矿业	5,864,566.07	2.98
C	制造业	79,728,080.61	40.56
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,379,996.77	2.74
E	建筑业	7,360,660.12	3.74
F	批发和零售业	5,501,867.28	2.80
G	交通运输、仓储和邮政业	5,217,349.13	2.65
H	住宿和餐饮业	54,200.00	0.03
I	信息传输、软件和信息技术服务业	9,317,657.03	4.74
J	金融业	45,822,450.02	23.31
K	房地产业	10,461,796.38	5.32
L	租赁和商务服务业	2,160,339.45	1.10
M	科学研究和技术服务业	123,545.20	0.06
N	水利、环境和公共设施管理业	1,623,237.80	0.83
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	60,144.00	0.03
Q	卫生和社会工作	402,740.80	0.20
R	文化、体育和娱乐业	2,168,182.25	1.10
S	综合	635,876.50	0.32
	合计	182,788,606.42	93.00

## 7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	2,500.00	0.00
C	制造业	626,770.56	0.32
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	17,075.62	0.01
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—
S	综合	—	—
	合计	646,346.18	0.33

注：由于指数成份股调整，上表所列示股票中，百利电气(证券代码：600468)、\*ST中安(证券代码：600654)、奥瑞德(证券代码：600666)、\*ST华泽(证券代码：000693)、航天电器(证券代码：002025)、中环股份(证券代码：002129)、深圳惠程(证券代码：002168)、海普瑞(证券代码：002399)被调出成份股后停牌，故以积极投资股票列示（下同）。

## 7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	137,900	6,841,219.00	3.48
2	600036	招商银行	131,000	3,132,210.00	1.59
3	600519	贵州茅台	6,400	3,019,840.00	1.54
4	000651	格力电器	65,400	2,692,518.00	1.37
5	601166	兴业银行	158,300	2,668,938.00	1.36
6	000333	美的集团	61,450	2,644,808.00	1.35
7	600016	民生银行	300,300	2,468,466.00	1.26
8	000002	万 科 A	92,501	2,309,749.97	1.18
9	601328	交通银行	349,000	2,149,840.00	1.09
10	601668	中国建筑	190,500	1,844,040.00	0.94
11	600000	浦发银行	142,764	1,805,964.60	0.92
12	601288	农业银行	485,600	1,709,312.00	0.87
13	600030	中信证券	99,900	1,700,298.00	0.87
14	600887	伊利股份	77,200	1,666,748.00	0.85
15	600837	海通证券	102,800	1,526,580.00	0.78
16	002415	海康威视	46,875	1,514,062.50	0.77
17	000858	五 粮 液	25,900	1,441,594.00	0.73
18	601398	工商银行	274,000	1,438,500.00	0.73
19	601169	北京银行	154,460	1,416,398.20	0.72
20	600104	上汽集团	44,502	1,381,787.10	0.70
21	601601	中国太保	39,900	1,351,413.00	0.69
22	000725	京东方 A	323,100	1,344,096.00	0.68
23	600900	长江电力	83,800	1,288,844.00	0.66
24	601766	中国中车	123,600	1,250,832.00	0.64
25	601211	国泰君安	57,200	1,173,172.00	0.60
26	000001	平安银行	116,720	1,096,000.80	0.56
27	600276	恒瑞医药	21,397	1,082,474.23	0.55
28	601988	中国银行	267,700	990,490.00	0.50
29	600048	保利地产	90,300	900,291.00	0.46

30	600518	康美药业	37,800	821,772.00	0.42
31	601390	中国中铁	94,700	821,049.00	0.42
32	601818	光大银行	202,300	819,315.00	0.42
33	600028	中国石化	133,500	791,655.00	0.40
34	000063	中兴通讯	32,300	766,802.00	0.39
35	002450	康得新	33,499	754,397.48	0.38
36	600019	宝钢股份	112,292	753,479.32	0.38
37	600015	华夏银行	81,560	751,983.20	0.38
38	601688	华泰证券	41,401	741,077.90	0.38
39	601989	中国重工	115,000	714,150.00	0.36
40	002304	洋河股份	8,200	711,842.00	0.36
41	601186	中国铁建	58,400	702,552.00	0.36
42	001979	招商蛇口	32,221	688,240.56	0.35
43	000538	云南白药	7,001	657,043.85	0.33
44	601006	大秦铁路	75,500	633,445.00	0.32
45	600703	三安光电	31,000	610,700.00	0.31
46	600690	青岛海尔	38,800	583,940.00	0.30
47	600585	海螺水泥	25,501	579,637.73	0.29
48	601628	中国人寿	21,100	569,278.00	0.29
49	002024	苏宁云商	50,600	569,250.00	0.29
50	601088	中国神华	24,800	552,792.00	0.28
51	600958	东方证券	39,500	549,445.00	0.28
52	601336	新华保险	10,501	539,751.40	0.27
53	600795	国电电力	149,900	539,640.00	0.27
54	601939	建设银行	85,300	524,595.00	0.27
55	601901	方正证券	52,200	518,346.00	0.26
56	601009	南京银行	46,200	517,902.00	0.26
57	000423	东阿阿胶	7,200	517,608.00	0.26
58	002142	宁波银行	26,500	511,450.00	0.26
59	002230	科大讯飞	12,800	510,720.00	0.26

60	600340	华夏幸福	15,092	506,789.36	0.26
61	600999	招商证券	29,000	499,380.00	0.25
62	600309	万华化学	17,280	494,899.20	0.25
63	600089	特变电工	47,662	492,348.46	0.25
64	600741	华域汽车	20,000	484,800.00	0.25
65	601899	紫金矿业	140,500	481,915.00	0.25
66	000568	泸州老窖	9,501	480,560.58	0.24
67	002241	歌尔股份	24,902	480,110.56	0.24
68	300070	碧水源	25,532	476,171.80	0.24
69	601857	中国石油	61,701	474,480.69	0.24
70	002456	欧菲光	25,750	467,877.50	0.24
71	600660	福耀玻璃	17,800	463,512.00	0.24
72	601985	中国核电	59,300	463,133.00	0.24
73	601669	中国电建	58,300	461,736.00	0.23
74	000166	申万宏源	81,720	457,632.00	0.23
75	600009	上海机场	12,201	455,219.31	0.23
76	300072	三聚环保	12,122	449,120.10	0.23
77	000069	华侨城 A	44,600	448,676.00	0.23
78	002236	大华股份	19,650	448,216.50	0.23
79	002736	国信证券	33,400	442,550.00	0.23
80	601377	兴业证券	59,540	442,382.20	0.23
81	002466	天齐锂业	8,080	439,148.00	0.22
82	000338	潍柴动力	32,900	434,280.00	0.22
83	000783	长江证券	45,100	427,097.00	0.22
84	601607	上海医药	14,600	421,648.00	0.21
85	300059	东方财富	34,928	419,834.56	0.21
86	600886	国投电力	51,700	408,430.00	0.21
87	002008	大族激光	11,700	405,288.00	0.21
88	300136	信维通信	9,900	396,198.00	0.20
89	600031	三一重工	48,600	395,118.00	0.20

90	600068	葛洲坝	35,100	394,524.00	0.20
91	600196	复星医药	12,700	393,573.00	0.20
92	600029	南方航空	44,600	388,020.00	0.20
93	000625	长安汽车	26,502	382,158.84	0.19
94	600010	包钢股份	173,680	380,359.20	0.19
95	601600	中国铝业	83,500	377,420.00	0.19
96	601888	中国国旅	12,400	373,736.00	0.19
97	000839	中信国安	37,250	372,127.50	0.19
98	601788	光大证券	24,800	370,264.00	0.19
99	002594	比亚迪	7,400	369,630.00	0.19
100	600066	宇通客车	16,790	368,876.30	0.19
101	300104	乐视网	12,701	363,756.64	0.19
102	600606	绿地控股	46,300	362,066.00	0.18
103	600637	东方明珠	16,700	361,889.00	0.18
104	601099	太平洋	86,585	348,071.70	0.18
105	000768	中航飞机	18,800	346,672.00	0.18
106	601933	永辉超市	48,600	344,088.00	0.18
107	300124	汇川技术	13,400	342,236.00	0.17
108	601555	东吴证券	30,400	341,392.00	0.17
109	601618	中国中冶	68,000	340,680.00	0.17
110	600535	天士力	8,200	340,628.00	0.17
111	000100	TCL 集团	97,600	339,648.00	0.17
112	002475	立讯精密	11,601	339,213.24	0.17
113	002673	西部证券	23,786	338,236.92	0.17
114	600893	航发动力	12,300	335,790.00	0.17
115	600100	同方股份	23,300	334,821.00	0.17
116	000656	金科股份	51,101	334,200.54	0.17
117	000413	东旭光电	29,700	333,234.00	0.17
118	002202	金风科技	21,302	329,541.94	0.17
119	002460	赣锋锂业	7,101	328,421.25	0.17



120	000963	华东医药	6,604	328,218.80	0.17
121	600383	金地集团	28,600	328,042.00	0.17
122	600522	中天科技	27,200	327,760.00	0.17
123	600406	国电南瑞	18,500	326,525.00	0.17
124	600705	中航资本	57,000	322,050.00	0.16
125	002739	万达电影	6,300	321,111.00	0.16
126	000895	双汇发展	13,501	320,648.75	0.16
127	600816	安信信托	23,230	315,695.70	0.16
128	600109	国金证券	26,900	315,268.00	0.16
129	600111	北方稀土	27,600	312,708.00	0.16
130	002572	索菲亚	7,600	311,600.00	0.16
131	601800	中国交建	19,500	309,855.00	0.16
132	600487	亨通光电	11,001	308,578.05	0.16
133	601727	上海电气	40,200	304,314.00	0.15
134	000728	国元证券	24,000	293,280.00	0.15
135	600271	航天信息	14,176	292,592.64	0.15
136	000623	吉林敖东	12,700	290,703.00	0.15
137	300024	机器人	14,780	288,210.00	0.15
138	601018	宁波港	50,200	283,630.00	0.14
139	600023	浙能电力	51,800	282,828.00	0.14
140	002508	老板电器	6,470	281,315.60	0.14
141	600739	辽宁成大	15,500	279,465.00	0.14
142	002065	东华软件	12,800	278,912.00	0.14
143	000793	华闻传媒	27,400	277,288.00	0.14
144	600177	雅戈尔	27,280	276,073.60	0.14
145	600352	浙江龙盛	28,900	275,417.00	0.14
146	600547	山东黄金	9,500	274,835.00	0.14
147	002007	华兰生物	7,520	274,480.00	0.14
148	600674	川投能源	27,900	273,978.00	0.14
149	600201	生物股份	7,701	273,924.57	0.14

150	601992	金隅股份	42,300	273,681.00	0.14
151	002271	东方雨虹	7,300	270,830.00	0.14
152	601225	陕西煤业	38,100	269,367.00	0.14
153	600221	海航控股	83,500	268,870.00	0.14
154	300156	神雾环保	8,200	268,632.00	0.14
155	000157	中联重科	59,800	268,502.00	0.14
156	000540	中天金融	38,400	266,880.00	0.14
157	002044	美年健康	15,400	261,800.00	0.13
158	002252	上海莱士	12,920	261,500.80	0.13
159	600018	上港集团	41,200	261,208.00	0.13
160	601919	中远海控	48,700	260,545.00	0.13
161	601012	隆基股份	15,200	259,920.00	0.13
162	600804	鹏博士	14,300	253,825.00	0.13
163	600115	东方航空	37,300	253,640.00	0.13
164	002465	海格通信	23,300	250,242.00	0.13
165	600415	小商品城	34,500	249,780.00	0.13
166	603993	洛阳钼业	49,300	249,458.00	0.13
167	000503	海虹控股	10,000	249,300.00	0.13
168	600153	建发股份	19,200	248,256.00	0.13
169	601111	中国国航	25,300	246,675.00	0.13
170	600208	新潮中宝	54,700	246,150.00	0.13
171	601998	中信银行	38,900	244,681.00	0.12
172	600176	中国巨石	22,238	244,173.24	0.12
173	002310	东方园林	14,600	244,112.00	0.12
174	000630	铜陵有色	85,800	243,672.00	0.12
175	601198	东兴证券	14,100	243,084.00	0.12
176	000826	启迪桑德	6,900	242,328.00	0.12
177	000709	河钢股份	57,700	241,763.00	0.12
178	600820	隧道股份	23,901	241,400.10	0.12
179	600085	同仁堂	6,900	241,224.00	0.12

180	002405	四维图新	12,200	241,072.00	0.12
181	600219	南山铝业	70,450	238,825.50	0.12
182	002081	金螳螂	21,650	237,717.00	0.12
183	000009	中国宝安	29,250	236,632.50	0.12
184	300017	网宿科技	19,572	236,234.04	0.12
185	000060	中金岭南	21,000	235,200.00	0.12
186	000876	新希望	28,601	235,100.22	0.12
187	000661	长春高新	1,800	232,398.00	0.12
188	600436	片仔癀	3,800	231,952.00	0.12
189	600525	长园集团	16,641	226,151.19	0.12
190	600157	永泰能源	63,100	225,267.00	0.11
191	603799	华友钴业	3,700	224,886.00	0.11
192	600079	人福医药	11,402	223,707.24	0.11
193	002092	中泰化学	17,500	222,250.00	0.11
194	600643	爱建集团	14,800	221,704.00	0.11
195	600362	江西铜业	13,100	220,866.00	0.11
196	600315	上海家化	6,800	220,660.00	0.11
197	000750	国海证券	40,050	220,275.00	0.11
198	600489	中金黄金	21,898	219,636.94	0.11
199	002340	格林美	36,250	219,312.50	0.11
200	600663	陆家嘴	9,240	218,433.60	0.11
201	000050	深天马A	10,600	218,042.00	0.11
202	600642	申能股份	34,600	217,980.00	0.11
203	600061	国投安信	14,000	217,700.00	0.11
204	002146	荣盛发展	22,000	217,140.00	0.11
205	000066	中国长城	24,037	216,573.37	0.11
206	300115	长盈精密	7,421	216,544.78	0.11
207	600170	上海建工	56,483	215,765.06	0.11
208	000425	徐工机械	57,100	214,125.00	0.11
209	002027	分众传媒	15,500	213,280.00	0.11

210	601229	上海银行	8,300	211,982.00	0.11
211	601155	新城控股	11,402	211,393.08	0.11
212	000998	隆平高科	9,501	209,212.02	0.11
213	600118	中国卫星	7,501	208,827.84	0.11
214	600584	长电科技	13,000	208,650.00	0.11
215	002074	国轩高科	6,600	208,230.00	0.11
216	300296	利亚德	11,000	206,800.00	0.11
217	600332	白云山	7,100	206,184.00	0.10
218	002500	山西证券	21,500	205,970.00	0.10
219	600297	广汇汽车	27,170	204,590.10	0.10
220	600959	江苏有线	19,320	204,212.40	0.10
221	601633	长城汽车	15,304	203,390.16	0.10
222	600682	南京新百	5,501	202,986.90	0.10
223	300266	兴源环境	6,600	202,752.00	0.10
224	000997	新大陆	8,900	201,941.00	0.10
225	600008	首创股份	30,600	201,348.00	0.10
226	600369	西南证券	35,800	200,838.00	0.10
227	300315	掌趣科技	24,600	200,736.00	0.10
228	600150	中国船舶	8,703	199,037.61	0.10
229	000559	万向钱潮	18,680	198,381.60	0.10
230	601333	广深铁路	43,000	194,360.00	0.10
231	300144	宋城演艺	9,282	193,715.34	0.10
232	002422	科伦药业	11,702	193,317.04	0.10
233	000686	东北证券	19,080	191,754.00	0.10
234	000786	北新建材	12,100	191,664.00	0.10
235	000402	金融街	16,200	189,864.00	0.10
236	000983	西山煤电	21,300	186,801.00	0.10
237	600516	方大炭素	13,101	186,296.22	0.09
238	601168	西部矿业	24,200	186,098.00	0.09
239	002050	三花智控	11,400	186,048.00	0.09

240	000792	盐湖股份	17,750	185,487.50	0.09
241	000039	中集集团	10,200	183,906.00	0.09
242	600688	上海石化	27,800	183,758.00	0.09
243	300027	华谊兄弟	22,699	183,634.91	0.09
244	600718	东软集团	11,800	183,490.00	0.09
245	600291	西水股份	8,300	182,600.00	0.09
246	600879	航天电子	20,700	181,953.00	0.09
247	000778	新兴铸管	27,100	181,570.00	0.09
248	300033	同花顺	2,901	180,471.21	0.09
249	600325	华发股份	21,440	179,024.00	0.09
250	002195	二三四五	24,950	178,392.50	0.09
251	000581	威孚高科	6,800	176,120.00	0.09
252	002385	大北农	27,900	175,491.00	0.09
253	601117	中国化学	25,100	175,449.00	0.09
254	600583	海油工程	28,000	174,720.00	0.09
255	000917	电广传媒	15,400	174,020.00	0.09
256	600056	中国医药	6,700	173,865.00	0.09
257	002407	多氟多	7,900	173,721.00	0.09
258	002183	怡亚通	20,100	173,463.00	0.09
259	600266	北京城建	11,900	173,026.00	0.09
260	600022	山东钢铁	83,360	171,721.60	0.09
261	000999	华润三九	5,400	171,450.00	0.09
262	002410	广联达	9,100	171,080.00	0.09
263	000970	中科三环	11,500	169,970.00	0.09
264	600839	四川长虹	46,900	169,778.00	0.09
265	000415	渤海金控	25,200	169,596.00	0.09
266	600426	华鲁恒升	14,405	169,114.70	0.09
267	600649	城投控股	16,061	168,801.11	0.09
268	600166	福田汽车	59,300	168,412.00	0.09
269	002411	必康股份	5,800	167,736.00	0.09

270	600388	龙净环保	10,800	167,724.00	0.09
271	600498	烽火通信	6,602	167,360.70	0.09
272	002179	中航光电	5,360	167,178.40	0.09
273	600521	华海药业	7,920	166,636.80	0.08
274	600895	张江高科	9,800	165,424.00	0.08
275	600256	广汇能源	39,800	164,772.00	0.08
276	600373	中文传媒	7,000	164,570.00	0.08
277	002366	台海核电	3,500	164,185.00	0.08
278	600161	天坛生物	4,230	164,166.30	0.08
279	600827	百联股份	10,100	164,125.00	0.08
280	002573	清新环境	8,700	163,734.00	0.08
281	002223	鱼跃医疗	6,850	162,208.00	0.08
282	000028	国药一致	2,001	161,880.90	0.08
283	600435	北方导航	11,301	161,717.31	0.08
284	002470	金正大	21,300	160,389.00	0.08
285	002038	双鹭药业	5,500	160,325.00	0.08
286	600528	中铁工业	11,209	160,176.61	0.08
287	600588	用友网络	9,300	159,216.00	0.08
288	600704	物产中大	21,825	159,104.25	0.08
289	600074	保千里	12,300	157,563.00	0.08
290	002311	海大集团	8,600	157,122.00	0.08
291	000488	晨鸣纸业	12,103	156,128.70	0.08
292	002217	合力泰	15,800	156,104.00	0.08
293	000008	神州高铁	21,400	155,792.00	0.08
294	300002	神州泰岳	18,600	155,124.00	0.08
295	600600	青岛啤酒	4,400	154,440.00	0.08
296	600699	均胜电子	4,806	154,224.54	0.08
297	600138	中青旅	7,300	153,738.00	0.08
298	000878	云南铜业	11,500	151,685.00	0.08
299	002030	达安基因	6,941	151,244.39	0.08

300	002004	华邦健康	19,300	151,119.00	0.08
301	300055	万邦达	8,201	150,898.40	0.08
302	600978	宜华生活	15,000	150,750.00	0.08
303	601000	唐山港	28,860	150,649.20	0.08
304	300113	顺网科技	5,600	150,640.00	0.08
305	600919	江苏银行	16,200	150,498.00	0.08
306	000959	首钢股份	21,500	150,285.00	0.08
307	600060	海信电器	9,900	150,183.00	0.08
308	600376	首开股份	13,100	149,864.00	0.08
309	600614	鹏起科技	13,600	149,600.00	0.08
310	002174	游族网络	4,700	149,272.00	0.08
311	300383	光环新网	11,000	149,160.00	0.08
312	002602	世纪华通	4,101	148,702.26	0.08
313	601718	际华集团	16,901	148,559.79	0.08
314	002273	水晶光电	7,200	148,536.00	0.08
315	603589	口子窖	3,801	147,440.79	0.08
316	000400	许继电气	8,200	147,272.00	0.07
317	600260	凯乐科技	5,800	146,972.00	0.07
318	002001	新 和 成	7,500	145,575.00	0.07
319	600158	中体产业	8,500	145,350.00	0.07
320	601866	中远海发	40,300	145,080.00	0.07
321	002384	东山精密	5,800	143,260.00	0.07
322	000566	海南海药	10,800	143,208.00	0.07
323	601872	招商轮船	27,700	142,932.00	0.07
324	002558	巨人网络	3,080	142,357.60	0.07
325	300324	旋极信息	7,801	142,290.24	0.07
326	002078	太阳纸业	19,300	141,855.00	0.07
327	002583	海能达	8,800	141,592.00	0.07
328	600511	国药股份	3,901	141,372.24	0.07
329	000930	中粮生化	13,100	141,218.00	0.07

330	000547	航天发展	13,501	141,085.45	0.07
331	300244	迪安诊断	4,480	140,940.80	0.07
332	000418	小天鹅 A	3,000	140,370.00	0.07
333	000977	浪潮信息	8,100	140,292.00	0.07
334	600503	华丽家族	20,300	140,273.00	0.07
335	000401	冀东水泥	9,100	140,049.00	0.07
336	000627	天茂集团	17,300	139,784.00	0.07
337	600909	华安证券	13,800	139,242.00	0.07
338	002019	亿帆医药	8,301	138,460.68	0.07
339	002352	顺丰控股	2,600	138,216.00	0.07
340	002439	启明星辰	7,400	137,640.00	0.07
341	601997	贵阳银行	8,700	137,547.00	0.07
342	600038	中直股份	3,001	137,355.77	0.07
343	002013	中航机电	13,275	137,130.75	0.07
344	002152	广电运通	16,500	137,115.00	0.07
345	002491	通鼎互联	10,200	137,088.00	0.07
346	000598	兴蓉环境	24,300	136,566.00	0.07
347	002244	滨江集团	19,700	136,324.00	0.07
348	000960	锡业股份	10,000	136,100.00	0.07
349	300058	蓝色光标	17,400	136,068.00	0.07
350	300146	汤臣倍健	9,900	136,026.00	0.07
351	603019	中科曙光	4,803	135,156.42	0.07
352	600755	厦门国贸	14,800	134,976.00	0.07
353	000825	太钢不锈	31,000	134,850.00	0.07
354	600298	安琪酵母	5,201	134,549.87	0.07
355	600392	盛和资源	10,200	134,538.00	0.07
356	600808	马钢股份	37,900	134,166.00	0.07
357	300168	万达信息	9,200	133,860.00	0.07
358	300159	新研股份	10,100	133,724.00	0.07
359	600635	大众公用	24,500	133,525.00	0.07



360	002408	齐翔腾达	12,041	133,414.28	0.07
361	002555	三七互娱	5,200	132,964.00	0.07
362	600977	中国电影	7,100	132,912.00	0.07
363	600717	天津港	10,601	132,406.49	0.07
364	600409	三友化工	13,100	131,917.00	0.07
365	600021	上海电力	10,800	130,572.00	0.07
366	600240	华业资本	14,401	130,473.06	0.07
367	000089	深圳机场	13,900	129,965.00	0.07
368	000078	海王生物	21,550	129,946.50	0.07
369	002176	江特电机	14,900	129,928.00	0.07
370	600122	宏图高科	11,700	129,870.00	0.07
371	600633	浙数文化	6,700	129,444.00	0.07
372	000513	丽珠集团	1,900	129,390.00	0.07
373	601231	环旭电子	8,200	128,822.00	0.07
374	600160	巨化股份	10,700	128,721.00	0.07
375	600037	歌华有线	8,800	128,128.00	0.07
376	600872	中炬高新	7,000	128,100.00	0.07
377	000671	阳光城	22,000	128,040.00	0.07
378	002714	牧原股份	4,701	127,961.22	0.07
379	600418	江淮汽车	12,000	126,600.00	0.06
380	600500	中化国际	13,205	126,239.80	0.06
381	600062	华润双鹤	4,600	126,178.00	0.06
382	002601	龙鳞佰利	7,700	126,126.00	0.06
383	600143	金发科技	20,700	124,821.00	0.06
384	300122	智飞生物	6,500	124,215.00	0.06
385	000988	华工科技	8,501	124,029.59	0.06
386	002400	省广股份	15,414	123,774.42	0.06
387	002051	中工国际	5,968	123,716.64	0.06
388	000738	航发控制	6,300	123,291.00	0.06
389	002640	跨境通	5,800	123,250.00	0.06

390	002431	棕榈股份	11,150	122,873.00	0.06
391	000697	炼石有色	6,000	122,820.00	0.06
392	600737	中粮糖业	13,002	122,738.88	0.06
393	002701	奥瑞金	19,200	122,688.00	0.06
394	000685	中山公用	11,200	122,640.00	0.06
395	000938	紫光股份	2,000	122,240.00	0.06
396	600594	益佰制药	8,000	122,080.00	0.06
397	002354	天神娱乐	5,623	120,894.50	0.06
398	000729	燕京啤酒	17,900	120,288.00	0.06
399	000600	建投能源	9,800	120,246.00	0.06
400	000806	银河生物	8,900	120,150.00	0.06
401	002221	东华能源	11,000	120,010.00	0.06
402	002292	奥飞娱乐	7,100	119,990.00	0.06
403	000979	中弘股份	45,600	119,472.00	0.06
404	002048	宁波华翔	5,700	118,902.00	0.06
405	601699	潞安环能	15,200	118,864.00	0.06
406	300253	卫宁健康	15,138	118,227.78	0.06
407	600312	平高电气	8,600	118,164.00	0.06
408	600372	中航电子	6,800	118,116.00	0.06
409	600811	东方集团	18,100	118,012.00	0.06
410	002127	南极电商	9,700	117,176.00	0.06
411	000926	福星股份	9,603	117,156.60	0.06
412	002131	利欧股份	35,600	117,124.00	0.06
413	600884	杉杉股份	7,102	116,969.94	0.06
414	601880	大连港	39,270	116,239.20	0.06
415	002191	劲嘉股份	12,400	116,064.00	0.06
416	600549	厦门钨业	5,400	116,046.00	0.06
417	002665	首航节能	16,110	115,992.00	0.06
418	600967	内蒙一机	8,500	115,855.00	0.06
419	002028	思源电气	7,260	115,724.40	0.06

420	000012	南玻A	12,400	115,692.00	0.06
421	600970	中材国际	13,300	115,577.00	0.06
422	000690	宝新能源	19,300	115,414.00	0.06
423	300026	红日药业	24,500	115,395.00	0.06
424	002603	以岭药业	6,602	115,270.92	0.06
425	000667	美好置业	34,800	115,188.00	0.06
426	000156	华数传媒	7,700	114,807.00	0.06
427	600026	中远海能	17,300	114,699.00	0.06
428	000816	智慧农业	15,400	114,576.00	0.06
429	002373	千方科技	8,400	114,576.00	0.06
430	600566	济川药业	3,000	114,090.00	0.06
431	002444	巨星科技	7,301	113,749.58	0.06
432	600499	科达洁能	14,300	113,542.00	0.06
433	600183	生益科技	9,200	113,528.00	0.06
434	600307	酒钢宏兴	39,700	113,145.00	0.06
435	601118	海南橡胶	19,900	113,032.00	0.06
436	600120	浙江东方	4,200	112,896.00	0.06
437	000006	深振业A	12,800	112,768.00	0.06
438	000718	苏宁环球	19,200	112,512.00	0.06
439	600664	哈药股份	19,341	112,371.21	0.06
440	002390	信邦制药	12,900	112,359.00	0.06
441	002635	安洁科技	3,100	112,282.00	0.06
442	600685	中船防务	4,100	112,258.00	0.06
443	000758	中色股份	16,000	112,160.00	0.06
444	600881	亚泰集团	22,000	111,760.00	0.06
445	002512	达华智能	6,901	111,451.15	0.06
446	600482	中国动力	4,401	111,301.29	0.06
447	000975	银泰资源	8,802	111,169.26	0.06
448	600809	山西汾酒	3,201	111,042.69	0.06
449	600863	内蒙华电	36,800	110,768.00	0.06

450	600446	金证股份	6,300	110,754.00	0.06
451	000031	中粮地产	14,700	110,691.00	0.06
452	600094	大名城	14,400	110,448.00	0.06
453	600787	中储股份	13,900	109,949.00	0.06
454	002672	东江环保	6,500	109,785.00	0.06
455	600572	康恩贝	15,850	109,682.00	0.06
456	000158	常山股份	6,900	109,020.00	0.06
457	000939	凯迪生态	21,300	108,630.00	0.06
458	601877	正泰电器	5,400	108,486.00	0.06
459	000027	深圳能源	16,100	108,353.00	0.06
460	000592	平潭发展	19,601	108,197.52	0.06
461	000860	顺鑫农业	5,400	108,054.00	0.05
462	600874	创业环保	5,502	107,674.14	0.05
463	002424	贵州百灵	5,700	107,502.00	0.05
464	300166	东方国信	8,000	107,440.00	0.05
465	300001	特锐德	6,400	107,264.00	0.05
466	002250	联化科技	7,500	107,250.00	0.05
467	000877	天山股份	8,400	106,428.00	0.05
468	600478	科力远	12,351	106,342.11	0.05
469	300274	阳光电源	9,540	105,798.60	0.05
470	600017	日照港	23,500	105,750.00	0.05
471	300133	华策影视	9,440	105,728.00	0.05
472	002477	雏鹰农牧	23,800	105,434.00	0.05
473	002261	拓维信息	9,000	105,390.00	0.05
474	000732	泰禾集团	6,300	105,084.00	0.05
475	000727	华东科技	36,900	104,427.00	0.05
476	600125	铁龙物流	11,600	103,936.00	0.05
477	603077	和邦生物	20,300	103,327.00	0.05
478	600348	阳泉煤业	15,200	103,056.00	0.05
479	002002	鸿达兴业	13,156	103,011.48	0.05

480	002353	杰瑞股份	6,500	102,830.00	0.05
481	600064	南京高科	6,800	102,680.00	0.05
482	600565	迪马股份	18,502	101,946.02	0.05
483	000563	陕国投 A	19,700	101,849.00	0.05
484	601375	中原证券	10,100	101,606.00	0.05
485	601021	春秋航空	3,000	100,890.00	0.05
486	300287	飞利信	10,902	100,080.36	0.05
487	600198	大唐电信	7,800	99,606.00	0.05
488	600597	光明乳业	7,800	99,450.00	0.05
489	600410	华胜天成	11,200	99,232.00	0.05
490	300116	坚瑞沃能	9,200	98,900.00	0.05
491	600416	湘电股份	7,200	98,640.00	0.05
492	000712	锦龙股份	6,000	98,220.00	0.05
493	000961	中南建设	15,050	98,126.00	0.05
494	002266	浙富控股	20,100	98,088.00	0.05
495	002308	威创股份	7,500	97,875.00	0.05
496	002153	石基信息	4,300	97,739.00	0.05
497	300251	光线传媒	11,900	97,461.00	0.05
498	603766	隆鑫通用	13,353	97,209.84	0.05
499	002375	亚厦股份	10,900	97,119.00	0.05
500	300257	开山股份	4,600	96,968.00	0.05
501	600687	刚泰控股	7,500	96,600.00	0.05
502	000830	鲁西化工	14,000	96,600.00	0.05
503	002468	申通快递	3,800	96,558.00	0.05
504	600582	天地科技	21,000	96,390.00	0.05
505	600200	江苏吴中	7,300	96,360.00	0.05
506	000519	中兵红箭	7,633	96,175.80	0.05
507	601881	中国银河	8,100	96,066.00	0.05
508	000501	鄂武商 A	5,190	95,807.40	0.05
509	002544	杰赛科技	4,201	95,782.80	0.05

510	600039	四川路桥	23,000	95,680.00	0.05
511	002022	科华生物	5,500	95,535.00	0.05
512	601929	吉视传媒	27,600	95,496.00	0.05
513	300199	翰宇药业	6,200	95,108.00	0.05
514	002517	恺英网络	2,700	95,013.00	0.05
515	002440	闰土股份	6,200	94,612.00	0.05
516	002268	卫士通	5,620	94,528.40	0.05
517	600086	东方金钰	8,700	94,047.00	0.05
518	000703	恒逸石化	6,600	93,984.00	0.05
519	002155	湖南黄金	9,802	93,805.14	0.05
520	002489	浙江永强	14,700	93,786.00	0.05
521	601928	凤凰传媒	9,600	93,696.00	0.05
522	002281	光迅科技	4,201	93,346.22	0.05
523	600466	蓝光发展	10,800	93,204.00	0.05
524	600282	南钢股份	25,100	93,121.00	0.05
525	002589	瑞康医药	6,040	93,016.00	0.05
526	600751	天海投资	16,300	92,747.00	0.05
527	000528	柳工	10,700	92,448.00	0.05
528	603000	人民网	7,000	92,190.00	0.05
529	002342	巨力索具	9,100	91,637.00	0.05
530	000612	焦作万方	11,300	90,965.00	0.05
531	002396	星网锐捷	4,700	90,945.00	0.05
532	600380	健康元	10,000	90,800.00	0.05
533	600557	康缘药业	5,460	90,690.60	0.05
534	002709	天赐材料	2,200	90,574.00	0.05
535	601689	拓普集团	2,701	90,456.49	0.05
536	601717	郑煤机	11,600	90,364.00	0.05
537	002670	国盛金控	5,680	90,312.00	0.05
538	000090	天健集团	8,120	90,132.00	0.05
539	300273	和佳股份	7,400	89,984.00	0.05

540	600151	航天机电	10,900	89,707.00	0.05
541	002503	搜于特	12,720	89,421.60	0.05
542	002299	圣农发展	6,000	89,220.00	0.05
543	002285	世联行	11,060	88,701.20	0.05
544	000049	德赛电池	1,701	88,128.81	0.04
545	000937	冀中能源	14,400	88,128.00	0.04
546	600169	太原重工	22,800	88,008.00	0.04
547	601958	金钼股份	12,200	87,474.00	0.04
548	600759	洲际油气	14,400	87,264.00	0.04
549	600611	大众交通	15,800	87,216.00	0.04
550	600270	外运发展	4,601	87,096.93	0.04
551	600648	外高桥	4,700	87,044.00	0.04
552	002657	中科金财	3,000	86,970.00	0.04
553	002358	森源电气	5,100	86,802.00	0.04
554	600316	洪都航空	5,400	86,778.00	0.04
555	002437	誉衡药业	11,900	86,632.00	0.04
556	600366	宁波韵升	4,901	86,453.64	0.04
557	000810	创维数字	7,100	86,123.00	0.04
558	002368	太极股份	3,100	85,839.00	0.04
559	000021	深科技	10,000	85,800.00	0.04
560	600694	大商股份	2,200	85,734.00	0.04
561	600645	中源协和	4,000	85,720.00	0.04
562	002325	洪涛股份	11,720	85,556.00	0.04
563	000829	天音控股	7,900	85,320.00	0.04
564	600267	海正药业	7,300	85,264.00	0.04
565	000543	皖能电力	14,580	85,001.40	0.04
566	000587	金洲慈航	5,700	84,930.00	0.04
567	600108	亚盛集团	19,700	84,907.00	0.04
568	600187	国中水务	16,800	84,840.00	0.04
569	600835	上海机电	4,000	84,560.00	0.04

570	300376	易事特	9,300	84,351.00	0.04
571	002018	华信国际	12,300	84,255.00	0.04
572	600233	圆通速递	4,300	84,237.00	0.04
573	601163	三角轮胎	3,200	84,160.00	0.04
574	600563	法拉电子	1,701	84,046.41	0.04
575	002011	盾安环境	7,400	83,990.00	0.04
576	601678	滨化股份	12,000	83,400.00	0.04
577	000669	金鸿能源	4,600	83,398.00	0.04
578	000061	农产品	9,200	83,352.00	0.04
579	002056	横店东磁	11,100	83,250.00	0.04
580	600993	马应龙	3,800	82,764.00	0.04
581	002122	天马股份	8,002	82,420.60	0.04
582	000897	津滨发展	17,500	82,250.00	0.04
583	600848	上海临港	3,803	81,992.68	0.04
584	002317	众生药业	6,600	81,972.00	0.04
585	000777	中核科技	4,101	81,855.96	0.04
586	600098	广州发展	10,300	81,473.00	0.04
587	600765	中航重机	5,901	81,315.78	0.04
588	000572	海马汽车	15,600	80,652.00	0.04
589	002242	九阳股份	4,100	80,647.00	0.04
590	600729	重庆百货	3,000	80,520.00	0.04
591	600422	昆药集团	7,100	80,514.00	0.04
592	600545	新疆城建	6,702	80,155.92	0.04
593	000766	通化金马	5,000	79,900.00	0.04
594	000062	深圳华强	3,000	79,590.00	0.04
595	000762	西藏矿业	5,600	79,352.00	0.04
596	600073	上海梅林	8,300	79,265.00	0.04
597	000848	承德露露	7,920	79,041.60	0.04
598	600300	维维股份	14,800	79,032.00	0.04
599	601611	中国核建	6,600	79,002.00	0.04



600	002249	大洋电机	12,000	78,960.00	0.04
601	600639	浦东金桥	4,300	77,916.00	0.04
602	002276	万马股份	7,700	77,693.00	0.04
603	601016	节能风电	21,100	77,648.00	0.04
604	002479	富春环保	6,492	77,254.80	0.04
605	002254	泰和新材	5,800	77,140.00	0.04
606	002106	莱宝高科	7,600	76,988.00	0.04
607	600926	杭州银行	5,160	76,626.00	0.04
608	000636	风华高科	9,000	76,590.00	0.04
609	600871	石化油服	22,900	76,486.00	0.04
610	000596	古井贡酒	1,501	76,475.95	0.04
611	600750	江中药业	2,200	76,450.00	0.04
612	300010	立思辰	5,900	76,405.00	0.04
613	002482	广田集团	8,400	75,516.00	0.04
614	002073	软控股份	8,900	75,472.00	0.04
615	601311	骆驼股份	5,300	75,048.00	0.04
616	600284	浦东建设	7,000	75,040.00	0.04
617	603188	亚邦股份	4,300	74,992.00	0.04
618	002707	众信旅游	5,701	74,854.13	0.04
619	601608	中信重工	13,500	74,790.00	0.04
620	600587	新华医疗	4,200	74,676.00	0.04
621	600651	飞乐音响	8,804	74,569.88	0.04
622	600770	综艺股份	9,900	74,250.00	0.04
623	600259	广晟有色	1,901	74,215.04	0.04
624	000652	泰达股份	14,001	74,205.30	0.04
625	601966	玲珑轮胎	3,300	74,019.00	0.04
626	600496	精工钢构	15,300	73,899.00	0.04
627	000620	新华联	10,300	73,233.00	0.04
628	000680	山推股份	13,400	73,030.00	0.04
629	000726	鲁泰A	6,100	72,346.00	0.04

630	002463	沪电股份	15,900	72,345.00	0.04
631	600216	浙江医药	7,300	72,343.00	0.04
632	002123	梦网荣信	6,500	72,215.00	0.04
633	000541	佛山照明	7,900	71,969.00	0.04
634	002064	华峰氨纶	14,900	71,818.00	0.04
635	002690	美亚光电	3,700	70,966.00	0.04
636	600536	中国软件	3,700	70,892.00	0.04
637	002428	云南锗业	6,600	70,488.00	0.04
638	001696	宗申动力	9,300	70,401.00	0.04
639	600458	时代新材	6,100	69,845.00	0.04
640	000426	兴业矿业	7,700	69,454.00	0.04
641	002332	仙琚制药	8,050	69,230.00	0.04
642	600171	上海贝岭	6,800	69,156.00	0.04
643	300297	蓝盾股份	6,300	68,985.00	0.04
644	000969	安泰科技	7,800	68,094.00	0.03
645	600428	中远海特	10,900	67,798.00	0.03
646	002063	远光软件	6,500	67,730.00	0.03
647	600058	五矿发展	5,400	67,014.00	0.03
648	000616	海航投资	15,500	66,650.00	0.03
649	000552	靖远煤电	18,600	66,402.00	0.03
650	600517	置信电气	8,700	65,859.00	0.03
651	603556	海兴电力	1,500	65,835.00	0.03
652	600859	王府井	4,060	65,569.00	0.03
653	600329	中新药业	3,600	65,196.00	0.03
654	000555	神州信息	3,900	65,130.00	0.03
655	300043	星辉娱乐	7,900	64,859.00	0.03
656	603816	顾家家居	1,100	64,658.00	0.03
657	002663	普邦股份	11,900	64,617.00	0.03
658	603858	步长制药	900	64,476.00	0.03
659	002727	一心堂	3,500	64,400.00	0.03

660	002190	成飞集成	2,401	64,346.80	0.03
661	600736	苏州高新	9,100	64,337.00	0.03
662	002681	奋达科技	5,101	64,221.59	0.03
663	300291	华录百纳	3,200	64,064.00	0.03
664	600790	轻纺城	9,400	64,014.00	0.03
665	600894	广日股份	5,400	63,936.00	0.03
666	601233	桐昆股份	4,600	63,756.00	0.03
667	300147	香雪制药	6,200	63,674.00	0.03
668	002041	登海种业	4,801	63,613.25	0.03
669	601777	力帆股份	7,902	63,532.08	0.03
670	002269	美邦服饰	17,000	63,410.00	0.03
671	600880	博瑞传播	9,700	63,341.00	0.03
672	603883	老百姓	1,300	63,245.00	0.03
673	600805	悦达投资	8,600	63,210.00	0.03
674	603888	新华网	1,950	63,160.50	0.03
675	300039	上海凯宝	8,680	63,103.60	0.03
676	600586	金晶科技	12,900	63,081.00	0.03
677	002005	德豪润达	13,200	62,964.00	0.03
678	600289	亿阳信通	5,700	62,358.00	0.03
679	600220	江苏阳光	18,100	62,083.00	0.03
680	603369	今世缘	4,700	62,040.00	0.03
681	002345	潮宏基	5,701	61,969.87	0.03
682	002277	友阿股份	9,604	61,945.80	0.03
683	000099	中信海直	5,500	61,930.00	0.03
684	002120	韵达股份	1,200	61,920.00	0.03
685	600395	盘江股份	8,400	61,572.00	0.03
686	300032	金龙机电	4,401	61,393.95	0.03
687	300202	聚龙股份	3,702	61,157.04	0.03
688	600720	祁连山	7,801	61,081.83	0.03
689	000417	合肥百货	7,400	61,050.00	0.03

690	600773	西藏城投	5,500	60,885.00	0.03
691	600338	西藏珠峰	1,600	60,784.00	0.03
692	603160	汇顶科技	600	60,180.00	0.03
693	603377	东方时尚	1,600	60,144.00	0.03
694	000681	视觉中国	3,800	59,508.00	0.03
695	601886	江河集团	5,800	59,450.00	0.03
696	600006	东风汽车	10,100	59,085.00	0.03
697	603355	莱克电气	1,005	59,063.85	0.03
698	002147	新光圆成	3,800	59,052.00	0.03
699	600188	兖州煤业	4,800	58,752.00	0.03
700	002233	塔牌集团	4,800	58,416.00	0.03
701	600596	新安股份	6,900	58,305.00	0.03
702	600801	华新水泥	6,102	58,152.06	0.03
703	600757	长江传媒	7,700	57,519.00	0.03
704	002344	海宁皮城	6,900	57,408.00	0.03
705	002371	北方华创	2,400	57,408.00	0.03
706	600280	中央商场	7,201	57,103.93	0.03
707	603198	迎驾贡酒	3,000	57,090.00	0.03
708	600460	士兰微	9,400	57,058.00	0.03
709	603444	吉比特	200	56,666.00	0.03
710	600628	新世界	4,900	56,595.00	0.03
711	600869	智慧能源	8,402	56,545.46	0.03
712	600059	古越龙山	6,100	56,425.00	0.03
713	600481	双良节能	10,600	56,286.00	0.03
714	002588	史丹利	7,302	56,152.38	0.03
715	600053	九鼎投资	1,600	55,936.00	0.03
716	600141	兴发集团	4,501	55,677.37	0.03
717	600580	卧龙电气	8,100	55,242.00	0.03
718	601001	大同煤业	10,400	54,600.00	0.03
719	600754	锦江股份	2,000	54,200.00	0.03

720	002309	中利集团	4,300	53,793.00	0.03
721	600050	中国联通	7,200	53,784.00	0.03
722	600292	远达环保	4,900	52,822.00	0.03
723	600195	中牧股份	2,702	52,391.78	0.03
724	601002	晋亿实业	6,003	51,925.95	0.03
725	600537	亿晶光电	10,401	51,796.98	0.03
726	600862	中航高科	5,300	51,357.00	0.03
727	600971	恒源煤电	6,300	51,219.00	0.03
728	600640	号百控股	3,001	50,716.90	0.03
729	600748	上实发展	6,990	50,328.00	0.03
730	600996	贵广网络	4,200	50,274.00	0.03
731	600743	华远地产	11,850	50,007.00	0.03
732	002699	美盛文化	3,600	49,680.00	0.03
733	002551	尚荣医疗	3,000	48,390.00	0.02
734	002392	北京利尔	8,100	48,033.00	0.02
735	603169	兰石重装	3,901	47,397.15	0.02
736	002797	第一创业	5,140	47,339.40	0.02
737	002118	紫鑫药业	6,900	47,127.00	0.02
738	600826	兰生股份	2,600	47,060.00	0.02
739	600251	冠农股份	5,900	47,023.00	0.02
740	600184	光电股份	2,500	46,900.00	0.02
741	600335	国机汽车	3,904	46,691.84	0.02
742	002093	国脉科技	5,300	46,640.00	0.02
743	600831	广电网络	4,600	45,770.00	0.02
744	002414	高德红外	2,500	45,750.00	0.02
745	002416	爱施德	4,200	45,318.00	0.02
746	002831	裕同科技	601	45,075.00	0.02
747	002841	视源股份	600	44,532.00	0.02
748	601127	小康股份	2,200	43,890.00	0.02
749	002646	青青稞酒	2,500	43,650.00	0.02

750	000536	华映科技	7,500	43,575.00	0.02
751	002251	步步高	3,500	43,365.00	0.02
752	002839	张家港行	2,700	42,444.00	0.02
753	600776	东方通信	6,000	40,680.00	0.02
754	000517	荣安地产	8,600	39,990.00	0.02
755	600551	时代出版	2,500	39,475.00	0.02
756	603005	晶方科技	1,402	39,241.98	0.02
757	603698	航天工程	1,501	37,825.20	0.02
758	603001	奥康国际	2,000	37,580.00	0.02
759	603868	飞科电器	600	37,104.00	0.02
760	603568	伟明环保	1,700	36,754.00	0.02
761	600936	广西广电	4,500	36,315.00	0.02
762	000025	特力A	700	36,218.00	0.02
763	600126	杭钢股份	5,200	35,672.00	0.02
764	603328	依顿电子	2,502	35,403.30	0.02
765	603567	珍宝岛	2,101	35,359.83	0.02
766	002807	江阴银行	2,800	35,084.00	0.02
767	603528	多伦科技	2,406	34,574.22	0.02
768	603806	福斯特	1,000	32,010.00	0.02
769	601020	华钰矿业	1,400	30,842.00	0.02
770	002315	焦点科技	1,200	29,928.00	0.02
771	600618	氯碱化工	2,801	29,914.68	0.02
772	603228	景旺电子	600	28,950.00	0.01
773	603515	欧普照明	800	28,896.00	0.01
774	603866	桃李面包	800	28,464.00	0.01
775	002194	武汉凡谷	3,000	26,550.00	0.01
776	002815	崇达技术	700	23,128.00	0.01
777	603658	安图生物	500	21,550.00	0.01
778	000761	本钢板材	4,001	20,925.23	0.01
779	601811	新华文轩	1,300	20,228.00	0.01

780	603569	长久物流	600	20,058.00	0.01
781	600917	重庆燃气	2,101	19,812.43	0.01
782	002818	富森美	500	19,735.00	0.01
783	603877	太平鸟	700	19,593.00	0.01
784	600570	恒生电子	400	18,672.00	0.01
785	603025	大豪科技	601	15,866.40	0.01
786	600485	信威集团	900	13,131.00	0.01
787	600673	东阳光科	1,500	10,935.00	0.01
788	300088	长信科技	600	9,450.00	0.00
789	002049	紫光国芯	300	9,246.00	0.00
790	002426	胜利精密	1,200	9,216.00	0.00
791	600655	豫园商城	701	7,935.32	0.00
792	300134	大富科技	300	7,008.00	0.00
793	002642	荣之联	250	6,265.00	0.00
794	600277	亿利洁能	600	4,698.00	0.00
795	002128	露天煤业	500	4,350.00	0.00
796	002505	大康农业	1,240	4,340.00	0.00
797	600657	信达地产	500	2,880.00	0.00

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	600666	奥瑞德	9,600	167,040.00	0.08
2	002399	海普瑞	4,920	99,531.60	0.05
3	603801	志邦股份	1,406	47,522.80	0.02
4	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.02
5	600468	百利电气	4,055	26,357.50	0.01
6	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.01
7	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.01
8	002881	美格智能	989	22,608.54	0.01

9	603679	华体科技	809	21,438.50	0.01
10	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.01
11	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.01
12	603933	睿能科技	857	17,311.40	0.01
13	603305	旭升股份	1,351	15,212.26	0.01
14	300670	大烨智能	1,259	13,760.87	0.01
15	603286	日盈电子	890	13,528.00	0.01
16	300672	国科微	1,257	10,659.36	0.01
17	002168	深圳惠程	600	10,194.00	0.01
18	603331	百达精工	999	9,620.37	0.00
19	600654	*ST中安	700	9,436.00	0.00
20	002129	中环股份	1,000	8,270.00	0.00
21	300671	富满电子	942	7,639.62	0.00
22	603617	君禾股份	832	7,429.76	0.00
23	002025	航天电器	200	4,990.00	0.00
24	000693	*ST华泽	200	2,500.00	0.00

#### 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

##### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	4,949,755.00	47.97
2	601166	兴业银行	2,683,066.00	26.00
3	600519	贵州茅台	2,611,876.00	25.31
4	600016	民生银行	2,592,093.00	25.12
5	600036	招商银行	2,538,883.00	24.61
6	000333	美的集团	2,391,681.00	23.18
7	000651	格力电器	2,385,635.00	23.12
8	601328	交通银行	2,227,056.88	21.58
9	000002	万科A	2,211,991.00	21.44



10	601668	中国建筑	1,989,473.00	19.28
11	600000	浦发银行	1,837,602.00	17.81
12	600030	中信证券	1,691,068.00	16.39
13	601288	农业银行	1,676,715.00	16.25
14	600837	海通证券	1,556,233.00	15.08
15	600887	伊利股份	1,528,803.00	14.82
16	601169	北京银行	1,460,677.26	14.16
17	601398	工商银行	1,374,977.00	13.33
18	601766	中国中车	1,358,232.00	13.16
19	000858	五粮液	1,309,748.00	12.69
20	000001	平安银行	1,230,113.00	11.92
21	000725	京东方A	1,215,948.00	11.78
22	600900	长江电力	1,185,820.00	11.49
23	600104	上汽集团	1,184,440.00	11.48
24	601601	中国太保	1,121,900.00	10.87
25	601211	国泰君安	1,107,453.00	10.73
26	002415	海康威视	1,054,052.00	10.22
27	601988	中国银行	1,008,567.00	9.77
28	600276	恒瑞医药	1,001,729.20	9.71
29	601989	中国重工	936,498.00	9.08
30	601390	中国中铁	922,729.00	8.94
31	600048	保利地产	921,445.43	8.93
32	601186	中国铁建	851,507.00	8.25
33	601818	光大银行	840,787.11	8.15
34	600028	中国石化	817,246.00	7.92
35	600019	宝钢股份	768,925.00	7.45
36	600015	华夏银行	764,405.00	7.41
37	601688	华泰证券	744,824.00	7.22
38	600518	康美药业	742,860.00	7.20
39	002304	洋河股份	704,390.00	6.83

40	001979	招商蛇口	638,985.00	6.19
41	002450	康得新	626,457.00	6.07
42	600958	东方证券	597,072.00	5.79
43	601006	大秦铁路	590,838.00	5.73
44	000538	云南白药	583,813.00	5.66
45	600340	华夏幸福	567,107.00	5.50
46	600585	海螺水泥	548,999.00	5.32
47	000063	中兴通讯	534,885.00	5.18
48	002024	苏宁云商	533,801.00	5.17
49	300070	碧水源	525,387.11	5.09
50	600089	特变电工	524,745.20	5.09
51	601009	南京银行	524,283.00	5.08
52	601628	中国人寿	521,741.00	5.06
53	600795	国电电力	520,078.00	5.04
54	600703	三安光电	515,798.00	5.00
55	601899	紫金矿业	500,447.00	4.85
56	601939	建设银行	500,026.00	4.85
57	000166	申万宏源	499,599.00	4.84
58	601857	中国石油	493,535.00	4.78
59	002736	国信证券	489,896.68	4.75
60	601669	中国电建	485,936.00	4.71
61	300072	三聚环保	482,068.22	4.67
62	601088	中国神华	474,253.00	4.60
63	000768	中航飞机	473,208.57	4.59
64	600999	招商证券	472,575.00	4.58
65	600690	青岛海尔	455,985.00	4.42
66	601377	兴业证券	455,705.00	4.42
67	000423	东阿阿胶	450,084.00	4.36
68	600068	葛洲坝	447,140.00	4.33
69	002142	宁波银行	446,081.00	4.32

70	601985	中国核电	445,445.00	4.32
71	601336	新华保险	444,973.00	4.31
72	000783	长江证券	437,037.00	4.24
73	600893	航发动力	434,815.97	4.21
74	601901	方正证券	428,078.00	4.15
75	600309	万华化学	422,667.00	4.10
76	600009	上海机场	422,249.00	4.09
77	601600	中国铝业	421,997.00	4.09
78	300059	东方财富	414,200.00	4.01
79	002466	天齐锂业	412,837.00	4.00
80	000625	长安汽车	406,175.00	3.94
81	601099	太平洋	404,040.00	3.92
82	002241	歌尔股份	402,784.84	3.90
83	600886	国投电力	402,502.00	3.90
84	000568	泸州老窖	395,365.90	3.83
85	600010	包钢股份	393,675.00	3.82
86	600660	福耀玻璃	393,233.00	3.81
87	002230	科大讯飞	392,987.00	3.81
88	600741	华域汽车	387,879.89	3.76
89	601788	光大证券	381,617.00	3.70
90	000338	潍柴动力	380,776.00	3.69
91	000839	中信国安	376,160.00	3.65
92	002456	欧菲光	376,139.88	3.65
93	600606	绿地控股	374,142.00	3.63
94	600196	复星医药	373,287.00	3.62
95	002594	比亚迪	372,401.00	3.61
96	601618	中国中冶	372,400.00	3.61
97	300104	乐视网	372,326.00	3.61
98	002673	西部证券	370,155.42	3.59
99	600637	东方明珠	369,680.00	3.58

100	601555	东吴证券	369,382.00	3.58
101	600109	国金证券	367,190.00	3.56
102	600029	南方航空	365,433.00	3.54
103	600705	中航资本	360,787.00	3.50
104	600066	宇通客车	360,631.80	3.50
105	601800	中国交建	356,528.00	3.46
106	000069	华侨城A	353,880.00	3.43
107	600111	北方稀土	344,539.00	3.34
108	600031	三一重工	342,875.00	3.32
109	601888	中国国旅	341,453.00	3.31
110	601607	上海医药	340,662.00	3.30
111	000100	TCL 集团	335,256.00	3.25
112	600383	金地集团	335,137.00	3.25
113	601727	上海电气	334,002.00	3.24
114	000728	国元证券	333,094.00	3.23
115	600535	天士力	332,455.00	3.22
116	002202	金风科技	331,087.00	3.21
117	000709	河钢股份	331,074.00	3.21
118	002739	万达电影	330,641.00	3.20
119	000413	东旭光电	329,942.00	3.20
120	600100	同方股份	328,485.00	3.18
121	002236	大华股份	318,094.00	3.08
122	300136	信维通信	317,497.00	3.08
123	600522	中天科技	315,518.00	3.06
124	000503	海虹控股	314,655.00	3.05
125	002460	赣锋锂业	313,894.00	3.04
126	600547	山东黄金	308,486.00	2.99
127	300024	机器人	308,187.00	2.99
128	002008	大族激光	307,453.00	2.98
129	600406	国电南瑞	303,835.00	2.94

130	600271	航天信息	302,342.52	2.93
131	000963	华东医药	300,549.86	2.91
132	600023	浙能电力	298,747.00	2.90
133	000793	华闻传媒	298,448.00	2.89
134	000895	双汇发展	298,262.00	2.89
135	300124	汇川技术	295,722.96	2.87
136	000656	金科股份	294,983.00	2.86
137	601992	金隅股份	290,141.00	2.81
138	601018	宁波港	290,046.00	2.81
139	601919	中远海控	289,455.00	2.81
140	600221	海航控股	289,333.00	2.80
141	600487	亨通光电	288,437.00	2.80
142	000157	中联重科	288,192.00	2.79
143	002475	立讯精密	285,632.00	2.77
144	601933	永辉超市	284,727.00	2.76
145	002146	荣盛发展	280,814.00	2.72
146	600489	中金黄金	280,229.00	2.72
147	000623	吉林敖东	279,800.00	2.71
148	002065	东华软件	276,654.00	2.68
149	600739	辽宁成大	275,411.00	2.67
150	600804	鹏博士	275,184.00	2.67
151	002465	海格通信	272,520.00	2.64
152	600150	中国船舶	271,665.00	2.63
153	300156	神雾环保	271,066.00	2.63
154	600352	浙江龙盛	269,912.00	2.62
155	002007	华兰生物	269,776.00	2.61
156	600177	雅戈尔	269,765.00	2.61
157	000009	中国宝安	269,665.00	2.61
158	600208	新湖中宝	268,236.00	2.60
159	600201	生物股份	267,571.00	2.59

160	600820	隧道股份	266,220.00	2.58
161	000066	中国长城	266,054.00	2.58
162	600115	东方航空	265,650.00	2.57
163	600867	通化东宝	263,780.00	2.56
164	000630	铜陵有色	262,819.00	2.55
165	600816	安信信托	262,417.00	2.54
166	600674	川投能源	261,844.00	2.54
167	002508	老板电器	261,698.00	2.54
168	002310	东方园林	261,182.00	2.53
169	600157	永泰能源	260,239.00	2.52
170	600415	小商品城	260,054.00	2.52
171	002572	索菲亚	258,789.00	2.51
172	600153	建发股份	258,560.78	2.51
173	000540	中天金融	258,165.00	2.50
174	601198	东兴证券	256,132.00	2.48
175	002085	万丰奥威	255,773.00	2.48
176	601998	中信银行	253,671.00	2.46
177	000750	国海证券	251,565.00	2.44
178	600118	中国卫星	250,520.88	2.43
179	000826	启迪桑德	250,456.00	2.43
180	600018	上港集团	249,850.00	2.42
181	600219	南山铝业	248,959.00	2.41
182	600525	长园集团	246,681.00	2.39
183	002252	上海莱士	246,511.00	2.39
184	300017	网宿科技	246,486.00	2.39
185	601012	隆基股份	246,373.00	2.39
186	603993	洛阳钼业	246,143.00	2.39
187	002044	美年健康	245,702.00	2.38
188	601258	庞大集团	243,982.00	2.36
189	600170	上海建工	238,569.00	2.31

190	601225	陕西煤业	238,221.00	2.31
191	002405	四维图新	237,973.00	2.31
192	600008	首创股份	234,970.00	2.28
193	601111	中国国航	234,364.00	2.27
194	600718	东软集团	234,075.62	2.27
195	600079	人福医药	232,513.00	2.25
196	600584	长电科技	231,827.00	2.25
197	601333	广深铁路	231,314.00	2.24
198	002081	金螳螂	231,246.00	2.24
199	000425	徐工机械	229,471.00	2.22
200	600663	陆家嘴	228,438.00	2.21
201	000060	中金岭南	227,617.00	2.21
202	002092	中泰化学	227,121.00	2.20
203	000876	新希望	225,037.00	2.18
204	600649	城投控股	223,063.51	2.16
205	600362	江西铜业	223,058.74	2.16
206	600369	西南证券	222,698.00	2.16
207	002340	格林美	220,704.00	2.14
208	600682	南京新百	220,203.00	2.13
209	600176	中国巨石	220,035.58	2.13
210	000686	东北证券	218,729.00	2.12
211	002500	山西证券	218,374.00	2.12
212	600085	同仁堂	216,273.00	2.10
213	300315	掌趣科技	214,711.00	2.08
214	300115	长盈精密	214,006.00	2.07
215	600642	申能股份	213,768.00	2.07
216	002074	国轩高科	212,716.00	2.06
217	600583	海油工程	212,332.00	2.06
218	002407	多氟多	212,251.00	2.06
219	300296	利亚德	212,193.00	2.06

220	600643	爱建集团	211,876.00	2.05
221	600436	片仔癀	211,587.00	2.05
222	600061	国投安信	210,964.00	2.04
223	000917	电广传媒	210,609.00	2.04
224	000792	盐湖股份	209,388.00	2.03
225	601633	长城汽车	209,175.00	2.03
226	600266	北京城建	208,980.00	2.03
227	300027	华谊兄弟	208,364.15	2.02

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

#### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	000651	格力电器	539,657.00	5.23
2	000333	美的集团	522,756.00	5.07
3	000002	万科A	484,702.00	4.70
4	601166	兴业银行	334,412.00	3.24
5	601318	中国平安	319,346.00	3.10
6	000858	五粮液	303,151.00	2.94
7	600867	通化东宝	264,792.88	2.57
8	600016	民生银行	257,219.00	2.49
9	000001	平安银行	239,523.00	2.32
10	600036	招商银行	238,222.00	2.31
11	002085	万丰奥威	231,685.80	2.25
12	601328	交通银行	219,630.00	2.13
13	600000	浦发银行	216,977.71	2.10
14	600519	贵州茅台	204,192.00	1.98
15	601258	庞大集团	187,523.00	1.82
16	600887	伊利股份	181,412.00	1.76
17	601288	农业银行	179,508.00	1.74



18	601668	中国建筑	178,584.00	1.73
19	300015	爱尔眼科	178,272.50	1.73
20	600030	中信证券	160,832.00	1.56

注：本项“卖出金额”均按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	187,863,413.56
卖出股票收入（成交）总额	18,848,072.86

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

#### 7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

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

本基金本报告期末未持有贵金属。

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

本基金本报告期末未持有权证。

#### 7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

#### 7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

## 7.12 投资组合报告附注

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

7.12.2 基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

### 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	127,616.69
2	应收证券清算款	107,699.36
3	应收股利	—
4	应收利息	2,674.29
5	应收申购款	23,758.35
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	261,748.69

### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

#### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限情况。

#### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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	600666	奥瑞德	167,040.00	0.08	重大资产重组

2	002399	海普瑞	99,531.60	0.05	重大事项
3	600468	百利电气	26,357.50	0.01	重大资产重组

### 7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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	1,050	201,359.53	209,184,05 7.41	98.94%	2,243,445. 22	1.06%
天弘中 证800C	245	76,697.61	17,289,541 .60	92.01%	1,501,371. 85	7.99%
合计	1,295	177,774.84	226,473,59 9.01	98.37%	3,744,817. 07	1.63%

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）。

### 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

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 持有本开放式基金	天弘中证800A	350.98	0.00
	天弘中证800C	—	—
	合计	350.98	0.00

### 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

本基金本报告期末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。

#### 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	4.34%	10,000,000.00	4.34%	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	4.34%	10,000,000.00	4.34%	

#### § 9 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	7,120,937.77	5,874,861.68
本报告期基金总申购份额	205,860,187.16	20,241,325.84
减：本报告期基金总赎回份额	1,553,622.30	7,325,274.07
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	211,427,502.63	18,790,913.45

注：总申购份额含转换转入份额；总赎回份额含转换转出份额。

#### § 10 重大事件揭示

##### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

## 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，熊军先生已任职本公司副总经理职务，具体信息请参见基金管理人于2017年4月26日披露的《天弘基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。

本报告期内，本基金的基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

## 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

## 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略没有改变。

## 10.5 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变化。

## 10.6 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。

## 10.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：

券商名称	交易单元数量	股票交易		债券交易		债券回购交易		权证交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占股票成交总额比例	成交金额	占债券成交总额比例	成交金额	占债券回购成交总额比例	成交金额	占权证成交总额比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
广发证券	2	206,138,378.34	100.00%	—	—	—	—	—	—	47,679.76	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等；

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

- 3、本基金报告期内新租用交易单元：无；  
 4、本基金报告期内停止租用交易单元：无。

### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	信息披露方式	披露日期
1	天弘基金管理有限公司关于增加上海联泰资产管理有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投及转换业务以及参加其申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2017-01-12
2	天弘基金管理有限公司关于增加杭州科地瑞富基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投及转换业务以及参加其申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2017-01-18
3	天弘基金管理有限公司关于增加东海期货有限责任公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投及转换业务以及参加其申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2017-01-18
4	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部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投及转换业务以及参加其申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2017-01-19
5	天弘中证800指数型发起式证券投资基金2016年第4季度报告	中国证监会指定媒介	2017-01-20
6	天弘中证800指数型发起式证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会指定媒介	2017-02-27
7	天弘中证800指数型发起式证券投资基金招募说明书（更新）摘要	中国证监会指定媒介	2017-02-27
8	天弘基金管理有限公司关于变更	中国证监会指定媒介	2017-03-04

	基金直销资金账户的公告		
9	天弘基金管理有限公司关于增加上海朝阳永续基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回及转换业务以及参加其申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2017-03-14
10	天弘基金管理有限公司关于增加泰诚财富基金销售（大连）有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投及转换业务以及参加其申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2017-03-23
11	天弘基金管理有限公司关于增加北京肯特瑞财富投资管理有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投、转换业务以及参加其相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2017-03-29
12	天弘中证800指数型发起式证券投资基金2016年年度报告	中国证监会指定媒介	2017-03-30
13	天弘中证800指数型发起式证券投资基金2016年年度报告摘要	中国证监会指定媒介	2017-03-30
14	天弘基金管理有限公司关于调整天弘中证800指数型发起式证券投资基金基金经理的公告	中国证监会指定媒介	2017-04-17
15	天弘中证800指数型发起式证券投资基金2017年第1季度报告	中国证监会指定媒介	2017-04-22
16	天弘基金管理有限公司广州分公司关于营业场所变更的公告	中国证监会指定媒介	2017-04-25
17	天弘基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会指定媒介	2017-04-26
18	天弘基金管理有限公司关于增加嘉晟瑞信（天津）基金销售有限	中国证监会指定媒介	2017-05-12

	公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投及转换业务以及参加其申购费率优惠活动的公告		
19	天弘基金管理有限公司关于增加宜信普泽投资顾问（北京）有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投及转换业务以及参加其相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2017-05-15
20	天弘基金管理有限公司关于调整网上直销交易系统浦发银行直联渠道申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2017-05-24
21	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暂停大额申购业务的公告	中国证监会指定媒介	2017-05-31
22	天弘基金管理有限公司关于旗下基金参加肯特瑞财富申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2017-06-06
23	天弘基金管理有限公司关于在网上交易系统开通连连支付的第三方支付业务并实施申购费率优惠的公告	中国证监会指定媒介	2017-06-06
24	天弘基金管理有限公司关于旗下基金在网上交易系统开展申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2017-06-12
25	天弘基金管理有限公司旗下基金2017年6月30日基金资产净值公告	中国证监会指定媒介	2017-06-30

## § 11 影响投资者决策的其他重要信息

### 11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资	报告期内持有基金份额变化情况	报告期末持有基金情况
----	----------------	------------



者类别	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	2017/1/1-2017/4/13	10,000,000.00	-	-	10,000,000.00	4.34%
机构	2	2017/4/14-2017/6/30	-	71,863,696.25	-	71,863,696.25	31.22%
机构	3	2017/4/14-2017/6/30	-	47,908,731.58	-	47,908,731.58	20.81%
产品特有风险							
<p>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：</p> <p>(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；</p> <p>(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；</p> <p>(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；</p> <p>(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；</p> <p>(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。</p>							

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

1、中国证监会批准天弘中证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托管协议
- 4、天弘中证800指数型发起式证券投资基金招募说明书
- 5、报告期内在指定报刊上披露的各项公告
- 6、中国证监会规定的其他文件

## 12.2 存放地点

天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层

## 12.3 查阅方式

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

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

天弘基金管理有限公司  
二〇一七年八月二十八日