

天弘中证500指数型发起式证券投资基金2017年年度报告

2017年12月31日

基金管理人：天弘基金管理有限公司

基金托管人：国泰君安证券股份有限公司

送出日期：2018年3月29日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人国泰君安证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2018年3月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

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

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

本报告期自2017年1月1日起至2017年12月31日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§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合规守信情况的说明	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	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	16
§6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
§7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	20
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	22
7.4 报表附注	23
§8 投资组合报告	51
8.1 期末基金资产组合情况	51
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	51
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细	53
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	70
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	72
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	72
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	72
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	72
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	72
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	72
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	73
8.12 本报告期投资基金情况	73
8.13 投资组合报告附注	73
§9 基金份额持有人信息	74

9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	74
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	75
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	75
9.4	发起式基金发起资金持有份额情况	75
§10	开放式基金份额变动	76
§11	重大事件揭示	76
11.1	基金份额持有人大会决议	76
11.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	76
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	76
11.4	基金投资策略的改变	76
11.5	本报告期持有的基金发生的重大影响事件	76
11.6	为基金进行审计的会计师事务所情况	76
11.7	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	77
11.8	基金租用证券公司交易单元的有关情况	77
11.9	其他重大事件	77
§12	影响投资者决策的其他重要信息	82
12.1	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	82
12.2	影响投资者决策的其他重要信息	82
§13	备查文件目录	82
13.1	备查文件目录	82
13.2	存放地点	82
13.3	查阅方式	82

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	天弘中证500指数型发起式证券投资基金
基金简称	天弘中证500
基金主代码	000962
基金运作方式	契约型开放式、发起式
基金合同生效日	2015年1月20日
基金管理人	天弘基金管理有限公司
基金托管人	国泰君安证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	556,594,702.48份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	天弘基金管理有限公司	国泰君安证券股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	童建林	王健
	联系电话	022-83310208	021-38676252
	电子邮箱	service@thfund.com.cn	wangj222@gtjas.com
客户服务电话		95046	95521
传真		022-83865569	021-38677819
注册地址		天津自贸区（中心商务区）响螺湾旷世国际大厦A座 1704-241号	中国（上海）自由贸易试验区 商城路618号
办公地址		天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层	上海市浦东新区银城中路68号32层
邮政编码		300203	200120
法定代表人		井贤栋	杨德红

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	中国上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
注册登记机构	天弘基金管理有限公司	天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2017年	2016年	2015年1月20日 -2015年12月31日
本期已实现收益	9,244,530.04	-93,875,520.74	-113,636,777.48
本期利润	13,001,712.46	-78,644,272.89	-145,681,873.69
加权平均基金份额本期利润	0.0221	-0.1152	-0.2864
本期加权平均净值利润率	2.16%	-11.56%	-22.15%
本期基金份额净值增长率	1.09%	-16.42%	21.02%
3.1.2 期末数据和指标	2017年末	2016年末	2015年末
期末可供分配利润	-163,538,293.95	-185,055,961.88	-100,960,889.61
期末可供分配基金份额利润	-0.2938	-0.3147	-0.1866
期末基金资产净值	569,106,607.48	594,817,658.43	654,915,385.08
期末基金份额净值	1.0225	1.0115	1.2102
3.1.3 累计期末指标	2017年末	2016年末	2015年末
基金份额累计净值增长率	2.25%	1.15%	21.02%

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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-4.80%	0.92%	-5.06%	0.93%	0.26%	-0.01%
过去六个月	2.33%	0.91%	1.78%	0.91%	0.55%	0.00%
过去一年	1.09%	0.87%	-0.13%	0.88%	1.22%	-0.01%

自基金合同生效日起至今	2.25%	1.99%	18.28%	1.94%	-16.03%	0.05%
-------------	-------	-------	--------	-------	---------	-------

注：本基金投资组合的业绩比较基准为：中证500指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。中证500指数扣除了沪深300指数样本股及最近一年日均总市值排名前300名的股票，再按照最近一年（新股为上市以来）的日均成交金额由高到低排名，剔除排名后20%的股票，然后将剩余股票按照日均总市值由高到低进行排名，选取排名在前500名的股票作为该指数样本股。该指数综合反映了沪深证券市场内小市值公司的整体状况，并能够作为投资业绩的评价标准，为指数化投资和指数衍生产品创新提供基础条件。本基金投资于股票的资产比例不低于基金资产的90%，投资于中证500指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的80%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。

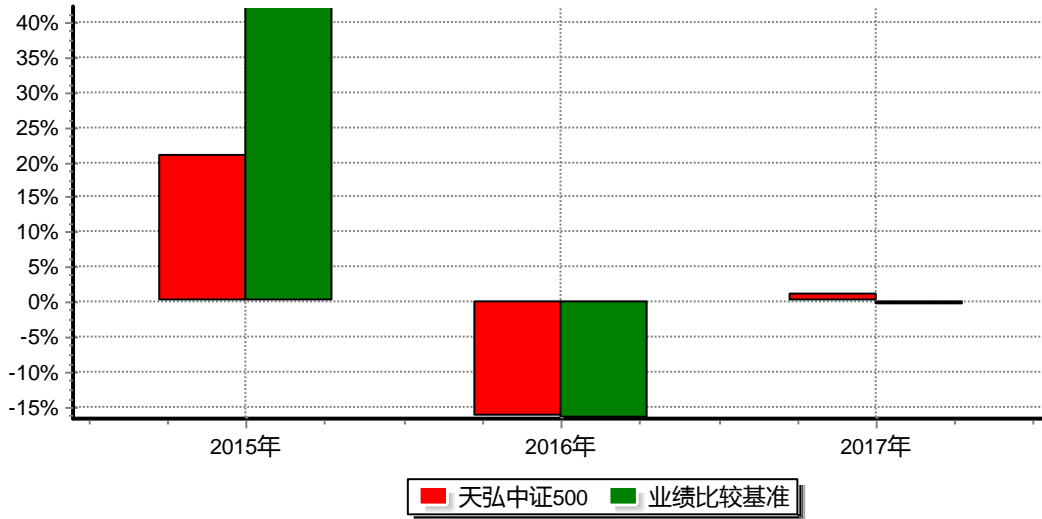
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、本基金合同于2015年1月20日生效。

2、本报告期内，本基金的各项投资比例达到基金合同约定的各项比例要求。

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



注：本基金合同于2015年1月20日生效。基金合同生效当年2015年的净值增长率按照基金合同生效后当年的实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效以来无利润分配情况，符合相关法规及基金合同的规定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

合计	100%
----	------

截至2017年12月31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、天弘文化新兴产业股票型证券投资基金（原“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、天弘云端生活优选灵活配置混合型证券投资基金、天弘新活力灵活配置混合型发起式证券投资基金、天弘互联网灵活配置混合型证券投资基金、天弘惠利灵活配置混合型证券投资基金、天弘新价值灵活配置混合型证券投资基金、天弘云商宝货币市场基金、天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金、天弘中证医药100指数型发起式证券投资基金、天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金、天弘中证全指运输指数型发起式证券投资基金、天弘中证移动互联网指数型发起式证券投资基金、天弘中证证券保险指数型发起式证券投资基金、天弘中证银行指数型发起式证券投资基金、天弘创业板指数型发起式证券投资基金、天弘中证高端装备制造指数型发起式证券投资基金、天弘上证50指数型发起式证券投资基金、天弘中证100指数型发起式证券投资基金、天弘中证800指数型发起式证券投资基金、天弘中证环保产业指数型发起式证券投资基金、天弘中证电子指数型发起式证券投资基金、天弘中证休闲娱乐指数型发起式证券投资基金、天弘中证计算机指数型发起式证券投资基金、天弘中证食品饮料指数型发起式证券投资基金、天弘弘运宝货币市场基金、天弘裕利灵活配置混合型证券投资基金、天弘乐享保本混合型证券投资基金、天弘价值精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、天弘安盈灵活配置混合型证券投资基金、天弘喜利灵活配置混合型证券投资基金、天弘信利债券型证券投资基金、天弘聚利灵活配置混合型证券投资基金、天弘金利灵活配置混合型证券投资基金、天弘金明灵活配置混合型证券投资基金、天弘天盈灵活配置混合型证券投资基金、天弘策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、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。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		

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

注：1、上述任职日期为本基金管理人对外披露的任职日期。

2、上述离任日期为本基金管理人对外披露的离任日期。

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4、本年度报告截止日至报告批准送出日之间，本基金管理人于2018年2月12日增聘陈瑶女士为本基金基金经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

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

本报告期内，本基金运作合法合规，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

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

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

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

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

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

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。

2017年，在供给侧改革及国内外经济复苏的背景下，大小盘分化，基于对国内经济及证券市场的乐观预期，本基金仓位维持在业绩比较基准的仓位附近。报告期内本基金跟踪误差的来源主要是申购赎回与成分股停牌因素，当由于申赎变动、指数成分股权重调整等原因引发组合调整时，在操作过程中坚守合规第一、风控第一的前提下，结合市场趋势预判与量化分析，应用指数复制和其他合理方法优化组合结构。在遇到巨额资金在途不可用等特殊情形时会适当配置中证500股指期货加以套保，最大限度降低冲击成本和减少跟踪误差，力争投资回报与所跟踪指数保持一致，努力为投资者提供一个良好的指数投资工具。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2017年12月31日，本基金份额净值为1.0225元。本报告期本基金份额净值增长率1.09%，同期业绩比较基准增长率-0.13%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018年，中央经济工作会议提出打好三大攻坚战，其中放在首位的就是防范化解重大金融风险，再加上控杠杆的持续，货币政策预计难以放松。投资方面，创新驱动下，研发投入对制造业投资的正面影响逐步体现，制造业将是投资领域的新亮点；房子是用来住的，不是用来炒的，政府加大对住房租赁的支持力度，预计在综合土地供应加大、商品房销售回落有限及政策驱动开工的影响下，房地产投资仍会保持一定的增速；政府弱化增长目标、强调提高经济增长质量，可能导致财政政策的总体力度有所回撤，再加上地方债务风险继续严控，进而带来基建投资增速将明显下移。消费方面，长期来看，随着我国居民收入水平的进一步提升，消费结构将会逐步发生趋势性转变；短期来看，当前我国居民杠杆率偏高，贫富差距持续拉大，以及房地产对消费的挤出效应，消费增速难以快速上升。全球主要经济体持续复苏将使得出口保持向好趋势。尽管受到投资回落、环保限产的影响，消费升级和出口仍然能够使得2018年中国经济整体表现平稳，结合国内专业机构普遍较为乐观的预期，中国资本市场存在结构性机会是大概率事件，主要风险则来自外部市场的不确定性冲击及应对各类风险所采取的政策的不确定性。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人的监察稽核工作一切从合规运作、防范和控制风险、保障基金份额持有人利益出发，由独立的监察稽核部门按照规定的权限和程序，认真履行职责，对公司、基金运作及员工行为的合法性、合规性进行定期和不定期监督和检查。发现问题及时提出建议并督促相关部门改进完善，及时与有关人员沟通，并定期制作监察稽核报告报公司董事会。公司经理层面成立了风险管理委员会，根据公司总体风险控制目标，分配各业务和各环节风险控制目标和要求；落实公司重大风险管理的决定或决

议；听取并讨论会议成员的报告；对会议成员提出的或发现的已经存在的风险点，在充分讨论、协调基础上形成具体的风险控制措施；对潜在风险点分析讨论，拟定应对措施；对发生的风险事件和重大差错，分析原因、总结经验教训、风险定级、划分责任，向总经理办公会报告。同时，本基金管理人根据全面性原则、独立性原则、相互制约原则、定性和定量相结合原则、重要性原则建立了一套比较完整的内部控制体系，该内部控制体系由一系列业务管理制度及相应的业务处理、控制程序组成，具体包括控制环境、风险评估、控制活动、信息和沟通、监控等要素。本基金管理人已通过了ISAE3402（《国际鉴证业务准则第3402号》）认证，获得无保留意见的控制设计适当性报告。本报告期，本基金管理人全面开展基金运作监察稽核工作，确保基金投资、营销及后台运作等各环节的合法合规。通过定期检查、不定期抽查等工作方法，完善内部控制，基金运作没有出现违规行为。本报告期内，本基金管理人有关本基金的监察稽核主要工作如下：

1、在研究环节，加强研究业务独立性，注重程序合规和质量控制；在关注研究报告形式与内容的合法性基础上，跟踪检查投资备选库的入选、维护依据；进一步规范新股、新债询价、申购流程；定期检查关联方关系以及关联交易的日常维护；定期评估研究对投资的支持程度，对投资业绩的贡献度；

2、在投资交易环节，对投资运作过程中的风险点进行识别和监控，预防和控制由内部或外部流程、人员和系统失控而造成的损失；根据法律法规要求、基金合同约定、投资决策委员会的决定，适时提出增加或优化交易系统风控指标的建议，通过投资交易系统控制投资风险；跟踪每日的交易行为和交易结果，发现预警信息通过电话、邮件及合规提示及时提醒，保障投资环节的合规运作；监督检查风险管理部参与各投资组合新股申购、一级债申购、银行间交易等场外交易，保证各投资组合场外交易的事中合规控制；

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

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

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

报告期内，本基金管理人未与任何第三方签定与估值相关的定价服务。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内本基金管理人无应说明预警信息。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，国泰君安证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在天弘中证500指

数型发起式证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2018)第20660号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	天弘中证500指数型发起式证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>（一）我们审计的内容</p> <p>我们审计了天弘中证 500 指数型发起式证券投资基金(以下简称“天弘中证 500 指数型发起式基金”)的财务报表，包括 2017 年 12 月 31 日的资产负债表，2017 年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>（二）我们的意见</p> <p>我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企</p>

	业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了天弘中证 500 指数型发起式基金 2017 年 12 月 31 日的财务状况以及 2017 年度的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于天弘中证 500 指数型发起式基金,并履行了职业道德方面的其他责任。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	无
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>天弘中证500指数型发起式基金的基金管理人天弘基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估天弘中证500指数型发起式基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算天弘中证500指数型发起式基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督天弘中证500指数型发起式基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保

证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。

在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:

(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。

(二) 了解与审计相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。

(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。

(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时,根据获取的审计证据,就可能对天弘中证500指数型发起式基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性,审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露;如果披露不充分,我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而未来的事项或情况可能导致天弘中证500指数型发起式基金不能持续经营。

(五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露),并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。

	我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	薛竞、周祎
会计师事务所的地址	中国上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
审计报告日期	2018-03-29

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：天弘中证500指数型发起式证券投资基金

报告截止日：2017年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	39,432,724.58	25,340,482.06
结算备付金		5,377,795.19	10,539,913.07
存出保证金		1,804,482.84	2,179,983.83
交易性金融资产	7.4.7.2	531,648,032.30	560,852,589.94
其中：股票投资		531,648,032.30	560,852,589.94
基金投资			
债券投资		—	—
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
衍生金融资产	7.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	7.4.7.4	—	—
应收证券清算款		2,099,489.87	—
应收利息	7.4.7.5	22,170.48	15,977.69
应收股利		—	—
应收申购款		6,444,735.41	2,530,831.87

递延所得税资产		—	—
其他资产	7.4.7.6	—	—
资产总计		586,829,430.67	601,459,778.46
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
负 债:			
短期借款		—	—
交易性金融负债		—	—
衍生金融负债	7.4.7.3	—	—
卖出回购金融资产款		—	—
应付证券清算款		—	297,071.35
应付赎回款		16,934,930.22	5,399,277.25
应付管理人报酬		237,088.30	247,963.75
应付托管费		47,417.66	49,592.75
应付销售服务费		—	—
应付交易费用	7.4.7.7	97,865.46	242,577.43
应交税费		—	—
应付利息		—	—
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	7.4.7.8	405,521.55	405,637.50
负债合计		17,722,823.19	6,642,120.03
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	556,594,702.48	588,058,121.23
未分配利润	7.4.7.10	12,511,905.00	6,759,537.20
所有者权益合计		569,106,607.48	594,817,658.43
负债和所有者权益总计		586,829,430.67	601,459,778.46

注：报告截止日2017年12月31日，基金份额净值1.0225元，基金份额总额556,594,702.48份。

7.2 利润表

会计主体：天弘中证500指数型发起式证券投资基金

本报告期：2017年1月1日至2017年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017年1月1日至 2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016 年12月31日
一、收入		18,643,477.29	-71,209,347.02
1. 利息收入		662,579.87	998,792.83
其中：存款利息收入	7.4.7.11	662,579.87	998,792.83
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）		14,223,715.00	-87,439,387.70
其中：股票投资收益	7.4.7.12	10,804,758.69	-90,241,689.07
基金投资收益			
债券投资收益	7.4.7.13	—	—
资产支持证券投资收益		—	—
贵金属投资收益	7.4.7.14	—	—
衍生工具收益	7.4.7.15	-1,075,200.00	-1,731,200.00
股利收益	7.4.7.16	4,494,156.31	4,533,501.37
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	3,757,182.42	15,231,247.85
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	—	—
减：二、费用		5,641,764.83	7,434,925.87
1. 管理人报酬		3,018,435.74	3,417,190.50

2. 托管费		603,687.20	683,438.10
3. 销售服务费		—	—
4. 交易费用	7.4.7.19	1,529,904.44	2,786,978.95
5. 利息支出		—	—
其中：卖出回购金融资产支出		—	—
6. 其他费用	7.4.7.20	489,737.45	547,318.32
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		13,001,712.46	-78,644,272.89
减：所得税费用		—	—
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		13,001,712.46	-78,644,272.89

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：天弘中证500指数型发起式证券投资基金

本报告期：2017年1月1日至2017年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	588,058,121.23	6,759,537.20	594,817,658.43
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	13,001,712.46	13,001,712.46
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)	-31,463,418.75	-7,249,344.66	-38,712,763.41
其中：1. 基金申购款	2,042,769,136.60	49,962,986.35	2,092,732,122.95
2. 基金赎回款	-2,074,232,555.35	-57,212,331.01	-2,131,444,886.36
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)	556,594,702.48	12,511,905.00	569,106,607.48
项 目	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	541,157,410.82	113,757,974.26	654,915,385.08
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	-78,644,272.89	-78,644,272.89
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)	46,900,710.41	-28,354,164.17	18,546,546.24
其中：1. 基金申购款	3,626,689,424.50	-4,035,515.17	3,622,653,909.33
2. 基金赎回款	-3,579,788,714.09	-24,318,649.00	-3,604,107,363.09
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)	588,058,121.23	6,759,537.20	594,817,658.43

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

郭树强

韩海潮

薄贺龙

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

天弘中证500指数型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2014]1364号《关于准予天弘中证500指数型发起式证券投资基金注册的批复》核准，由天弘基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘中证500指数型发起式证券投资基金基金合同》负责公

开募集。本基金为契约型开放式、发起式，存续期限不定，首次募集期间为2015年1月19日，首次设立募集不包括认购资金利息共募集10,000,000.00元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第010号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《天弘中证500指数型发起式证券投资基金基金合同》于2015年1月20日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为10,000,000.00份基金份额。本基金的基金管理人为天弘基金管理有限公司，基金托管人为国泰君安证券股份有限公司。

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘中证500指数型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，以中证500指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于其他股票（非标的指数成份股及其备选成份股，含中小板、创业板及其他经中国证监会核准的上市股票）、银行存款、债券、债券回购、权证、股指期货、资产支持证券、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金投资于股票的资产比例不低于基金资产的90%，投资于中证500指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的80%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准：中证500指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。

本财务报表由本基金的基金管理人天弘基金管理有限公司于2018年3月29日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(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500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，基金合同自动终止。于2017年12月31日，本基金的基金资产净值为人民币569,106,607.48元，且本基金的基金合同将于未来12个月内生效满三年，本基金的管理人预计基金资产净值届时将高于人民币两亿元，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2017年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2017年12月31日的财务状况以及2017年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

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

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

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

(2) 金融负债的分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易

费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具（主要为股指期货投资和权证投资）按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2) 交易双方准备按净额

结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分确认为利息收入。

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

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

（1）对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

（2）对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、资产支持证券和私募债券除外）及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、资产支持证券和私募债券除外），按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中央国债登记结算有限责任公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

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

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

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
活期存款	39,432,724.58	25,340,482.06
定期存款	—	—
其中：存款期限1-3个月	—	—
其他存款	—	—
合计	39,432,724.58	25,340,482.06

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	544,729,498.24	531,648,032.30	-13,081,465.94
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—
债券	交易所市场	—	—
	银行间市场	—	—
	合计	—	—
资产支持证券	—	—	—
基金	—	—	—
其他	—	—	—
合计	544,729,498.24	531,648,032.30	-13,081,465.94
项目	上年度末 2016年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	577,666,438.30	560,852,589.94	-16,813,848.36
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—
债券	交易所市场	—	—

	银行间市场	—	—	—
	合计	—	—	—
资产支持证券		—	—	—
基金		—	—	—
其他		—	—	—
合计		577,666,438.30	560,852,589.94	-16,813,848.36

注：截至2017年12月31日，股票投资余额中包含按照指数收益法估值的特殊事项停牌相关股票。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

项目	本期末 2017年12月31日			
	合同/名义 金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	—	—	—	—
货币衍生工具	—	—	—	—
权益衍生工具	—	—	—	—
其中：股指期货投资	6,234,600.00	6,259,400.00	—	—
其他衍生工具	—	—	—	—
合计	6,234,600.00	6,259,400.00	—	—

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具 股指期货投资，净额为0。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资与相关的期货暂收款（结算所得的持仓损益）之间按抵销后的净额为0。于2017年12月31日，本基金持有的股指期货合约情况如下：

代码	名称	持仓量(买/卖)(单位：手)	合约市值	公允价值变动
IC1801	中证500股指期货IC1801合约	5	6,259,400.00	24,800.00
总额合计	—	—	—	24,800.00
减：可抵销期货暂收款-	—	—	—	24,800.00
股指期货投资净额	—	—	—	0.00

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有因买断式逆回购而取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
应收活期存款利息	20,165.00	11,643.80
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	1,762.93	3,254.79
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	242.55	1,079.10
合计	22,170.48	15,977.69

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
交易所市场应付交易费用	97,865.46	242,577.43
银行间市场应付交易费用	—	—
合计	97,865.46	242,577.43

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末	上年度末
----	-----	------

	2017年12月31日	2016年12月31日
应付券商交易单元保证金	—	—
应付赎回费	8,468.03	2,694.05
预提费用	369,000.00	369,000.00
其他应付	28,053.52	33,943.45
合计	405,521.55	405,637.50

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2017年1月1日至2017年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	588,058,121.23	588,058,121.23
本期申购	2,042,769,136.60	2,042,769,136.60
本期赎回（以“-”号填列）	-2,074,232,555.35	-2,074,232,555.35
本期末	556,594,702.48	556,594,702.48

注：申购含转换转入份额，赎回含转换转出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-185,055,961.88	191,815,499.08	6,759,537.20
本期利润	9,244,530.04	3,757,182.42	13,001,712.46
本期基金份额交易产生的变动数	12,273,137.89	-19,522,482.55	-7,249,344.66
其中：基金申购款	-652,736,650.36	702,699,636.71	49,962,986.35
基金赎回款	665,009,788.25	-722,222,119.26	-57,212,331.01
本期已分配利润	—	—	—
本期末	-163,538,293.95	176,050,198.95	12,511,905.00

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间

	2017年1月1日至2017年12月31日	2016年1月1日至2016年12月31日
活期存款利息收入	491,244.60	875,689.51
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	155,368.46	103,800.06
其他	15,966.81	19,303.26
合计	662,579.87	998,792.83

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
卖出股票成交总额	934,668,616.92	1,687,803,151.96
减：卖出股票成本总额	923,863,858.23	1,778,044,841.03
买卖股票差价收入	10,804,758.69	-90,241,689.07

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期及上年度可比期间未取得债券投资收益。

7.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间未取得资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间未取得贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无买卖权证差价收入。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

金额单位：人民币元

项目	本期收益金额 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间收益金额 2016年1月1日至2016年12月31日
股指期货投资收益	-1,075,200.00	-1,731,200.00

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
股票投资产生的股利收益	4,494,156.31	4,533,501.37
基金投资产生的股利收益	—	—
合计	4,494,156.31	4,533,501.37

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
1. 交易性金融资产	3,732,382.42	15,231,247.85
——股票投资	3,732,382.42	15,231,247.85
——债券投资	—	—
——资产支持证券投资	—	—
——基金投资	—	—
——贵金属投资	—	—
——其他	—	—
2. 衍生工具	24,800.00	—
——权证投资	—	—
——股指期货投资	24,800.00	—
3. 其他	—	—
合计	3,757,182.42	15,231,247.85

7.4.7.18 其他收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他收入。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12 月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12 月31日
交易所市场交易费用	1,529,904.44	2,786,978.95
银行间市场交易费用	—	—
合计	1,529,904.44	2,786,978.95

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12 月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12 月31日
审计费用	69,000.00	108,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
其他费用	—	—
指数使用费	120,737.45	136,687.62
汇划手续费	—	2,630.70
合计	489,737.45	547,318.32

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

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

	记机构
国泰君安证券股份有限公司(“国泰君安证券”)	基金托管人、基金销售机构
浙江蚂蚁小微金融服务集团股份有限公司	基金管理人的股东
天津信托有限责任公司	基金管理人的股东
内蒙古君正能源化工集团股份有限公司	基金管理人的股东
芜湖高新投资有限公司	基金管理人的股东
新疆天瑞博丰股权投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
新疆天惠新盟股权投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
新疆天阜恒基股权投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
新疆天聚宸兴股权投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
天弘创新资产管理有限公司(“天弘创新”)	基金管理人的全资子公司

注：1、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2、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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国泰君安证券股份有限公司	1,817,856,583.37	100.00%	3,404,161,359.02	100.00%

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国泰君安证券股份有限公司	420,469.63	100.00%	97,865.46	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国泰君安证券股份有限公司	787,430.16	100.00%	242,577.43	100.00%

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

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

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	3,018,435.74	3,417,190.50
其中：支付销售机构的客户维护费	538,862.82	424,395.21

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12月 31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月 31日
当期发生的基金应支付的托管费	603,687.20	683,438.10

注：支付基金托管人国泰君安证券股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值0.1%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值X0.1%/当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：人民币元

项目	本期 2017年1月1日至2017年12 月31日	上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12 月31日
基金合同生效日（2015年1月20日）持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
期初持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
期间申购/买入总份额	—	—
期间因拆分变动份额	—	—
减：期间赎回/卖出总份额	—	—
期末持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	1.80%	1.70%

注：基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。报告期间申购/买入总份额含转换转入份额，期间赎回/卖出总份额含转换转出份额。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年1月1日至2017年12月31日		上年度可比期间 2016年1月1日至2016年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
国泰君安证券股份有限公司	39,432,724.58	491,244.60	25,340,482.06	875,689.51

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

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.7 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须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金本期无利润分配情况。

7.4.12 期末（2017年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	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 (单位：股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
603080	新疆火炬	2017-12-25	2018-01-03	新股中签	13.60	13.60	1,187	16,143.20	16,143.20	
002923	润都股份	2017-12-28	2018-01-05	新股中签	17.01	17.01	954	16,227.54	16,227.54	
300664	鹏鹞环保	2017-12-28	2018-01-05	新股中签	8.88	8.88	3,640	32,323.20	32,323.20	

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金

作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额
600187	国中水务	2017-11-9	重要事项未公告	4.68	2018-03-20	4.21	150,200	821,519.63	702,936.00
600525	长园集团	2017-12-25	重要事项未公告	15.79	2018-01-10	17.30	165,797	2554215.23	2617934.63
600614	鹏起科技	2017-12-26	重要事项未公告	10.16		0.00	132,200	1579752.51	1,343,152.00
600645	中源协和	2017-10-9	重要事项未公告	28.40	2018-1-19	25.56	43,551	1,347,899.06	1,236,848.40
600664	哈药股份	2017-9-28	重要事项未公告	5.81	2018-02-27	6.00	215,192	1,580,229.93	1,250,265.52
002168	深圳惠程	2017-12-19	拟披露重大事项	13.76		0.00	117,700	1,647,019.25	1,619,552.00
002919	名臣健康	2017-12-28	重大事项	35.26	2018-1-2	38.79	821	10,311.76	28,948.46
000006	深振业A	2017-9-11	重大事项	9.85	2018-03-08	8.87	119,793	1,045,112.85	1,179,961.05
000031	中粮地产	2017-7-24	重大事项	8.00		0.00	155,854	1,403,404.45	1,246,832.00
000156	华数传媒	2017-12-26	重大事项	11.40		0.00	71,600	920,772.03	816,240.00
000401	冀东水泥	2017-11-21	重大资产重组	13.79	2018-1-15	15.17	72,281	1,150,304.84	996,754.99
000547	航天发展	2017-10-30	重大事项	10.83		0.00	111,630	1,824,190.03	1,208,952.90
000566	海南海药	2017-11-22	重大事项	12.89		0.00	93,384	1,229,901.16	1,203,719.76
000592	平潭发展	2017-8-9	重大事项	5.75	2018-1-29	5.70	202,338	1,372,452.58	1,163,443.50
000766	通化金马	2017-11-24	重大事项	13.60		0.00	45,100	741,581.78	613,360.00
000806	银河生物	2017-7-18	重大事项	10.76	2018-1-18	10.01	99,100	1,429,575.53	1,066,316.00
00092	福星	2017-	重大事项	10.89	2018-	11.98	94,90	1,161,953	1,033,461

6	股份	12-26			1-10		0	.48	.00
000930	中粮生化	2017-10-24	重大事项	13.34		0.00	111,700	1,370,969.19	1,490,078.00
000939	凯迪生态	2017-11-16	重大事项	4.99		0.00	167,776	887,010.42	837,202.24
002122	天马股份	2017-12-19	重大事项	8.49		0.00	87,800	876,390.50	745,422.00
002344	海宁皮城	2017-11-1	拟披露重大事项	7.93	2018-1-31	7.44	56,276	553,670.45	446,268.68
002345	潮宏基	2017-12-20	重大事项	10.75		0.00	56,206	612,959.46	604,214.50
002358	森源电气	2017-12-7	拟披露重大事项	14.86	2018-03-07	15.05	45,904	800,346.07	682,133.44
002366	台海核电	2017-12-6	重大资产重组	26.45		0.00	62,724	1,636,134.38	1,659,049.80
002512	达华智能	2017-12-6	拟披露重大事项	18.07	2018-03-06	16.26	65,904	1,138,361.30	1,190,885.28
002745	木林森	2017-12-28	重大事项	45.50	2018-1-5	46.50	26,900	1,259,823.08	1,223,950.00
300156	神雾环保	2017-7-17	拟披露重大事项	24.16	2018-1-17	21.74	91,606	2,648,035.37	2,213,200.96
300730	科创信息	2017-12-25	重大事项	41.55	2018-1-2	45.71	821	6,863.56	34,112.55
300010	立思辰	2017-11-17	拟披露重大事项	11.17	2018-02-22	10.05	46,411	708,985.23	518,410.87
300032	金龙机电	2017-11-27	拟披露重大事项	13.89		0.00	38,300	581,760.56	531,987.00
300116	坚瑞沃能	2017-12-18	拟披露重大事项	7.62		0.00	114,300	1,104,030.84	870,966.00
300134	大富科技	2017-12-18	拟披露重大事项	16.45	2018-03-19	14.81	47,390	1,128,262.26	779,565.50
300159	新研股份	2017-11-23	拟披露重大事项	10.40	2018-03-22	9.36	86,799	1,210,431.57	902,709.60
300383	光环新网	2017-11-7	拟披露重大事项	13.19	2018-03-19	14.51	99,700	1,272,164.10	1,315,043.00
000693	*ST华泽	2016-3-1	重大资产重组	12.50	2018-03-21	11.88	49,788	1,135,492.48	622,350.00
000979	中弘股份	2017-9-7	重大事项	1.94	2018-02-14	1.75	639,376	1,264,800.78	1,240,389.44
002004	华邦健康	2017-12-14	重大事项	6.73	2018-03-14	7.30	176,290	1,476,068.99	1,186,431.70

注：1. 本基金截至2017年12月31日止持有以上因公布的重大事项或重大资产重组可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2017年12月31日，本基金未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2017年12月31日，本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为指数型基金，采用指数复制投资策略，标的指数为中证500指数，按照个股在标的指数中的基准权重构建股票组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应地调整，以复制和跟踪标的指数。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现与跟踪指数相同的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以审计与风险控制委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，董事会负责监督检查公司的合法合规运营、内部控制、风险管理，从而控制公司的整体运营风险。在董事会下设立审计与风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理委员会，主要负责根据公司总体风险控制目标，将交易、运营风险控制目标和要求分配到各部门；讨论、协调各部门之间的风险管理过程；听取各部门风险管理工作方面的汇报，确定未来一段时间各部门应重点关注的风险点，并调整与改进相关的风险处理和策略；讨论向公司高级管理层提交的基金运作风险报告。在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部负责，对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理提供合规控制标准，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标；监察稽核部对公司总经理负责，并由督察长分管。风险管理部通过投资交易系统的风控参数设置，保证各投资组合的投资比例合规；参与各投资组合新股申购、一级债申购、银行间交易等场外交易的风险识别与评估，保证各投资组合场外交易的事中合规控制；负责各投资组合投资绩效、风险的计量和控制。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分

析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在具有基金托管资格的中国工商银行股份有限公司，与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于2017年12月31日，本基金未持有债券(2016年12月31日：同)。

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或基金持仓资产在市场出现剧烈波动的情况下难以以合理价格变现。

为防范无法支付赎回款而产生的流动性风险，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。此外，基金管理人经与基金托管人协商，在确保投资者得到公平对待的前提下，可依照法律法规及基金合同的约定，综合运用各类流动性风险管理工具，对赎回申请等进行适度调整，作为特定情形下基金管理人流动性风险管理的辅助措施。

于2017年12月31日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自2017年10月1日起施

行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理,通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司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一家上市公司发行的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%,本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票,不得超过该上市公司可流通股票的30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市,其余亦可在银行间同业市场交易,部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注7.4.12。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算,确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。

同时,本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度;按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理,以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外,本基金的基金管理人建立了交易对手管理制度,要求根据质押品的资质确定质押率水平;持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额;并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时,可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施,本基金在本报告期内流动性情况良好。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。

利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末2017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	39,432,724.58	—	—	—	39,432,724.58
结算备付金	5,377,795.19	—	—	—	5,377,795.19
存出保证金	1,804,482.84	—	—	—	1,804,482.84
交易性金融资产	—	—	—	531,648,032.30	531,648,032.30
应收证券清算款	—	—	—	2,099,489.87	2,099,489.87
应收利息	—	—	—	22,170.48	22,170.48
应收申购款	—	—	—	6,444,735.41	6,444,735.41
资产总计	46,615,002.61	—	—	540,214,428.06	586,829,430.67
负债					
应付证券清算款	—	—	—	—	—
应付赎回款	—	—	—	16,934,930	16,934,930

				.22	.22
应付管理人报酬	—	—	—	237,088.30	237,088.30
应付托管费	—	—	—	47,417.66	47,417.66
应付交易费用	—	—	—	97,865.46	97,865.46
其他负债	—	—	—	405,521.55	405,521.55
负债总计	—	—	—	17,722,823.19	17,722,823.19
利率敏感度缺口	46,615,002.61	—	—	522,491,604.87	569,106,607.48
上年度末2016年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	25,340,482.06	—	—	—	25,340,482.06
结算备付金	10,539,913.07	—	—	—	10,539,913.07
存出保证金	2,179,983.83	—	—	—	2,179,983.83
交易性金融资产	—	—	—	560,852,589.94	560,852,589.94
应收利息	—	—	—	15,977.69	15,977.69
应收申购款	—	—	—	2,530,831.87	2,530,831.87
资产总计	38,060,378.96	—	—	563,399,399.50	601,459,778.46
负债					
应付证券清算款	—	—	—	297,071.35	297,071.35
应付赎回款	—	—	—	5,399,277.25	5,399,277.25
应付管理人报	—	—	—	247,963.75	247,963.75

酬					
应付托管费	—	—	—	49,592.75	49,592.75
应付交易费用	—	—	—	242,577.43	242,577.43
其他负债	—	—	—	405,637.50	405,637.50
负债总计	—	—	—	6,642,120.03	6,642,120.03
利率敏感度缺口	38,060,378.96	—	—	556,757,279.47	594,817,658.43

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2017年12月31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)。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

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

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2017年12月31日		上年度末 2016年12月31日	
	公允价值	占基金	公允价值	占基金

		资产净 值比例 (%)		资产净 值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	531,648,032.3 0	93.42	560,852,589.9 4	94.29
交易性金融资产-基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产-贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产-权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	531,648,032.3 0	93.42	560,852,589.9 4	94.29

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注7.4.1)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12月31日	上年度末 2016年12月31日
	1. 业绩比较基准(附注7.4.1)上升5%	37,027,256.59	30,055,095.35
	2. 业绩比较基准(附注7.4.1)下降5%	37,027,256.59	-30,055,095.35

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

- (1) 公允价值
 - (a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次:除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2017年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为493,160,289.59元，属于第二层次的余额为38,487,742.71元，无属于第三层次的余额。（2016年12月31日：第一层次518,019,655.97元，第二层次42,832,933.97元，无属于第三层次的余额）。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，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2017年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（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，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。

根据财政部、国家税务总局于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。

此外，财政部、国家税务总局于2017年12月25日颁布的财税[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》对资管产品管理人自2018年1月1日起运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务的销售额确定做出规定。

上述税收政策对本基金截至2017年12月31日止的财务状况和经营成果无影响。

(3)除公允价值和增值税外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	531,648,032.30	90.60
	其中：股票	531,648,032.30	90.60
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	44,810,519.77	7.64
8	其他各项资产	10,370,878.60	1.77
9	合计	586,829,430.67	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	8,946,867.18	1.57
B	采矿业	18,163,929.38	3.19
C	制造业	312,236,287.58	54.86
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,553,705.56	2.91
E	建筑业	12,141,134.34	2.13
F	批发和零售业	28,258,445.09	4.97
G	交通运输、仓储和邮政业	17,255,967.19	3.03
H	住宿和餐饮业	658,716.00	0.12
I	信息传输、软件和信息技术服务业	43,616,986.04	7.66
J	金融业	9,948,978.95	1.75
K	房地产业	31,697,180.18	5.57
L	租赁和商务服务业	8,879,618.28	1.56
M	科学研究和技术服务业	1,236,848.40	0.22
N	水利、环境和公共设施管理业	5,930,348.25	1.04
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	639,799.94	0.11
Q	卫生和社会工作	984,009.20	0.17
R	文化、体育和娱乐业	6,980,677.79	1.23
S	综合	2,726,760.00	0.48
	合计	526,856,259.35	92.58

8.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	622,350.00	0.11
C	制造业	4,068,886.06	0.71
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,143.20	—
E	建筑业	—	—

F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	17,957.94	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	34,112.55	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	32,323.20	0.01
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	4,791,772.95	0.84

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）。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

8.3.1 期末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	占基金资产净值比例（%）
1	600516	方大炭素	136,500	3,942,120.00	0.69
2	600201	生物股份	114,147	3,623,025.78	0.64
3	600176	中国巨石	222,323	3,621,641.67	0.64
4	002405	四维图新	130,488	3,443,578.32	0.61
5	000661	长春高新	17,314	3,168,462.00	0.56
6	002422	科伦药业	109,596	2,728,940.40	0.48
7	002271	东方雨虹	67,146	2,683,154.16	0.47
8	600525	长园集团	165,797	2,617,934.63	0.46
9	600584	长电科技	120,791	2,576,472.03	0.45

10	000786	北新建材	113,500	2,553,750.00	0.45
11	000998	隆平高科	95,740	2,462,432.80	0.43
12	002001	新 和 成	64,200	2,443,452.00	0.43
13	002340	格林美	339,344	2,439,883.36	0.43
14	300274	阳光电源	129,105	2,423,300.85	0.43
15	600438	通威股份	197,500	2,391,725.00	0.42
16	600521	华海药业	79,286	2,388,094.32	0.42
17	603019	中科曙光	57,398	2,309,695.52	0.41
18	600426	华鲁恒升	144,119	2,294,374.48	0.40
19	002049	紫光国芯	46,400	2,226,736.00	0.39
20	000039	中集集团	96,400	2,202,740.00	0.39
21	600315	上海家化	59,700	2,202,333.00	0.39
22	002092	中泰化学	163,721	2,179,126.51	0.38
23	300266	兴源环境	79,500	2,146,500.00	0.38
24	600079	人福医药	120,278	2,145,759.52	0.38
25	000050	深天马 A	107,000	2,108,970.00	0.37
26	000830	鲁西化工	130,300	2,074,376.00	0.36
27	600298	安琪酵母	62,801	2,054,848.72	0.36
28	002583	海能达	111,000	2,054,610.00	0.36
29	600642	申能股份	346,500	2,030,490.00	0.36
30	600256	广汇能源	399,000	2,018,940.00	0.35
31	002050	三花智控	109,998	2,017,363.32	0.35
32	601168	西部矿业	242,200	1,986,040.00	0.35
33	002179	中航光电	50,228	1,977,978.64	0.35
34	000009	中国宝安	273,000	1,973,790.00	0.35
35	600291	西水股份	83,400	1,961,568.00	0.34
36	600392	盛和资源	103,050	1,957,950.00	0.34
37	000977	浪潮信息	98,300	1,954,204.00	0.34
38	002410	广联达	99,468	1,949,572.80	0.34
39	002384	东山精密	68,103	1,938,211.38	0.34
40	600004	白云机场	131,300	1,930,110.00	0.34

41	000418	小天鹅 A	28,037	1,902,310.45	0.33
42	600879	航天电子	241,500	1,893,360.00	0.33
43	000488	晨鸣纸业	113,138	1,886,010.46	0.33
44	600388	龙净环保	108,600	1,878,780.00	0.33
45	002311	海大集团	80,031	1,872,725.40	0.33
46	601233	桐昆股份	82,755	1,861,159.95	0.33
47	002573	清新环境	81,805	1,859,427.65	0.33
48	300055	万邦达	87,800	1,846,434.00	0.32
49	000513	丽珠集团	27,740	1,843,323.00	0.32
50	002078	太阳纸业	197,791	1,835,500.48	0.32
51	300088	长信科技	233,900	1,831,437.00	0.32
52	600022	山东钢铁	831,030	1,778,404.20	0.31
53	600499	科达洁能	160,340	1,778,170.60	0.31
54	000690	宝新能源	221,088	1,768,704.00	0.31
55	603589	口子窖	38,205	1,759,340.25	0.31
56	600872	中炬高新	70,882	1,755,038.32	0.31
57	600600	青岛啤酒	44,121	1,735,278.93	0.30
58	600811	东方集团	378,157	1,731,959.06	0.30
59	601699	潞安环能	151,880	1,728,394.40	0.30
60	000887	中鼎股份	94,200	1,711,614.00	0.30
61	600875	东方电气	152,400	1,711,452.00	0.30
62	002019	亿帆医药	76,700	1,706,575.00	0.30
63	002176	江特电机	149,400	1,691,208.00	0.30
64	600056	中国医药	67,900	1,690,031.00	0.30
65	600885	宏发股份	40,700	1,683,759.00	0.30
66	000656	金科股份	339,204	1,679,059.80	0.30
67	002407	多氟多	82,100	1,676,482.00	0.29
68	600166	福田汽车	593,199	1,666,889.19	0.29
69	002366	台海核电	62,724	1,659,049.80	0.29
70	000066	中国长城	224,485	1,636,495.65	0.29
71	600839	四川长虹	469,300	1,633,164.00	0.29

72	002439	启明星辰	69,700	1,627,495.00	0.29
73	002273	水晶光电	68,840	1,623,935.60	0.29
74	600718	东软集团	110,600	1,621,396.00	0.28
75	002517	恺英网络	72,998	1,621,285.58	0.28
76	600643	爱建集团	146,120	1,619,009.60	0.28
77	002038	双鹭药业	52,191	1,616,355.27	0.28
78	000997	新大陆	89,890	1,611,727.70	0.28
79	600183	生益科技	92,485	1,596,291.10	0.28
80	600755	厦门国贸	157,936	1,595,153.60	0.28
81	600418	江淮汽车	168,441	1,593,451.86	0.28
82	600325	华发股份	215,646	1,587,154.56	0.28
83	002244	滨江集团	198,500	1,578,075.00	0.28
84	600260	凯乐科技	54,101	1,574,880.11	0.28
85	600266	北京城建	119,300	1,567,602.00	0.28
86	600808	马钢股份	379,202	1,566,104.26	0.28
87	002359	北讯集团	69,100	1,558,205.00	0.27
88	000970	中科三环	108,200	1,555,916.00	0.27
89	600787	中储股份	139,699	1,536,689.00	0.27
90	600138	中青旅	73,464	1,533,193.68	0.27
91	000878	云南铜业	107,800	1,529,682.00	0.27
92	000581	威孚高科	63,701	1,528,824.00	0.27
93	600060	海信电器	99,700	1,497,494.00	0.26
94	002223	鱼跃医疗	76,390	1,497,244.00	0.26
95	000930	中粮生化	111,700	1,490,078.00	0.26
96	002670	国盛金控	76,303	1,484,093.35	0.26
97	600673	东阳光科	219,300	1,480,275.00	0.26
98	600460	士兰微	95,260	1,469,861.80	0.26
99	002195	二三四五	250,800	1,464,672.00	0.26
100	002285	世联行	129,988	1,449,366.20	0.25
101	000825	太钢不锈	289,642	1,436,624.32	0.25
102	002408	齐翔腾达	112,798	1,430,278.64	0.25

103	600160	巨化股份	134,170	1,426,227.10	0.25
104	600094	大名城	202,400	1,414,776.00	0.25
105	300197	铁汉生态	115,900	1,408,185.00	0.25
106	300146	汤臣倍健	93,500	1,404,370.00	0.25
107	600435	北方导航	113,644	1,401,230.52	0.25
108	000960	锡业股份	106,100	1,400,520.00	0.25
109	002640	跨境通	73,000	1,397,220.00	0.25
110	300182	捷成股份	162,200	1,396,542.00	0.25
111	600884	杉杉股份	71,470	1,385,088.60	0.24
112	300115	长盈精密	68,991	1,384,649.37	0.24
113	600978	宜华生活	150,800	1,378,312.00	0.24
114	600655	豫园股份	127,929	1,373,957.46	0.24
115	600062	华润双鹤	55,179	1,365,680.25	0.24
116	601000	唐山港	289,080	1,361,566.80	0.24
117	600143	金发科技	207,164	1,361,067.48	0.24
118	000999	华润三九	49,900	1,357,280.00	0.24
119	000807	云铝股份	132,600	1,356,498.00	0.24
120	600282	南钢股份	280,137	1,355,863.08	0.24
121	000981	银亿股份	153,500	1,355,405.00	0.24
122	000703	恒逸石化	62,721	1,352,891.97	0.24
123	600614	鹏起科技	132,200	1,343,152.00	0.24
124	600503	华丽家族	203,600	1,333,580.00	0.23
125	600179	安通控股	53,800	1,331,550.00	0.23
126	600346	恒力股份	107,800	1,329,174.00	0.23
127	002183	怡亚通	188,500	1,328,925.00	0.23
128	000778	新兴铸管	253,500	1,323,270.00	0.23
129	600970	中材国际	133,796	1,323,242.44	0.23
130	002013	中航机电	122,279	1,319,390.41	0.23
131	300383	光环新网	99,700	1,315,043.00	0.23
132	601231	环旭电子	83,000	1,308,910.00	0.23
133	002051	中工国际	70,712	1,303,222.16	0.23

134	002589	瑞康医药	95,520	1,284,744.00	0.23
135	002221	东华能源	104,910	1,280,951.10	0.23
136	000988	华工科技	76,601	1,270,044.58	0.22
137	002127	南极电商	104,000	1,267,760.00	0.22
138	000732	泰禾集团	63,200	1,265,264.00	0.22
139	600409	三友化工	131,200	1,258,208.00	0.22
140	600125	铁龙物流	116,000	1,255,120.00	0.22
141	600664	哈药股份	215,192	1,250,265.52	0.22
142	000031	中粮地产	155,854	1,246,832.00	0.22
143	600240	华业资本	144,800	1,242,384.00	0.22
144	000979	中弘股份	639,376	1,240,389.44	0.22
145	600645	中源协和	43,551	1,236,848.40	0.22
146	000598	兴蓉环境	227,700	1,236,411.00	0.22
147	002373	千方科技	84,202	1,233,559.30	0.22
148	600161	天坛生物	42,599	1,226,425.21	0.22
149	002268	卫士通	53,269	1,226,252.38	0.22
150	002745	木林森	26,900	1,223,950.00	0.22
151	002491	通鼎互联	96,170	1,211,742.00	0.21
152	000547	航天发展	111,630	1,208,952.90	0.21
153	000729	燕京啤酒	179,100	1,207,134.00	0.21
154	000566	海南海药	93,384	1,203,719.76	0.21
155	002281	光迅科技	40,806	1,199,696.40	0.21
156	002030	达安基因	64,463	1,197,722.54	0.21
157	002512	达华智能	65,904	1,190,885.28	0.21
158	000078	海王生物	201,750	1,190,325.00	0.21
159	002004	华邦健康	176,290	1,186,431.70	0.21
160	002400	省广股份	221,467	1,180,419.11	0.21
161	600410	华胜天成	112,180	1,180,133.60	0.21
162	000006	深振业A	119,793	1,179,961.05	0.21
163	600597	光明乳业	77,800	1,178,670.00	0.21
164	600635	大众公用	246,297	1,177,299.66	0.21

165	600566	济川药业	30,800	1,175,020.00	0.21
166	300166	东方国信	93,217	1,169,873.35	0.21
167	000592	平潭发展	202,338	1,163,443.50	0.20
168	002048	宁波华翔	48,698	1,159,012.40	0.20
169	000685	中山公用	112,442	1,152,530.50	0.20
170	002440	闰土股份	58,400	1,149,896.00	0.20
171	002152	广电运通	154,300	1,147,992.00	0.20
172	600037	歌华有线	88,300	1,147,017.00	0.20
173	000028	国药一致	19,011	1,145,412.75	0.20
174	600122	宏图高科	117,472	1,138,303.68	0.20
175	600307	酒钢宏兴	398,000	1,138,280.00	0.20
176	000089	深圳机场	130,200	1,132,740.00	0.20
177	600348	阳泉煤业	152,900	1,128,402.00	0.20
178	600572	康恩贝	159,483	1,127,544.81	0.20
179	600380	健康元	99,900	1,117,881.00	0.20
180	002056	横店东磁	104,460	1,117,722.00	0.20
181	600500	中化国际	132,100	1,117,566.00	0.20
182	600717	天津港	106,500	1,117,185.00	0.20
183	600171	上海贝岭	68,643	1,116,821.61	0.20
184	600267	海正药业	73,700	1,115,818.00	0.20
185	601200	上海环境	44,600	1,112,324.00	0.20
186	002131	利欧股份	427,685	1,111,981.00	0.20
187	002431	棕榈股份	132,325	1,111,530.00	0.20
188	000975	银泰资源	82,387	1,100,690.32	0.19
189	601880	大连港	393,203	1,097,036.37	0.19
190	600863	内蒙华电	369,100	1,096,227.00	0.19
191	002506	协鑫集成	256,400	1,094,828.00	0.19
192	600881	亚泰集团	206,398	1,089,781.44	0.19
193	300324	旋极信息	74,426	1,088,852.38	0.19
194	300058	蓝色光标	197,100	1,087,992.00	0.19
195	600511	国药股份	39,000	1,084,200.00	0.19

196	000636	风华高科	91,092	1,082,172.96	0.19
197	002665	首航节能	161,315	1,074,357.90	0.19
198	002028	思源电气	67,662	1,072,442.70	0.19
199	000806	银河生物	99,100	1,066,316.00	0.19
200	600026	中远海能	174,134	1,065,700.08	0.19
201	300002	神州泰岳	174,100	1,065,492.00	0.19
202	002477	雏鹰农牧	238,977	1,061,057.88	0.19
203	002191	劲嘉股份	114,501	1,059,134.25	0.19
204	002280	联络互动	138,200	1,058,612.00	0.19
205	600120	浙江东方	42,703	1,050,920.83	0.18
206	002249	大洋电机	150,600	1,049,682.00	0.18
207	600416	湘电股份	84,000	1,049,160.00	0.18
208	600737	中粮糖业	130,300	1,035,885.00	0.18
209	600967	内蒙一机	85,900	1,035,095.00	0.18
210	000012	南玻A	122,410	1,034,364.50	0.18
211	000926	福星股份	94,900	1,033,461.00	0.18
212	002635	安洁科技	39,042	1,018,605.78	0.18
213	600936	广西广电	148,300	1,017,338.00	0.18
214	000400	许继电气	77,000	1,015,630.00	0.18
215	002354	天神娱乐	59,365	1,015,141.50	0.18
216	600466	蓝光发展	108,400	1,013,540.00	0.18
217	600835	上海机电	41,044	1,005,578.00	0.18
218	600633	浙数文化	66,103	1,004,765.60	0.18
219	600575	皖江物流	246,800	999,540.00	0.18
220	000612	焦作万方	106,245	998,703.00	0.18
221	600751	天海投资	163,393	998,331.23	0.18
222	000401	冀东水泥	72,281	996,754.99	0.18
223	002709	天赐材料	21,600	993,384.00	0.17
224	600216	浙江医药	73,802	991,898.88	0.17
225	002505	大康农业	348,500	989,740.00	0.17
226	603369	今世缘	63,800	989,538.00	0.17

227	000667	美好置业	325,100	988,304.00	0.17
228	300244	迪安诊断	41,660	984,009.20	0.17
229	300026	红日药业	229,494	977,644.44	0.17
230	600598	北大荒	90,600	976,668.00	0.17
231	000860	顺鑫农业	50,798	975,829.58	0.17
232	300133	华策影视	89,800	973,432.00	0.17
233	600064	南京高科	68,569	972,994.11	0.17
234	600151	航天机电	127,800	970,002.00	0.17
235	300113	顺网科技	52,982	969,040.78	0.17
236	002371	北方华创	23,350	967,624.00	0.17
237	000758	中色股份	150,112	965,220.16	0.17
238	300199	翰宇药业	59,273	964,964.44	0.17
239	000712	锦龙股份	56,800	964,464.00	0.17
240	600478	科力远	130,650	964,197.00	0.17
241	000596	古井贡酒	14,650	962,065.50	0.17
242	002353	杰瑞股份	73,000	957,760.00	0.17
243	300253	卫宁健康	142,315	954,933.65	0.17
244	002603	以岭药业	61,200	952,272.00	0.17
245	300287	飞利信	127,801	947,005.41	0.17
246	002444	巨星科技	68,440	946,525.20	0.17
247	600823	世茂股份	190,900	943,046.00	0.17
248	603766	隆鑫通用	134,300	942,786.00	0.17
249	002701	奥瑞金	149,584	934,900.00	0.16
250	600039	四川路桥	229,177	932,750.39	0.16
251	002807	江阴银行	112,400	930,672.00	0.16
252	600908	无锡银行	117,300	923,151.00	0.16
253	002128	露天煤业	83,085	920,581.80	0.16
254	000027	深圳能源	151,200	916,272.00	0.16
255	002390	信邦制药	108,150	913,867.50	0.16
256	600086	东方金钰	85,774	913,493.10	0.16
257	000021	深科技	93,508	909,832.84	0.16

258	600017	日照港	234,400	909,472.00	0.16
259	002299	圣农发展	63,000	907,200.00	0.16
260	300159	新研股份	86,799	902,709.60	0.16
261	002147	新光圆成	69,630	901,012.20	0.16
262	002002	鸿达兴业	131,412	898,858.08	0.16
263	603077	和邦生物	448,800	897,600.00	0.16
264	300376	易事特	118,200	894,774.00	0.16
265	002155	湖南黄金	91,604	888,558.80	0.16
266	600158	中体产业	85,742	881,427.76	0.15
267	600648	外高桥	47,400	876,900.00	0.15
268	600563	法拉电子	17,203	874,084.43	0.15
269	600801	华新水泥	61,700	871,821.00	0.15
270	300116	坚瑞沃能	114,300	870,966.00	0.15
271	002266	浙富控股	201,050	870,546.50	0.15
272	600366	宁波韵升	49,491	867,082.32	0.15
273	000681	视觉中国	44,451	866,794.50	0.15
274	300001	特锐德	63,200	865,208.00	0.15
275	600312	平高电气	86,359	862,726.41	0.15
276	601678	滨化股份	105,787	858,990.44	0.15
277	600848	上海临港	38,500	858,550.00	0.15
278	000528	柳工	99,970	852,744.10	0.15
279	002672	东江环保	52,450	852,312.50	0.15
280	002308	威创股份	69,669	849,961.80	0.15
281	002032	苏泊尔	20,900	843,942.00	0.15
282	000939	凯迪生态	167,776	837,202.24	0.15
283	600317	营口港	246,600	835,974.00	0.15
284	000718	苏宁环球	192,700	834,391.00	0.15
285	000762	西藏矿业	53,125	834,062.50	0.15
286	000563	陕国投A	196,200	833,850.00	0.15
287	000877	天山股份	79,900	830,960.00	0.15
288	002489	浙江永强	138,240	830,822.40	0.15

289	600594	益佰制药	80,603	823,762.66	0.14
290	000727	华东科技	345,300	821,814.00	0.14
291	002018	华信国际	115,640	817,574.80	0.14
292	600393	粤泰股份	128,900	817,226.00	0.14
293	000156	华数传媒	71,600	816,240.00	0.14
294	600108	亚盛集团	197,800	812,958.00	0.14
295	600859	王府井	39,530	806,412.00	0.14
296	600651	飞乐音响	88,128	806,371.20	0.14
297	002368	太极股份	31,701	804,254.37	0.14
298	002428	云南锗业	66,484	802,461.88	0.14
299	002251	步步高	44,048	795,066.40	0.14
300	600270	外运发展	46,002	794,914.56	0.14
301	002463	沪电股份	148,838	793,306.54	0.14
302	600545	卓郎智能	72,200	792,756.00	0.14
303	600611	大众交通	158,900	791,322.00	0.14
304	600169	太原重工	227,972	788,783.12	0.14
305	600993	马应龙	38,380	786,022.40	0.14
306	601928	凤凰传媒	96,800	785,048.00	0.14
307	000937	冀中能源	134,659	783,715.38	0.14
308	000501	鄂武商A	48,914	780,667.44	0.14
309	300134	大富科技	47,390	779,565.50	0.14
310	600729	重庆百货	31,000	776,860.00	0.14
311	600316	洪都航空	54,701	774,566.16	0.14
312	002437	誉衡药业	111,719	769,743.91	0.14
313	002375	亚厦股份	102,200	768,544.00	0.14
314	000090	天健集团	76,060	763,642.40	0.13
315	002663	普邦股份	136,823	759,367.65	0.13
316	603000	人民网	70,100	759,183.00	0.13
317	000587	金洲慈航	107,900	755,300.00	0.13
318	600141	兴发集团	44,600	753,740.00	0.13
319	600694	大商股份	22,337	753,427.01	0.13

320	600770	综艺股份	99,075	752,970.00	0.13
321	600259	广晟有色	19,162	752,874.98	0.13
322	002250	联化科技	70,600	749,772.00	0.13
323	601717	郑煤机	113,456	746,540.48	0.13
324	002122	天马股份	87,800	745,422.00	0.13
325	002277	友阿股份	125,906	739,068.22	0.13
326	600557	康缘药业	54,820	738,973.60	0.13
327	600565	迪马股份	184,600	738,400.00	0.13
328	600098	广州发展	103,900	734,573.00	0.13
329	600582	天地科技	157,700	733,305.00	0.13
330	002064	华峰氨纶	149,100	730,590.00	0.13
331	002106	莱宝高科	71,800	730,206.00	0.13
332	603188	亚邦股份	43,894	728,201.46	0.13
333	002233	塔牌集团	60,500	720,555.00	0.13
334	002434	万里扬	68,600	720,300.00	0.13
335	600874	创业环保	55,302	719,479.02	0.13
336	300297	蓝盾股份	74,800	713,592.00	0.13
337	600765	中航重机	59,218	711,800.36	0.13
338	601311	骆驼股份	53,704	711,578.00	0.13
339	002022	科华生物	52,168	710,006.48	0.12
340	000848	承德露露	74,610	705,810.60	0.12
341	000519	中兵红箭	71,447	703,752.95	0.12
342	600187	国中水务	150,200	702,936.00	0.12
343	000600	建投能源	91,000	701,610.00	0.12
344	000426	兴业矿业	71,360	701,468.80	0.12
345	000969	安泰科技	78,384	696,833.76	0.12
346	601016	节能风电	211,300	695,177.00	0.12
347	600338	西藏珠峰	16,617	692,098.05	0.12
348	600587	新华医疗	41,200	691,748.00	0.12
349	000541	佛山照明	74,721	687,433.20	0.12
350	002544	杰赛科技	43,600	685,828.00	0.12

351	601689	拓普集团	27,700	685,298.00	0.12
352	002657	中科金财	30,002	684,645.64	0.12
353	000543	皖能电力	136,360	684,527.20	0.12
354	002358	森源电气	45,904	682,133.44	0.12
355	002276	万马股份	79,002	680,997.24	0.12
356	603883	老百姓	10,808	680,795.92	0.12
357	002123	梦网集团	65,600	678,960.00	0.12
358	600073	上海梅林	83,418	677,354.16	0.12
359	600155	宝硕股份	66,200	677,226.00	0.12
360	600687	刚泰控股	56,900	671,989.00	0.12
361	600277	亿利洁能	104,246	671,344.24	0.12
362	000572	海马汽车	146,200	669,596.00	0.12
363	000158	常山北明	83,840	665,689.60	0.12
364	002332	仙琚制药	81,450	665,446.50	0.12
365	002690	美亚光电	34,490	664,622.30	0.12
366	002073	软控股份	83,040	664,320.00	0.12
367	600971	恒源煤电	63,689	664,276.27	0.12
368	002242	九阳股份	38,997	661,779.09	0.12
369	000061	农产品	86,100	659,526.00	0.12
370	002503	搜于特	119,000	659,260.00	0.12
371	600754	锦江股份	20,400	658,716.00	0.12
372	600058	五矿发展	54,472	658,021.76	0.12
373	002317	众生药业	51,828	657,179.04	0.12
374	600284	浦东建设	70,564	656,245.20	0.12
375	600580	卧龙电气	81,777	655,033.77	0.12
376	002261	拓维信息	84,538	654,324.12	0.11
377	002063	远光软件	61,176	650,300.88	0.11
378	601002	晋亿实业	60,600	650,238.00	0.11
379	600300	维维股份	148,600	649,382.00	0.11
380	600773	西藏城投	55,521	648,485.28	0.11
381	600869	智慧能源	112,800	647,472.00	0.11

382	601001	大同煤业	106,506	644,361.30	0.11
383	000062	深圳华强	27,421	644,119.29	0.11
384	603816	顾家家居	10,900	642,773.00	0.11
385	600422	昆药集团	70,202	642,348.30	0.11
386	000680	山推股份	126,100	641,849.00	0.11
387	000829	天音控股	67,403	640,328.50	0.11
388	603377	东方时尚	16,003	639,799.94	0.11
389	002642	荣之联	48,435	634,982.85	0.11
390	300273	和佳股份	70,081	634,933.86	0.11
391	600578	京能电力	171,600	634,920.00	0.11
392	000669	金鸿控股	43,288	634,169.20	0.11
393	002254	泰和新材	54,196	630,841.44	0.11
394	603515	欧普照明	14,700	629,748.00	0.11
395	002699	美盛文化	34,731	628,978.41	0.11
396	002681	奋达科技	56,360	628,977.60	0.11
397	002482	广田集团	78,200	627,164.00	0.11
398	300202	聚龙股份	34,903	626,508.85	0.11
399	600536	中国软件	37,617	622,561.35	0.11
400	000049	德赛电池	15,641	619,227.19	0.11
401	600458	时代新材	61,041	614,682.87	0.11
402	000766	通化金马	45,100	613,360.00	0.11
403	600759	洲际油气	143,725	612,268.50	0.11
404	600428	中远海特	109,100	612,051.00	0.11
405	300257	开山股份	43,601	610,414.00	0.11
406	600623	华谊集团	71,500	609,895.00	0.11
407	600289	ST信通	61,300	609,322.00	0.11
408	300039	上海凯宝	95,315	606,203.40	0.11
409	002345	潮宏基	56,206	604,214.50	0.11
410	601777	力帆股份	82,903	601,875.78	0.11
411	600006	东风汽车	101,498	593,763.30	0.10
412	002479	富春环保	60,600	588,426.00	0.10

413	600335	国机汽车	52,299	587,840.76	0.10
414	002005	德豪润达	134,599	586,851.64	0.10
415	300291	华录百纳	51,701	586,806.35	0.10
416	000777	中核科技	39,098	582,560.20	0.10
417	600750	江中药业	22,819	581,428.12	0.10
418	002707	众信旅游	53,300	580,437.00	0.10
419	600059	古越龙山	61,675	579,128.25	0.10
420	000652	泰达股份	131,200	578,592.00	0.10
421	600395	盘江股份	84,100	577,767.00	0.10
422	002041	登海种业	44,620	573,367.00	0.10
423	600280	中央商场	72,832	573,187.84	0.10
424	603658	安图生物	10,705	569,720.10	0.10
425	002011	盾安环境	69,830	561,433.20	0.10
426	600517	置信电气	86,260	558,102.20	0.10
427	000897	津滨发展	164,300	555,334.00	0.10
428	001696	宗申动力	87,152	550,800.64	0.10
429	000990	诚志股份	31,900	550,594.00	0.10
430	600639	浦东金桥	32,371	548,688.45	0.10
431	603328	依顿电子	38,104	546,792.40	0.10
432	600657	信达地产	96,900	540,702.00	0.10
433	600195	中牧股份	27,374	539,541.54	0.09
434	600329	中新药业	36,083	536,554.21	0.09
435	600757	长江传媒	77,030	535,358.50	0.09
436	603198	迎驾贡酒	30,417	535,035.03	0.09
437	300032	金龙机电	38,300	531,987.00	0.09
438	603556	海兴电力	14,500	527,800.00	0.09
439	300147	香雪制药	58,810	527,525.70	0.09
440	002269	美邦服饰	159,550	524,919.50	0.09
441	300010	立思辰	46,411	518,410.87	0.09
442	600862	中航高科	53,100	514,008.00	0.09
443	600880	博瑞传播	97,400	513,298.00	0.09

444	000552	靖远煤电	145,181	511,037.12	0.09
445	002342	巨力索具	85,311	511,012.89	0.09
446	600894	广日股份	54,586	510,379.10	0.09
447	603355	莱克电气	10,212	503,247.36	0.09
448	600628	新世界	49,400	502,398.00	0.09
449	603444	吉比特	2,700	496,611.00	0.09
450	002588	史丹利	73,500	491,715.00	0.09
451	002118	紫鑫药业	65,104	489,582.08	0.09
452	002093	国脉科技	51,229	486,163.21	0.09
453	000099	中信海直	53,769	484,996.38	0.09
454	300043	星辉娱乐	79,000	483,480.00	0.08
455	000662	天夏智慧	32,100	477,327.00	0.08
456	002190	成飞集成	22,003	476,144.92	0.08
457	600184	光电股份	25,863	473,810.16	0.08
458	603888	新华网	19,800	468,270.00	0.08
459	601127	小康股份	23,100	464,541.00	0.08
460	000816	智慧农业	144,100	462,561.00	0.08
461	603868	飞科电器	6,103	462,302.25	0.08
462	002392	北京利尔	91,104	459,164.16	0.08
463	002325	洪涛股份	94,830	452,339.10	0.08
464	600748	上实发展	70,410	451,328.10	0.08
465	002344	海宁皮城	56,276	446,268.68	0.08
466	600292	远达环保	49,599	443,911.05	0.08
467	600640	号百控股	30,202	441,553.24	0.08
468	600776	东方通信	60,602	438,152.46	0.08
469	600743	华远地产	119,150	436,089.00	0.08
470	600481	双良节能	102,896	412,612.96	0.07
471	601020	华钰矿业	20,100	412,452.00	0.07
472	002551	尚荣医疗	44,930	411,558.80	0.07
473	002414	高德红外	23,819	400,397.39	0.07
474	600053	九鼎投资	16,507	394,352.23	0.07

475	600996	贵广网络	39,800	394,020.00	0.07
476	002416	爱施德	39,300	372,171.00	0.07
477	603568	伟明环保	17,491	368,185.55	0.06
478	000761	本钢板材	69,400	360,880.00	0.06
479	603225	新凤鸣	9,900	354,420.00	0.06
480	600826	兰生股份	26,703	351,678.51	0.06
481	603806	福斯特	10,205	347,990.50	0.06
482	000536	华映科技	70,200	346,788.00	0.06
483	600126	杭钢股份	49,500	340,065.00	0.06
484	000987	越秀金控	33,900	333,915.00	0.06
485	603228	景旺电子	6,200	333,374.00	0.06
486	603169	兰石重装	39,101	328,057.39	0.06
487	600618	氯碱化工	28,600	309,738.00	0.05
488	603001	奥康国际	20,351	294,478.97	0.05
489	603528	多伦科技	31,415	277,394.45	0.05
490	601811	新华文轩	20,101	269,956.43	0.05
491	000025	特力A	6,903	265,834.53	0.05
492	600917	重庆燃气	21,791	242,751.74	0.04
493	601969	海南矿业	27,200	240,720.00	0.04
494	601128	常熟银行	31,000	221,030.00	0.04
495	002815	崇达技术	6,700	211,452.00	0.04
496	603877	太平鸟	7,302	197,957.22	0.03
497	600939	重庆建工	25,400	188,468.00	0.03
498	603025	大豪科技	6,313	185,728.46	0.03
499	603569	长久物流	7,601	183,868.19	0.03
500	002818	富森美	5,598	169,675.38	0.03

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

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	300156	神雾环保	91,606	2,213,200.96	0.39
2	002168	深圳惠程	117,700	1,619,552.00	0.28
3	000693	*ST华泽	49,788	622,350.00	0.11
4	300735	光弘科技	3,764	54,163.96	0.01
5	002915	中欣氟材	1,085	38,181.15	0.01
6	603477	振静股份	1,955	37,027.70	0.01
7	300730	科创信息	821	34,112.55	0.01
8	300664	鹏鹞环保	3,640	32,323.20	0.01
9	002919	名臣健康	821	28,948.46	0.01
10	002922	伊戈尔	1,245	22,248.15	0.00
11	603283	赛腾股份	1,349	19,614.46	0.00
12	603329	上海雅仕	1,183	17,957.94	0.00
13	002923	润都股份	954	16,227.54	0.00
14	603080	新疆火炬	1,187	16,143.20	0.00
15	300684	中石科技	827	11,528.38	0.00
16	603655	朗博科技	881	8,193.30	0.00

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	000066	中国长城	5,514,580.08	0.93
2	002460	赣锋锂业	5,422,769.05	0.91
3	300136	信维通信	5,286,681.21	0.89
4	600201	生物股份	4,615,983.56	0.78
5	601012	隆基股份	4,459,092.92	0.75
6	002405	四维图新	4,341,196.84	0.73
7	600487	亨通光电	4,131,470.00	0.69
8	603799	华友钴业	3,901,641.00	0.66
9	600079	人福医药	3,851,923.22	0.65

10	002572	索菲亚	3,811,956.98	0.64
11	600642	申能股份	3,808,861.78	0.64
12	600525	长园集团	3,698,330.94	0.62
13	600219	南山铝业	3,641,395.00	0.61
14	002340	格林美	3,584,179.00	0.60
15	002092	中泰化学	3,550,952.00	0.60
16	600516	方大炭素	3,545,923.00	0.60
17	600176	中国巨石	3,492,481.95	0.59
18	002407	多氟多	3,341,248.50	0.56
19	600315	上海家化	3,169,676.00	0.53
20	600584	长电科技	3,149,995.60	0.53

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

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值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	002460	赣锋锂业	11,127,345.03	1.87
2	300136	信维通信	10,383,912.92	1.75
3	601012	隆基股份	10,172,202.13	1.71
4	600487	亨通光电	9,203,244.67	1.55
5	002572	索菲亚	6,702,536.27	1.13
6	600219	南山铝业	6,438,449.33	1.08
7	603799	华友钴业	5,523,226.00	0.93
8	300296	利亚德	5,373,347.89	0.90
9	600522	中天科技	5,122,063.42	0.86
10	002508	老板电器	4,896,756.51	0.82
11	600682	南京新百	4,878,028.65	0.82
12	600201	生物股份	4,730,242.74	0.80
13	600525	长园集团	4,320,201.00	0.73
14	600699	均胜电子	4,187,759.82	0.70

15	002405	四维图新	4,162,245.45	0.70
16	600516	方大炭素	4,007,740.86	0.67
17	300122	智飞生物	3,987,196.09	0.67
18	600079	人福医药	3,968,983.62	0.67
19	002340	格林美	3,943,729.93	0.66
20	002092	中泰化学	3,940,721.81	0.66

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	890,926,918.17
卖出股票的收入（成交）总额	934,668,616.92

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量	合约市值（元）	公允价值变	风险说明
----	----	-----	---------	-------	------

		(买/卖)		动(元)	
IC1801	中证500期货1801合约	5.00	6,259,400.00	24,800.00	买入股指期货的目的是进行更有效地流动性管理。
公允价值变动总额合计					24,800.00
股指期货投资本期收益					-1,075,200.00
股指期货投资本期公允价值变动					24,800.00

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金为指数型基金，主要投资标的为指数成份股和备选成份股。基金留存的现金头寸根据基金合同规定，投资于标的指数为基础资产的股指期货，旨在配合基金日常投资管理需要，更有效地进行流动性管理，以更好地跟踪标的指数，实现投资目标。

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持有基金

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

金额单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,804,482.84
2	应收证券清算款	2,099,489.87
3	应收股利	—
4	应收利息	22,170.48

5	应收申购款	6,444,735.41
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	10,370,878.60

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 期末股票中存在流通受限情况的说明

8.13.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

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
	600525	长园集团	2,617,934.63	0.46	重要事项未公告

8.13.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

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	300156	神雾环保	2,213,200.96	0.39	拟披露重大事项
2	002168	深圳惠程	1,619,552.00	0.28	拟披露重大事项
3	000693	ST华泽	622,350.00	0.11	重大资产重组

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 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数	户均持有的基	持有人结构
-------	--------	-------

(户)	金份额	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
361,971	1,537.68	19,876,921.27	3.57%	536,717,781.21	96.43%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	3,045,955.66	0.55%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研发部门负责人持有本开放式基金	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	0

9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	1.80%	10,000,000.00	1.80%	三年
基金管理人高级管理人员	—	—	—	—	
基金经理等人员	—	—	—	—	
基金管理人股东	—	—	—	—	
其他	—	—	—	—	
合计	10,000,000.00	1.80%	10,000,000.00	1.80%	

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2015年1月20日)基金份额总额	10,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	588,058,121.23
本报告期基金总申购份额	2,042,769,136.60
减：本报告期基金总赎回份额	2,074,232,555.35
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	556,594,702.48

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。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，经天弘基金管理有限公司第五届董事会 2017 年第 1 次会议通过以下事项：任命熊军先生为本公司副总经理，以上事宜已经依照相关规定履行备案程序。

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。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略没有改变。

11.5 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。

11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内应向普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）支付服务费6.9万元。截至本报告期末，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）已为本基金提供审计服务3年。

11.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内管理人、托管人及其高级管理人员没有发生受稽查或处罚的情况。

11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.8.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占股票成交总额比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安	2	1,817,856,583.37	100.00%	420,469.63	100.00%	

11.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	天弘基金管理有限公司关于降低旗下部分基金申购、赎回及最低持有份额等相关业务限额的公告	中国证监会指定媒介	2017-01-06
2	天弘基金管理有限公司关于增加上海联泰资产管理有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投及转换业务以及参加其申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2017-01-12
3	天弘基金管理有限公司关于增加杭州科地瑞富基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投及转换业务以及参加其申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2017-01-18
4	天弘基金管理有限公司关于增加东海期货有限责任公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投及转换业务以及参加其	中国证监会指定媒介	2017-01-18

	申购费率优惠活动的公告		
5	天弘中证500指数型发起式证券投资基金2016年第4季度报告	中国证监会指定媒介	2017-01-20
6	天弘中证500指数型发起式证券投资基金招募说明书（更新）摘要	中国证监会指定媒介	2017-03-03
7	天弘中证500指数型发起式证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会指定媒介	2017-03-03
8	天弘基金管理有限公司关于变更基金直销资金账户的公告	中国证监会指定媒介	2017-03-04
9	天弘基金管理有限公司关于增加上海朝阳永续基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回及转换业务以及参加其申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2017-03-14
10	天弘基金管理有限公司关于增加泰诚财富基金销售（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500指数型发起式证券投资基金2016年年度报告	中国证监会指定媒介	2017-03-30
13	天弘中证500指数型发起式证券投资基金2016年年度报告摘要	中国证监会指定媒介	2017-03-30
14	天弘基金管理有限公司关于调整天弘中证500指数型发起式证券	中国证监会指定媒介	2017-04-17

	投资基金基金经理的公告		
15	天弘中证500指数型发起式证券投资基金2017年第1季度报告	中国证监会指定媒介	2017-04-22
16	天弘基金管理有限公司广州分公司关于营业场所变更的公告	中国证监会指定媒介	2017-04-25
17	天弘基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会指定媒介	2017-04-26
18	天弘基金管理有限公司关于调整网上直销交易系统浦发银行直联渠道申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2017-05-24
19	天弘基金管理有限公司关于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
20	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
21	天弘基金管理有限公司关于旗下基金在网上交易系统开展申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2017-06-12
22	天弘基金管理有限公司旗下基金2017年6月30日基金资产净值公告	中国证监会指定媒介	2017-06-30
23	天弘基金管理有限公司关于旗下基金在直销柜台开展认/申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2017-07-21
24	天弘基金管理有限公司澄清公告	中国证监会指定媒介	2017-07-21
25	天弘中证500指数型发起式证券投资基金2017年第2季度报告	中国证监会指定媒介	2017-07-21
26	天弘基金管理有限公司关于增加长江证券股份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	中国证监会指定媒介	2017-08-05

	相关费率优惠活动的公告		
27	天弘基金管理有限公司关于增加深圳众禄金融控股股份有限公司为旗下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	2017-08-15
28	天弘中证500指数型发起式证券投资基金2017年半年度报告摘要	中国证监会指定媒介	2017-08-28
29	天弘中证500指数型发起式证券投资基金2017年半年度报告	中国证监会指定媒介	2017-08-28
30	天弘中证500指数型发起式证券投资基金招募说明书（更新）摘要	中国证监会指定媒介	2017-09-01
31	天弘中证500指数型发起式证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会指定媒介	2017-09-01
32	天弘基金管理有限公司关于变更客服热线的公告	中国证监会指定媒介	2017-09-05
33	天弘基金管理有限公司关于增加南京苏宁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、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	2017-09-06
34	天弘基金管理有限公司澄清公告	中国证监会指定媒介	2017-09-21
35	天弘基金管理有限公司关于增加中民财富管理（上海）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	2017-09-27
36	天弘基金管理有限公司关于增加上海挖财金融信息服务有限公司为旗下部分基金销售机构并开通	中国证监会指定媒介	2017-09-27

	申购、赎回及定投业务以及参加其相关费率优惠活动的公告		
37	天弘基金管理有限公司关于增加天津万家财富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	2017-10-12
38	天弘中证500指数型发起式证券投资基金2017年第3季度报告	中国证监会指定媒介	2017-10-26
39	天弘基金管理有限公司关于增加洪泰财富(青岛)基金销售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相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2017-11-20
40	天弘基金管理有限公司关于增加上海华夏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	2017-11-23
41	天弘基金管理有限公司关于增加光大证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回及转换业务的公告	中国证监会指定媒介	2017-12-11
42	天弘基金管理有限公司关于增加江西正融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相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2017-12-21
43	天弘基金管理有限公司关于提醒投资者及时更新身份证件信息的提示性公告	中国证监会指定媒介	2017-12-28
44	天弘基金管理有限公司关于旗下	中国证监会指定媒介	2017-12-30

	证券投资基金执行增值税政策的公告		
45	天弘基金管理有限公司旗下基金2017年12月31日基金资产净值公告	中国证监会指定媒介	2017-12-31

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

本报告期内，本基金未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过本基金总份额20%的情况。

12.2 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。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

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

13.2 存放地点

天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层

13.3 查阅方式

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

公司网站：www.thfund.com.cn

天弘基金管理有限公司
二〇一八年三月二十九日