

天弘中证500指数型发起式证券投资基金2018年半年度报告

2018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：国泰君安证券股份有限公司

送出日期：2018年08月27日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年1月1日起至2018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	13
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	14
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	14
§5 托管人报告.....	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	14
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.....	15
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	18
6.4 报表附注.....	19
§7 投资组合报告.....	43
7.1 期末基金资产组合情况.....	44
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	44
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	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	63
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	64
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	65

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	65
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	65
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	65
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	65
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	66
7.12 本报告期投资基金情况	66
7.13 投资组合报告附注	66
§8 基金份额持有人信息	68
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	68
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	68
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	68
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	69
§9 开放式基金份额变动	69
§10 重大事件揭示	69
10.1 基金份额持有人大会决议	69
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	69
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	69
10.4 基金投资策略的改变	70
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件	70
10.6 基金改聘会计师事务所情况	70
10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况	70
10.8 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况	70
10.9 其他重大事件	71
§11 影响投资者决策的其他重要信息	74
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	74
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	74
§12 备查文件目录	74
12.1 备查文件目录	74
12.2 存放地点	75
12.3 查阅方式	75

§ 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01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	790,986,130.38份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	天弘中证500A	天弘中证500C
下属分级基金的交易代码	000962	005919
报告期末下属分级基金的份 额总额	756,534,078.65份	34,452,051.73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（2018年01月01日-2018年06月30日）	
	天弘中证500A	天弘中证500C
本期已实现收益	-23,997,101.58	-133,104.28
本期利润	-98,121,768.98	-1,439,863.81
加权平均基金份额本期利润	-0.1613	-0.1374
本期基金加权平均净值利润率	-16.56%	-14.99%
本期基金份额净值增长率	-15.04%	-11.01%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年06月30日)	
期末可供分配利润	-251,456,779.26	-3,792,339.14
期末可供分配基金份额利润	-0.3324	-0.1101
期末基金资产净值	657,196,492.11	30,659,712.59
期末基金份额净值	0.8687	0.8899
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	-13.13%	-11.01%

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《基金合同》2015年1月20日起生效。本基金自2018年4月24日起增设C类基金份额（即天弘中证500C），原基金份额转为A类基金份额（即天弘中证500A）。C类基金份额的首次确认日为2018年4月25日，增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

3.2 基金净值表现

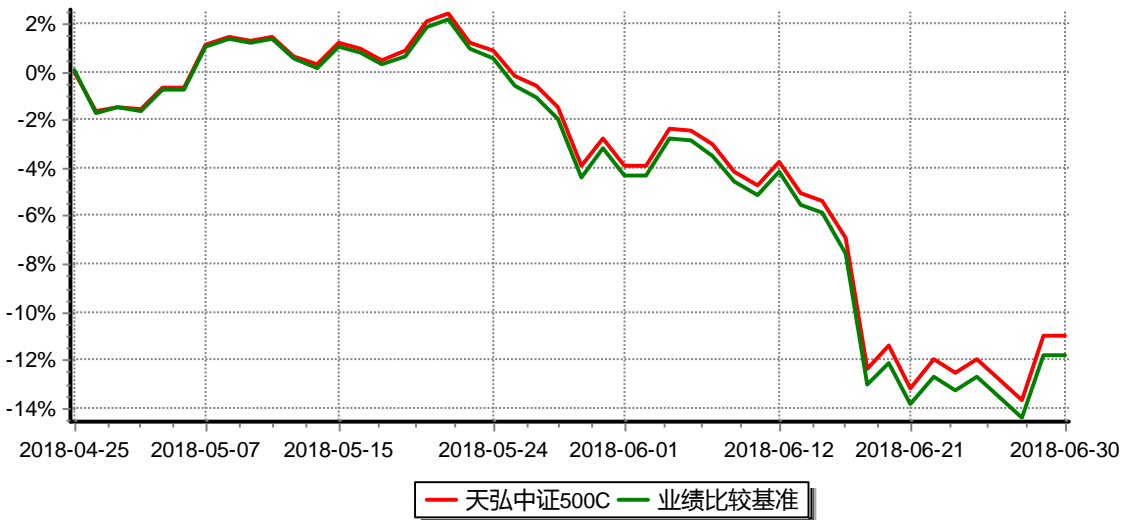
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 (天弘中证500A)	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	-8.43%	1.76%	-8.86%	1.77%	0.43%	-0.01%
过去三个月	-13.10%	1.30%	-13.96%	1.31%	0.86%	-0.01%

过去六个月	-15.04%	1.36%	-15.71%	1.37%	0.67%	-0.01%
过去一年	-13.06%	1.15%	-14.21%	1.16%	1.15%	-0.01%
过去三年	-42.16%	1.85%	-39.40%	1.80%	-2.76%	0.05%
自基金合同生效日起 至今（2015年01月20 日-2018年06月30日）	-13.13%	1.91%	-0.30%	1.87%	-12.83%	0.04%
阶段 (天弘中证500C)	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	-8.46%	1.75%	-8.86%	1.77%	0.40%	-0.02%
自基金合同生效日起 至今（2018年04月25 日-2018年06月30日）	-11.01%	1.37%	-11.81%	1.38%	0.80%	-0.01%

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，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款。

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、本基金自2018年4月24日起增设C类基金份额（即天弘中证500C），原基金份额转为A类基金份额（即天弘中证500A）。C类基金份额的首次确认日为2018年4月25日，增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

3、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

币，总部设在天津，在北京、上海、广州、天津、深圳、四川设有分公司。公司股权结构为：

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

截至2018年6月30日，本基金管理人共管理54只基金：天弘精选混合型证券投资基金、天弘永利债券型证券投资基金、天弘永定价值成长混合型证券投资基金、天弘周期策略混合型证券投资基金、天弘文化新兴产业股票型证券投资基金、天弘添利债券型证券投资基金（LOF）、天弘丰利债券型证券投资基金（LOF）、天弘现金管家货币市场基金、天弘债券型发起式证券投资基金、天弘安康颐养混合型证券投资基金（原“天弘安康养老混合型证券投资基金”）、天弘余额宝货币市场基金、天弘稳利定期开放债券型证券投资基金、天弘弘利债券型证券投资基金、天弘通利混合型证券投资基金、天弘同利债券型证券投资基金（LOF）、天弘沪深300指数型发起式证券投资基金、天弘中证500指数型发起式证券投资基金、天弘云端生活优选灵活配置混合型证券投资基金、天弘新活力灵活配置混合型发起式证券投资基金、天弘互联网灵活配置混合型证券投资基金、天弘惠利灵活配置混合型证券投资基金、天弘新价值灵活配置混合型证券投资基金、天弘云商宝货币市场基金、天弘医疗健康混合型证券投资基金（原“天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金”）、天弘中证医药100指数型发起式证券投资基金、天弘量化驱动股票型证券投资基金（原“天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金”）、天弘中证全指运输指数型发起式证券投资基金、天弘中证移动互联网指数型发起式证券投资基金、天弘中证证券保险指数型发起式证券投资基金、天弘中证银行指数型发起式证券投资基金、天弘创业板指数型发起式证券投资基金、天弘中证高端装备制造指数型发起式证券投资基金、天弘上证50指数型发起式证券投资基金、天弘中证100指数型发起式证券投资基金、天弘中证800指数型发起式证券投资基金、天弘中证环保产业指数型发起式证券投资基金、天弘中证电子指数型发起式证券投资基金、天弘中证休闲娱乐指数型发起式证券投资基金、天弘中证计算机指数型发起式证券投资基金、天弘中证食品饮料指数型发起式证券投资基金、天弘弘运宝货币市场基金、天弘裕利灵

活配置混合型证券投资基金、天弘乐享保本混合型证券投资基金、天弘价值精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、天弘安盈灵活配置混合型证券投资基金、天弘喜利灵活配置混合型证券投资基金、天弘信利债券型证券投资基金、天弘金利灵活配置混合型证券投资基金、天弘金明灵活配置混合型证券投资基金、天弘策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、天弘优选债券型证券投资基金、天弘尊享定期开放债券型发起式证券投资基金、天弘悦享定期开放债券型发起式证券投资基金、天弘荣享定期开放债券型发起式证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张子法	本基金基金经理。	2017年4月	—	16年	男，软件工程硕士。历任华夏基金管理有限公司金融工程师量化研究员。2014年3月加盟本公司，历任股票研究员、基金经理助理。
陈瑶	本基金基金经理。	2018年2月	—	7年	女，金融学硕士。2011年7月加盟本公司，历任交易员、交易主管，从事交易管理，程序化交易策略、基差交易策略、融资融券交易策略等研究工作。

注：1、上述任职日期为本基金管理人对外披露的任职日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

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

本报告期内，本基金运作合法合规，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

2018年上半年，在去杠杆的宏观背景下，信用环境收缩叠加海外经济、贸易摩擦的不确定性，股票市场回落。报告期内，本基金在运作过程中严格遵守基金合同，完全复制标的指数，进行被动指数化投资，保证基金净值增长率与基准指数间的高度正相关和跟踪误差最小化。

报告期内本基金跟踪误差的来源主要是申购赎回与成份股停牌因素。本基金秉承合规第一、风控第一的原则，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，对指数基金采取被动复制与组合优化相结合的方式跟踪指数。本基金基于谨慎原则

运用股指期货工具对基金投资组合进行管理，以应对大额申购时巨额资金在途不可用等特殊情形，提高投资效率，控制基金投资组合风险水平，追求基金充分投资、减少交易成本、降低跟踪误差，力求更好地实现本基金的投资目标。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2018年6月30日，天弘中证500A基金份额净值为0.8687元，天弘中证500C基金份额净值为0.8899元。报告期内份额净值增长率天弘中证500A为-15.04%，同期业绩比较基准增长率为-15.71%；天弘中证500C为-11.01%，同期业绩比较基准增长率为-11.81%。

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年上半年，在去杠杆的背景下，信用环境收缩，基建和房地产投资下滑，但消费对经济的带动作用提升。目前我国投资、消费结构在持续优化，经济增长的动力结构在变化，预计下半年整体消费也将保持稳健走势。尽管下半年仍然存在贸易摩擦、信用风险、经济回落的压力，但我们也看到了地产销售筑底、货币环比改善和结构性投资数据的修复等正面因素，并且6月份信贷增加、财政支出加快都意味着政策已经做出微调，后续仍有政策调整的空间。2018年上半年GDP同比增长6.8%，其中2季度增长6.7%，略低于1季度的6.8%，今年政府工作报告明确的GDP预期增长目标是6.5%，全年完成预期增长目标将是大概率事件。受国内外多重因素影响，今年上半年，股票市场回落，食品饮料和医药等消费板块受避险情绪影响相对抗跌，目前A股整体估值处于历史底部区域，破净及股票回购数量增加，显示股票市场的安全边际及配置价值逐步显现，当前A股往后看1-2年的中期价值底部已经出现，策略角度建议在当前位置上应当积极应对：大板块之间首选地产、金融，配合电子、计算机板块；消费板块有调整后再选择布局，周期全年仍然是预期对实际情况定价偏离后的等待型布局机会。

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、风险管理人员及内控合规人员组成。

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

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

报告期内，本基金管理人未与任何第三方签定与估值相关的定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

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

本托管人复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况（如有）、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、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500指数型发起式证券投资基金

报告截止日：2018年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018年06月30日	上年度末 2017年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	53,682,681.32	39,432,724.58
结算备付金		7,360,304.81	5,377,795.19
存出保证金		1,929,031.19	1,804,482.84
交易性金融资产	6.4.7.2	629,158,053.35	531,648,032.30
其中：股票投资		629,158,053.35	531,648,032.30
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		—	2,099,489.87
应收利息	6.4.7.5	30,854.17	22,170.48
应收股利		—	—
应收申购款		5,108,018.58	6,444,735.41
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.6	—	—
资产总计		697,268,943.42	586,829,430.67
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年06月30日	上年度末 2017年12月31日
负债：			
短期借款		—	—
交易性金融负债		—	—
衍生金融负债		—	—

卖出回购金融资产款		—	—
应付证券清算款		4,446,100.32	—
应付赎回款		4,160,774.72	16,934,930.22
应付管理人报酬		259,525.11	237,088.30
应付托管费		51,905.01	47,417.66
应付销售服务费		3,773.18	—
应付交易费用	6.4.7.7	280,171.95	97,865.46
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	210,488.43	405,521.55
负债合计		9,412,738.72	17,722,823.19
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	790,986,130.38	556,594,702.48
未分配利润	6.4.7.10	-103,129,925.68	12,511,905.00
所有者权益合计		687,856,204.70	569,106,607.48
负债和所有者权益总计		697,268,943.42	586,829,430.67

注：报告截止日2018年6月30日，天弘中证500指数型发起式证券投资基金A类基金份额净值0.8687元，天弘中证500指数型发起式证券投资基金C类基金份额净值0.8899元；基金份额总额790,986,130.38份，其中天弘中证500指数型发起式证券投资基金A类基金份额756,534,078.65份，天弘中证500指数型发起式证券投资基金C类基金份额34,452,051.73份。

6.2 利润表

会计主体：天弘中证500指数型发起式证券投资基金

本报告期：2018年01月01日-2018年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期	上年度可比期间
		2018年01月01日 -2018年06月30日	2017年01月01日 -2017年06月30日
一、收入		-96,408,019.36	-5,945,515.61
1.利息收入		423,780.98	319,939.68

其中：存款利息收入	6.4.7.11	423,780.98	319,939.68
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）		-21,561,098.93	-6,880,437.12
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-23,390,914.27	-8,289,119.76
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	-1,866,023.30	-1,962,440.00
股利收益	6.4.7.16	3,695,838.64	3,371,122.64
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	-75,431,426.93	614,981.83
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	160,725.52	—
减：二、费用		3,153,613.43	2,845,664.87
1. 管理人报酬		1,473,611.48	1,530,717.69
2. 托管费		294,722.29	306,143.57
3. 销售服务费		4,195.68	—
4. 交易费用	6.4.7.19	1,143,118.77	764,592.94
5. 利息支出		—	—
其中：卖出回购金融资产支出		—	—
6. 税金及附加		502.23	—
7. 其他费用	6.4.7.20	237,462.98	244,210.67
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-99,561,632.79	-8,791,180.48
减：所得税费用		—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-99,561,632.79	-8,791,180.48

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：天弘中证500指数型发起式证券投资基金

本报告期：2018年01月01日-2018年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2018年01月01日-2018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)	556,594,702.48	12,511,905.00	569,106,607.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	-99,561,632.79	-99,561,632.79
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)	234,391,427.90	-16,080,197.89	218,311,230.01
其中：1.基金申购款	1,327,495,316.07	-36,174,653.59	1,291,320,662.48
2.基金赎回款	-1,093,103,888.17	20,094,455.70	-1,073,009,432.47
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）	790,986,130.38	-103,129,925.68	687,856,204.70
项 目	上年度可比期间 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)	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)	—	-8,791,180.48	-8,791,180.48
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)	98,931,156.75	1,479,091.16	100,410,247.91

少以“-”号填列)			
其中：1.基金申购款	1,065,004,221.44	13,322,217.29	1,078,326,438.73
2.基金赎回款	-966,073,064.69	-11,843,126.13	-977,916,190.82
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）	686,989,277.98	-552,552.12	686,436,725.86

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

郭树强

韩海潮

薄贺龙

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

天弘中证500指数型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2014]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《天弘中证500指数型发起式证券投资基金基金合同》、《天弘中证500指数型发起式证券投资基金招募说明书》和《关于天弘中证500指数型发起式证券投资基金增设C类基金份额并相应修订基金合同部分条款的公告》的有关规定，本基金根据所收取认购/申购费用、赎回费用、销售服务费用方式的差异，将基金份额分为不同的类别。其

中：在投资人认购/申购、赎回基金时收取认购/申购费用、赎回费用，并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为天弘中证500指数型发起式证券投资基金A类(以下简称“A类基金”)；在投资人申购时不收取申购费、赎回时收取赎回费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为天弘中证500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类基金份额分别设置代码。由于基金费用的不同，本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算并公布基金份额净值和基金份额累计净值。投资人可自行选择认购/申购的基金份额类别，本基金不同基金份额类别之间不得互相转换。

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，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款。本基金的业绩比较基准：中证500指数收益率×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6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2018年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2018年6月30日的财务状况以及2018年上半年的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

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

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

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

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

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

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

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

税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

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

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

6.4.7 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 2018年06月30日
活期存款	53,682,681.32
定期存款	—
其中：存款期限1个月以内	—
存款期限1-3个月	—
存款期限3个月以上	—
其他存款	—
合计	53,682,681.32

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末2018年06月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	717,246,266.22	629,158,053.35	-88,088,212.87
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	717,246,266.22	629,158,053.35	-88,088,212.87

注：截至2018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

单位：人民币元

项目	本期末2018年06月30日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
权益衍生工具	6,535,000.00	—	—	
其中：股指期货投资	6,535,000.00	—	—	
其他衍生工具	—	—	—	
合计	6,535,000.00	—	—	

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2018年6月30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
IC1809	中证500期货1809合约	6	6,135,120.00	-399,880.00
总额合计				-399,880.00
减：可抵销期货暂收款				399,880.00
股指期货投资净额				-

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从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末:2018年06月30日
应收活期存款利息	28,718.82
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	1,847.05
应收债券利息	—
应收资产支持证券利息	—
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	288.30
合计	30,854.17

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 2018年06月30日
交易所市场应付交易费用	280,171.95
银行间市场应付交易费用	—
合计	280,171.95

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年06月30日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	1,585.46
预提费用	178,518.49
其他应付	30,384.48

合计	210,488.43
----	------------

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目 (天弘中证500A)	本期 2018年01月01日-2018年06月30日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	556,594,702.48	556,594,702.48
本期申购	1,285,446,651.21	1,285,446,651.21
本期赎回（以“-”号填列）	-1,085,507,275.04	-1,085,507,275.04
本期末	756,534,078.65	756,534,078.65
项目 (天弘中证500C)	基金份额（份）	
	账面金额	
上年度末	—	—
本期申购	42,048,664.86	42,048,664.86
本期赎回（以“-”号填列）	-7,596,613.13	-7,596,613.13
本期末	34,452,051.73	34,452,051.73

注：申购含转换转入份额；赎回含转换转出份额。

6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目 (天弘中证500A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-163,538,293.95	176,050,198.95	12,511,905.00
本期利润	-23,997,101.58	-74,124,667.40	-98,121,768.98
本期基金份额交易产生的变动数	-63,921,383.73	50,193,661.17	-13,727,722.56
其中：基金申购款	-397,628,049.49	364,378,780.05	-33,249,269.44
基金赎回款	333,706,665.76	-314,185,118.88	19,521,546.88
本期已分配利润	—	—	—
本期末	-251,456,779.26	152,119,192.72	-99,337,586.54

单位：人民币元

项目 (天弘中证500C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	—	—	—
本期利润	-133,104.28	-1,306,759.53	-1,439,863.81
本期基金份额交易产生的变动数	-369,218.70	-1,983,256.63	-2,352,475.33
其中：基金申购款	-454,994.48	-2,470,389.67	-2,925,384.15
基金赎回款	85,775.78	487,133.04	572,908.82
本期已分配利润	—	—	—
本期末	-502,322.98	-3,290,016.16	-3,792,339.14

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日-2018年06月30日
活期存款利息收入	388,821.38
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	30,579.32
其他	4,380.28
合计	423,780.98

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日-2018年06月30日
卖出股票成交总额	518,119,222.57
减：卖出股票成本总额	541,510,136.84
买卖股票差价收入	-23,390,914.27

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

单位：人民币元

项目	本期收益金额
	2018年01月01日-2018年06月30日
股指期货投资收益	-1,866,023.30

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2018年01月01日-2018年06月30日
股票投资产生的股利收益	3,695,838.64
基金投资产生的股利收益	—
合计	3,695,838.64

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2018年01月01日-2018年06月30日
1.交易性金融资产	-75,006,746.93
——股票投资	-75,006,746.93
——债券投资	—
——资产支持证券投资	—
——基金投资	—
——贵金属投资	—

2.衍生工具	-424,680.00
——权证投资	—
——期货投资	-424,680.00
3.其他	—
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	—
合计	-75,431,426.93

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日-2018年06月30日
基金赎回费收入	91,581.73
基金转换费收入	69,143.79
合计	160,725.52

注：1、本基金A类和C类基金份额赎回费用由赎回该类基金份额的基金份额持有人承担，在基金份额持有人赎回基金份额时收取。其中对持续持有期少于7日的投资者收取不低于1.5%的赎回费，并全额计入基金财产。

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，转出基金的赎回费对持续持有期少于7日的投资者收取不低于1.5%的赎回费，并全额计入基金财产。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日-2018年06月30日
交易所市场交易费用	1,143,118.77
银行间市场交易费用	—
合计	1,143,118.77

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日-2018年06月30日
----	-------------------------------

审计费用	29,752.78
信息披露费	148,765.71
指数使用费	58,944.49
合计	237,462.98

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、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

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 2018年01月01日-2018年06月30日		上年度可比期间 2017年01月01日-2017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
国泰君安证券	119,567,927.76	9.72%	941,158,549.46	100.00%

股份有限公司				
--------	--	--	--	--

6.4.10.1.2 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。

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 2018年01月01日-2018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
国泰君安证券股份有限公司	27,657.16	5.46%	—	—
关联方名称	上年度可比期间 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
国泰君安证券股份有限公司	217,687.68	100.00%	126,203.20	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

项目	本期 2018年01月01日-2018年06月30日	上年度可比期间 2017年01月01日-2017年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,473,611.48	1,530,717.69
其中：支付销售机构的客户维护费	326,876.87	261,784.54

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X0.5%/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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日-2018 年06月30日	上年度可比期间 2017年01月01日-2017 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	294,722.29	306,143.57

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。

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 2018年01月01日-2018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500A	天弘中证500C	合计
天弘基金管理有限 公司	—	574.93	574.93
合计	—	574.93	574.93
获得销售服务费的 各关联方名称	上年度可比期间 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500A	天弘中证500C	合计
天弘基金管理有限 公司	—	—	—
合计	—	—	—

注：本基金A类基金份额不收取销售服务费，基金支付基金销售机构的销售服务费按C类基金份额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，再由天弘基金计算并支付给各基金销售机构。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

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行过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 2018年01月01日-2018年06月 30日		上年度可比期间 2017年01月01日-2017年06 月30日	
	天弘中证500A	天弘中证 500C	天弘中证 500A	天弘中证 500C
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	—	9,952,413.63	—	—
期间因拆分变动份额	—	—	—	—
减：期间赎回/卖出总 份额	10,000,000.00	—	—	—
期末持有的基金份额	—	9,952,413.63	10,000,000.00	—
占基金总份额比例	—	1.26%	1.46%	—

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/买入总份额含转换入份额，赎回/卖出总份额含转换出份额。

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

本基金本期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

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 2018年01月01日-2018年06月30 日		上年度可比期间 2017年01月01日-2017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

国泰君安证券股份有限公司	53,682,681.32	388,821.38	25,539,906.63	213,102.99
--------------	---------------	------------	---------------	------------

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。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券交易。

6.4.10.7 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其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

6.4.12 期末（2018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

6.4.12.1.1 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（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
603105	芯能科技	2018-06-29	2018-07-09	新股未上市	4.83	4.83	3,410	16,470.30	16,470.30	
603693	江苏新能	2018-06-25	2018-07-03	新股未上市	9.00	9.00	5,384	48,456.00	48,456.00	
603706	东方环宇	2018-06-29	2018-07-09	新股未上市	13.09	13.09	1,765	23,103.85	23,103.85	

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。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额
600022	山东	2018-	重大资产重	2.02	2018-	1.83	1,026,	2,228,454.	2,073,388.

	钢铁	03-27	组		08-16		430	25	60
600086	东方金钰	2018-01-19	重大资产重组	10.04	—	—	75,474	798,746.35	757,758.96
600122	宏图高科	2018-06-19	拟筹划重大资产重组	7.40	—	—	138,372	1,322,002.42	1,023,952.80
600158	中体产业	2018-03-27	拟筹划重大资产重组	11.64	2018-07-16	11.61	105,542	1,520,272.32	1,228,508.88
600335	国机汽车	2018-04-03	重大资产重组	10.43	—	—	59,199	679,034.49	617,445.57
600687	刚泰控股	2018-06-11	重要事项未公告	9.09	2018-08-20	8.18	59,300	699,112.29	539,037.00
600750	江中药业	2018-05-02	重大资产重组	17.75	2018-08-01	16.12	36,007	728,481.84	639,124.25
600751	海航科技	2018-01-12	拟筹划重大资产重组	6.49	—	—	145,393	1,095,373.27	943,600.57
600759	洲际油气	2018-03-27	重大资产重组	3.94	—	—	179,225	994,721.54	706,146.50
600811	东方集团	2018-05-30	重要事项未公告	4.30	—	—	405,958	1,908,080.32	1,745,619.40
600848	上海临港	2018-06-15	拟筹划重大资产重组	21.67	—	—	44,700	1,032,047.63	968,649.00
000669	金鸿控股	2018-05-18	重大资产重组	7.25	2018-08-06	6.53	57,943	573,752.75	420,086.75
000693	*ST华泽	2018-05-02	未及时披露定期报告	1.36	—	—	49,788	1,135,492.48	67,711.68
000939	凯迪生态	2017-11-16	实行退市风险警示公告	4.99	2018-07-02	4.74	167,776	887,010.42	837,202.24
002005	德豪润达	2018-01-02	重大资产重组	4.36	2018-07-02	3.92	134,599	721,159.63	586,851.64
000008	神州高铁	2018-06-06	重大事项	4.96	2018-08-07	4.46	3,600	20,036.00	17,856.00
000426	兴业矿业	2018-06-19	重大事项	7.21	—	—	111,660	988,598.39	805,068.60
000566	海南海药	2017-11-22	重大资产重组	12.89	2018-07-09	11.60	93,384	1,229,901.16	1,203,719.76
000587	金洲慈航	2018-06-15	重大事项	4.96	2018-07-02	4.46	117,200	846,102.89	581,312.00
000825	太钢不锈	2018-04-16	重大资产重组	6.00	—	—	334,042	1,833,678.20	2,004,252.00
002011	盾安环境	2018-05-02	重大资产重组	6.40	—	—	78,930	665,815.07	505,152.00
002051	中工国际	2018-04-09	重大资产重组	15.27	—	—	81,512	1,496,973.13	1,244,688.24

002147	新光圆成	2018-01-18	重大资产重组	10.28	—	—	61,330	764,620.35	630,472.40
002359	北讯集团	2018-05-21	拟披露重大事项	19.58	2018-08-21	17.62	95,100	2,366,605.79	1,862,058.00
002408	齐翔腾达	2018-06-19	重大资产重组	12.28	—	—	131,598	1,633,087.20	1,616,023.44
002426	胜利精密	2018-06-19	拟披露重大事项	3.60	2018-07-03	3.26	316,300	1,309,330.18	1,138,680.00
002431	棕榈股份	2018-05-30	重大事项	6.71	—	—	148,325	1,281,940.03	995,260.75
002437	誉衡药业	2018-06-11	重大资产重组	6.20	2018-08-13	5.57	129,419	945,683.27	802,397.80
002477	雏鹰农牧	2018-06-14	重大事项	3.31	—	—	276,277	1,146,657.76	914,476.87
002512	达华智能	2018-06-19	拟披露重大事项	9.70	—	—	98,204	1,323,037.62	952,578.80
002573	清新环境	2018-06-19	拟披露重大事项	11.55	—	—	96,105	1,589,944.04	1,110,012.75
002665	首航节能	2018-05-29	重大资产重组	5.80	—	—	169,715	1,223,716.00	984,347.00
002699	美盛文化	2018-02-05	重大资产重组	18.76	2018-07-02	16.88	31,731	568,353.32	595,273.56
300146	汤臣倍健	2018-01-31	重大资产重组	15.41	2018-07-31	16.50	79,800	1,041,321.47	1,229,718.00
300197	铁汉生态	2018-05-28	重大资产重组	5.37	—	—	170,050	1,298,396.97	913,168.50
300266	兴源环境	2018-02-05	重大资产重组	19.99	2018-07-02	17.99	70,197	1,886,393.40	1,403,238.03
300324	旋极信息	2018-05-30	重大资产重组	9.49	—	—	119,265	1,341,899.30	1,131,824.85

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

6.4.12.3 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2018年6月30日，本基金未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

的债券。

6.4.13 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、内控合规部、风险管理部、审计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控制策略；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内控合规部负责，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；内控合规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2018年6月30日，本基金未持有债券(2017年12月31日：同)

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2018年6月30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。

6.4.13.3.1 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时间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公司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股票不得超过该上市公司可流通股股票的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股票，不得超过该上市公司可流通股股票的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6.4.12。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。

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

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 2018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	53,682,681.32	—	—	—	53,682,681.32
结算备付金	7,360,304.81	—	—	—	7,360,304.81
存出保证金	1,929,031.19	—	—	—	1,929,031.19
交易性金融资产	—	—	—	629,158,053.35	629,158,053.35
应收证券清算款	—	—	—	—	—
应收利息	—	—	—	30,854.17	30,854.17
应收申购款	—	—	—	5,108,018.58	5,108,018.58
资产总计	62,972,017.32	—	—	634,296,926.10	697,268,943.42
负债					
应付证券清算款	—	—	—	4,446,100.32	4,446,100.32
应付赎回款	—	—	—	4,160,774.72	4,160,774.72
应付管理人报酬	—	—	—	259,525.11	259,525.11
应付托管费	—	—	—	51,905.01	51,905.01

应付销售服务费	—	—	—	3,773.18	3,773.18
应付交易费用	—	—	—	280,171.95	280,171.95
其他负债	—	—	—	210,488.43	210,488.43
负债总计	—	—	—	9,412,738.72	9,412,738.72
利率敏感度缺口	62,972,017.32	—	—	624,884,187.38	687,856,204.70
上年度末 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	—	—	—	16,934,930.22	16,934,930.22
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

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2018年6月30日，本基金未持有交易性债券投资(2017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(2017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500指数，通过指数化分散投资降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2018年06月30日		上年度末 2017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	629,158,053.35	91.47	531,648,032.30	93.42
交易性金融资产—基金投资	—	—	—	—
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	629,158,053.35	91.47	531,648,032.30	93.42

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 2018年06月30日	上年度末 2017年12月31日
	业绩比较基准(附注6.4.1)上升5%	40,534,758.99	37,027,256.59
	业绩比较基准(附注6.4.1)下降5%	-40,534,758.99	-37,027,256.59

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2018年06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593,273,360.01元，属于第二层次的余额为35,816,981.66元，属于第三层次的余额为67,711.68元。（2017年12月31日：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）。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

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

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

上述第三层次资产变动如下：

	交易性金融资产 权益工具投资	合计
2018年1月1日	-	-
购买	-	-
出售	-	-
转入第三层级	622,350.00	622,350.00
当期利得或损失总额	-554,638.32	-554,638.32
计入损益的利得或损失	-554,638.32	-554,638.32
2018年6月30日	67,711.68	67,711.68
2018年6月30日仍持有的资产计入2018年度损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-554,638.32	-554,638.32

计入损益的利得或损失计入利润表中的公允价值变动收益等项目

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2018年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2017年12月31日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 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	629,158,053.35	90.23
	其中：股票	629,158,053.35	90.23
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	61,042,986.13	8.75
8	其他资产	7,067,903.94	1.01
9	合计	697,268,943.42	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

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	6,480,380.19	0.94
B	采矿业	21,496,792.52	3.13
C	制造业	372,216,922.38	54.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	18,311,649.05	2.66
E	建筑业	9,808,614.04	1.43
F	批发和零售业	33,212,662.73	4.83
G	交通运输、仓储和邮政业	22,049,699.36	3.21
H	住宿和餐饮业	3,411,280.40	0.50

I	信息传输、软件和信息技术服务业	55,030,831.46	8.00
J	金融业	15,121,524.56	2.20
K	房地产业	33,447,412.90	4.86
L	租赁和商务服务业	11,647,355.44	1.69
M	科学研究和技术服务业	1,069,912.26	0.16
N	水利、环境和公共设施管理业	4,523,337.21	0.66
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	418,879.40	0.06
Q	卫生和社会工作	1,379,365.60	0.20
R	文化、体育和娱乐业	12,388,013.75	1.80
S	综合	5,062,311.50	0.74
	合计	627,076,944.75	91.16

7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	67,711.68	0.01
C	制造业	603,321.94	0.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,328,848.84	0.19
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	—	—
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—
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	81,226.14	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	2,081,108.60	0.30

注：由于指数成份股调整，上表所列示股票中，*ST凯迪（证券代码：000939）、德豪润达（证券代码：002005）、金鸿控股（证券代码：000669）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	000661	长春高新	24,614	5,604,607.80	0.81
2	603019	中科曙光	79,904	3,665,196.48	0.53
3	600521	华海药业	136,250	3,636,512.50	0.53
4	600201	生物股份	207,631	3,548,413.79	0.52
5	600426	华鲁恒升	201,319	3,541,201.21	0.51
6	000830	鲁西化工	195,100	3,332,308.00	0.48
7	002049	紫光国微	75,400	3,326,648.00	0.48
8	002410	广联达	119,168	3,304,528.64	0.48
9	603589	口子窖	53,205	3,269,447.25	0.48
10	000977	浪潮信息	135,900	3,241,215.00	0.47
11	600256	广汇能源	783,090	3,202,838.10	0.47
12	600298	安琪酵母	87,701	3,129,171.68	0.45
13	000860	顺鑫农业	82,098	3,078,675.00	0.45
14	601233	桐昆股份	177,457	3,055,809.54	0.44
15	000703	恒逸石化	204,829	3,047,855.52	0.44
16	002038	双鹭药业	78,691	2,989,471.09	0.43
17	002340	格林美	474,144	2,868,571.20	0.42

18	600584	长电科技	168,891	2,861,013.54	0.42
19	600872	中炬高新	99,282	2,779,896.00	0.40
20	002179	中航光电	70,128	2,734,992.00	0.40
21	600673	东阳光科	263,300	2,719,889.00	0.40
22	600879	航天电子	386,100	2,714,283.00	0.39
23	000418	小天鹅A	39,137	2,714,150.95	0.39
24	600600	青岛啤酒	61,921	2,713,997.43	0.39
25	600760	中航沈飞	74,363	2,680,042.52	0.39
26	002078	太阳纸业	276,092	2,675,331.48	0.39
27	002589	瑞康医药	191,772	2,615,770.08	0.38
28	002129	中环股份	328,600	2,572,938.00	0.37
29	600525	长园集团	235,097	2,484,975.29	0.36
30	300253	卫宁健康	198,915	2,464,556.85	0.36
31	600642	申能股份	483,800	2,428,676.00	0.35
32	600004	白云机场	183,600	2,403,324.00	0.35
33	300383	光环新网	177,900	2,385,639.00	0.35
34	600885	宏发股份	79,367	2,374,660.64	0.35
35	600315	上海家化	59,697	2,365,792.11	0.34
36	600258	首旅酒店	86,920	2,361,616.40	0.34
37	002465	海格通信	291,500	2,340,745.00	0.34
38	600392	盛和资源	143,750	2,333,062.50	0.34
39	600325	华发股份	300,846	2,325,539.58	0.34
40	002439	启明星辰	108,600	2,304,492.00	0.34
41	000581	威孚高科	103,901	2,297,251.11	0.33
42	002176	江特电机	235,900	2,292,948.00	0.33
43	600260	凯乐科技	84,901	2,278,742.84	0.33
44	600079	人福医药	172,278	2,277,515.16	0.33
45	000656	金科股份	473,904	2,274,739.20	0.33
46	002268	卫士通	104,169	2,274,009.27	0.33
47	000513	丽珠集团	51,422	2,259,996.90	0.33
48	000066	中国长城	313,585	2,229,589.35	0.32

49	002092	中泰化学	228,543	2,203,154.52	0.32
50	600884	杉杉股份	99,570	2,200,497.00	0.32
51	002019	亿帆医药	122,000	2,153,300.00	0.31
52	000690	宝新能源	308,923	2,150,104.08	0.31
53	002223	鱼跃医疗	109,290	2,130,062.10	0.31
54	601168	西部矿业	337,800	2,121,384.00	0.31
55	000039	中集集团	157,032	2,085,384.96	0.30
56	600022	山东钢铁	1,026,430	2,073,388.60	0.30
57	600138	中青旅	102,864	2,050,079.52	0.30
58	002127	南极电商	217,900	2,046,081.00	0.30
59	300315	掌趣科技	489,100	2,044,438.00	0.30
60	000488	晨鸣纸业	158,038	2,041,850.96	0.30
61	603369	今世缘	89,000	2,031,870.00	0.30
62	002195	二三四五	472,890	2,023,969.20	0.29
63	600718	东软集团	154,500	2,017,770.00	0.29
64	600528	中铁工业	197,100	2,014,362.00	0.29
65	000825	太钢不锈	334,042	2,004,252.00	0.29
66	000636	风华高科	125,892	1,999,164.96	0.29
67	002353	杰瑞股份	122,300	1,987,375.00	0.29
68	000997	新大陆	125,690	1,979,617.50	0.29
69	000999	华润三九	71,100	1,978,713.00	0.29
70	002110	三钢闽光	121,900	1,954,057.00	0.28
71	600062	华润双鹤	79,079	1,941,389.45	0.28
72	002371	北方华创	39,050	1,939,613.50	0.28
73	002013	中航机电	256,206	1,939,479.42	0.28
74	300418	昆仑万维	102,406	1,933,425.28	0.28
75	300166	东方国信	130,517	1,922,515.41	0.28
76	600967	内蒙一机	150,000	1,911,000.00	0.28
77	600808	马钢股份	529,702	1,901,630.18	0.28
78	600643	爱建集团	201,620	1,895,228.00	0.28
79	000887	中鼎股份	131,446	1,894,136.86	0.28

80	300088	长信科技	326,400	1,893,120.00	0.28
81	600348	阳泉煤业	264,300	1,889,745.00	0.27
82	600839	四川长虹	655,600	1,875,016.00	0.27
83	000750	国海证券	524,000	1,870,680.00	0.27
84	000009	中国宝安	381,500	1,869,350.00	0.27
85	000528	柳 工	174,470	1,868,573.70	0.27
86	600060	海信电器	139,300	1,865,227.00	0.27
87	002359	北讯集团	95,100	1,862,058.00	0.27
88	002384	东山精密	76,103	1,826,472.00	0.27
89	000778	新兴铸管	425,000	1,819,000.00	0.26
90	000596	古井贡酒	20,350	1,806,673.00	0.26
91	000975	银泰资源	175,962	1,784,254.68	0.26
92	600160	巨化股份	243,321	1,781,109.72	0.26
93	000960	锡业股份	148,097	1,778,644.97	0.26
94	600056	中国医药	97,200	1,775,844.00	0.26
95	000681	视觉中国	61,551	1,766,513.70	0.26
96	000930	中粮生化	171,200	1,763,360.00	0.26
97	600143	金发科技	337,564	1,762,084.08	0.26
98	002183	怡 亚 通	263,300	1,750,945.00	0.25
99	600811	东方集团	405,958	1,745,619.40	0.25
100	600572	康恩贝	242,783	1,740,754.11	0.25
101	300182	捷成股份	228,600	1,732,788.00	0.25
102	600282	南钢股份	391,337	1,729,709.54	0.25
103	600183	生益科技	188,068	1,722,702.88	0.25
104	000732	泰禾集团	88,300	1,717,435.00	0.25
105	002221	东华能源	175,710	1,716,686.70	0.25
106	600410	华胜天成	195,780	1,713,075.00	0.25
107	600460	士兰微	139,860	1,706,292.00	0.25
108	002373	千方科技	130,202	1,699,136.10	0.25
109	600388	龙净环保	132,800	1,697,184.00	0.25
110	600380	健康元	142,900	1,694,794.00	0.25

111	600655	豫园股份	178,329	1,685,209.05	0.24
112	000729	燕京啤酒	250,200	1,683,846.00	0.24
113	600166	福田汽车	828,799	1,682,461.97	0.24
114	002506	协鑫集成	359,476	1,682,347.68	0.24
115	603816	顾家家居	22,800	1,676,028.00	0.24
116	600801	华新水泥	110,900	1,666,827.00	0.24
117	002745	木林森	92,700	1,649,133.00	0.24
118	600755	厦门国贸	225,636	1,644,886.44	0.24
119	002640	跨境通	108,700	1,632,674.00	0.24
120	600094	大名城	282,900	1,629,504.00	0.24
121	603077	和邦生物	940,500	1,627,065.00	0.24
122	300274	阳光电源	180,405	1,618,232.85	0.24
123	002408	齐翔腾达	131,598	1,616,023.44	0.23
124	601098	中南传媒	127,500	1,611,600.00	0.23
125	002407	多氟多	114,700	1,608,094.00	0.23
126	000686	东北证券	249,300	1,598,013.00	0.23
127	002028	思源电气	94,464	1,586,050.56	0.23
128	600895	张江高科	137,700	1,583,550.00	0.23
129	002273	水晶光电	122,582	1,577,630.34	0.23
130	600409	三友化工	183,000	1,575,630.00	0.23
131	002174	游族网络	79,100	1,574,090.00	0.23
132	600266	北京城建	166,900	1,568,860.00	0.23
133	002030	达安基因	101,619	1,566,964.98	0.23
134	300113	顺网科技	89,782	1,563,104.62	0.23
135	600291	西水股份	116,400	1,555,104.00	0.23
136	603899	晨光文具	48,900	1,549,641.00	0.23
137	000988	华工科技	107,101	1,547,609.45	0.22
138	600499	科达洁能	224,040	1,536,914.40	0.22
139	002603	以岭药业	109,900	1,536,402.00	0.22
140	600267	海正药业	105,600	1,535,424.00	0.22
141	600418	江淮汽车	235,241	1,531,418.91	0.22

142	600161	天坛生物	78,849	1,525,728.15	0.22
143	300010	立思辰	123,978	1,517,490.72	0.22
144	600875	东方电气	203,900	1,510,899.00	0.22
145	600787	中储股份	195,199	1,510,840.26	0.22
146	600511	国药股份	55,500	1,495,725.00	0.22
147	002670	国盛金控	138,128	1,487,638.56	0.22
148	300199	翰宇药业	104,173	1,487,590.44	0.22
149	002491	通鼎互联	134,370	1,487,475.90	0.22
150	000401	冀东水泥	167,381	1,484,669.47	0.22
151	600240	华业资本	202,301	1,482,866.33	0.22
152	603885	吉祥航空	95,800	1,476,278.00	0.21
153	002399	海普瑞	66,400	1,470,096.00	0.21
154	300287	飞利信	203,801	1,465,329.19	0.21
155	002281	光迅科技	68,906	1,460,807.20	0.21
156	600827	百联股份	142,400	1,452,480.00	0.21
157	000878	云南铜业	150,800	1,438,632.00	0.21
158	600978	宜华生活	210,590	1,438,329.70	0.21
159	000807	云铝股份	277,600	1,437,968.00	0.21
160	002244	滨江集团	276,200	1,436,240.00	0.21
161	002440	闰土股份	122,450	1,431,440.50	0.21
162	600729	重庆百货	43,300	1,426,735.00	0.21
163	000970	中科三环	151,200	1,413,720.00	0.21
164	600064	南京高科	192,310	1,411,555.40	0.21
165	300266	兴源环境	70,197	1,403,238.03	0.20
166	000089	深圳机场	182,000	1,392,300.00	0.20
167	000547	航天发展	177,630	1,387,290.30	0.20
168	300244	迪安诊断	72,560	1,379,365.60	0.20
169	000078	海王生物	285,950	1,375,419.50	0.20
170	600649	城投控股	224,500	1,373,940.00	0.20
171	600737	中粮糖业	181,800	1,370,772.00	0.20
172	002563	森马服饰	95,400	1,364,220.00	0.20

173	002299	圣农发展	88,000	1,363,120.00	0.20
174	002517	恺英网络	189,147	1,359,966.93	0.20
175	601872	招商轮船	376,300	1,358,443.00	0.20
176	600125	铁龙物流	162,000	1,355,940.00	0.20
177	600216	浙江医药	105,602	1,348,537.54	0.20
178	000028	国药一致	27,011	1,347,848.90	0.20
179	600270	外运发展	64,202	1,345,673.92	0.20
180	601966	玲珑轮胎	85,300	1,345,181.00	0.20
181	600179	安通控股	132,060	1,337,767.80	0.19
182	300133	华策影视	125,600	1,337,640.00	0.19
183	002583	海能达	159,400	1,330,990.00	0.19
184	300058	蓝色光标	232,800	1,326,960.00	0.19
185	002280	联络互动	231,900	1,326,468.00	0.19
186	002366	台海核电	92,324	1,316,540.24	0.19
187	600466	蓝光发展	211,860	1,313,532.00	0.19
188	000813	德展健康	159,200	1,311,808.00	0.19
189	002056	横店东磁	187,060	1,311,290.60	0.19
190	002128	露天煤业	143,330	1,298,569.80	0.19
191	600435	北方导航	158,544	1,293,719.04	0.19
192	000598	兴蓉环境	318,000	1,291,080.00	0.19
193	002368	太极股份	44,201	1,284,923.07	0.19
194	002004	华邦健康	252,790	1,284,173.20	0.19
195	600575	皖江物流	345,000	1,279,950.00	0.19
196	000553	沙隆达 A	80,900	1,279,029.00	0.19
197	600635	大众公用	343,497	1,277,808.84	0.19
198	600037	歌华有线	123,500	1,274,520.00	0.19
199	600277	亿利洁能	243,046	1,273,561.04	0.19
200	603658	安图生物	15,405	1,270,296.30	0.18
201	002152	广电运通	215,500	1,267,140.00	0.18
202	603883	老百姓	15,208	1,264,697.28	0.18
203	600500	中化国际	184,800	1,260,336.00	0.18

204	300257	开山股份	82,401	1,259,911.29	0.18
205	300115	长盈精密	96,891	1,256,676.27	0.18
206	000685	中山公用	157,042	1,251,624.74	0.18
207	002131	利欧股份	595,185	1,249,888.50	0.18
208	002600	领益智造	240,800	1,249,752.00	0.18
209	600970	中材国际	186,496	1,245,793.28	0.18
210	002051	中工国际	81,512	1,244,688.24	0.18
211	601179	中国西电	363,900	1,244,538.00	0.18
212	002358	森源电气	82,504	1,241,685.20	0.18
213	601000	唐山港	525,984	1,236,062.40	0.18
214	300055	万邦达	107,500	1,235,175.00	0.18
215	300146	汤臣倍健	79,800	1,229,718.00	0.18
216	600158	中体产业	105,542	1,228,508.88	0.18
217	600648	外高桥	66,300	1,211,964.00	0.18
218	000566	海南海药	93,384	1,203,719.76	0.17
219	000979	中弘股份	1,191,576	1,203,491.76	0.17
220	300026	红日药业	328,395	1,198,641.75	0.17
221	002191	劲嘉股份	159,201	1,189,231.47	0.17
222	601678	滨化股份	191,593	1,184,044.74	0.17
223	600563	法拉电子	23,903	1,182,959.47	0.17
224	600307	酒钢宏兴	558,500	1,172,850.00	0.17
225	600859	王府井	55,030	1,170,488.10	0.17
226	600863	内蒙华电	515,500	1,170,185.00	0.17
227	002709	天赐材料	30,100	1,160,054.00	0.17
228	600598	北大荒	126,300	1,156,908.00	0.17
229	600021	上海电力	171,100	1,153,214.00	0.17
230	600171	上海贝岭	99,243	1,149,233.94	0.17
231	002690	美亚光电	47,990	1,144,081.60	0.17
232	002701	奥瑞金	208,984	1,141,052.64	0.17
233	002426	胜利精密	316,300	1,138,680.00	0.17
234	002285	世联行	181,388	1,137,302.76	0.17

235	300324	旋极信息	119,265	1,131,824.85	0.16
236	600536	中国软件	52,217	1,129,453.71	0.16
237	601128	常熟银行	197,200	1,127,984.00	0.16
238	300159	新研股份	158,699	1,123,588.92	0.16
239	600717	天津港	148,600	1,118,958.00	0.16
240	002672	东江环保	85,450	1,118,540.50	0.16
241	000031	中粮地产	193,154	1,116,430.12	0.16
242	600823	世茂股份	266,300	1,113,134.00	0.16
243	600503	华丽家族	284,400	1,112,004.00	0.16
244	002573	清新环境	96,105	1,110,012.75	0.16
245	002390	信邦制药	151,550	1,109,346.00	0.16
246	000848	承德露露	104,310	1,104,642.90	0.16
247	600664	哈药股份	277,792	1,102,834.24	0.16
248	000758	中色股份	244,712	1,101,204.00	0.16
249	002317	众生药业	103,328	1,092,176.96	0.16
250	000738	航发控制	81,300	1,083,729.00	0.16
251	600835	上海机电	57,344	1,081,507.84	0.16
252	600582	天地科技	293,800	1,078,246.00	0.16
253	600881	亚泰集团	288,298	1,075,351.54	0.16
254	600614	鹏起科技	187,800	1,072,338.00	0.16
255	600597	光明乳业	108,600	1,071,882.00	0.16
256	002831	裕同科技	21,401	1,070,050.00	0.16
257	600645	中源协和	55,551	1,069,912.26	0.16
258	601880	大连港	546,503	1,060,215.82	0.15
259	000552	靖远煤电	322,681	1,055,166.87	0.15
260	600017	日照港	328,600	1,054,806.00	0.15
261	002266	浙富控股	280,944	1,053,540.00	0.15
262	600120	浙江东方	77,674	1,052,482.70	0.15
263	600039	四川路桥	320,477	1,051,164.56	0.15
264	002444	巨星科技	95,440	1,050,794.40	0.15
265	600754	锦江股份	28,400	1,049,664.00	0.15

266	000027	深圳能源	211,100	1,042,834.00	0.15
267	002505	大康农业	486,900	1,041,966.00	0.15
268	002180	纳思达	37,700	1,035,242.00	0.15
269	600594	益佰制药	115,103	1,031,322.88	0.15
270	600026	中远海能	242,834	1,029,616.16	0.15
271	600122	宏图高科	138,372	1,023,952.80	0.15
272	002332	仙琚制药	116,950	1,023,312.50	0.15
273	002155	湖南黄金	149,304	1,021,239.36	0.15
274	603766	隆鑫通用	187,500	1,018,125.00	0.15
275	300002	神州泰岳	243,800	1,016,646.00	0.15
276	002250	联化科技	115,000	1,014,300.00	0.15
277	300308	中际旭创	16,800	1,008,672.00	0.15
278	300001	特锐德	88,500	1,005,360.00	0.15
279	002400	省广集团	309,467	999,578.41	0.15
280	002431	棕榈股份	148,325	995,260.75	0.14
281	600623	华谊集团	99,700	995,006.00	0.14
282	000926	福星股份	137,900	991,501.00	0.14
283	000718	苏宁环球	269,300	988,331.00	0.14
284	600936	广西广电	207,600	988,176.00	0.14
285	601200	上海环境	62,300	986,209.00	0.14
286	002665	首航节能	169,715	984,347.00	0.14
287	000006	深振业A	167,693	982,680.98	0.14
288	600329	中新药业	51,642	981,198.00	0.14
289	000156	华数传媒	101,700	980,388.00	0.14
290	002839	张家港行	160,500	977,445.00	0.14
291	000012	南玻A	196,866	974,486.70	0.14
292	600557	康缘药业	78,520	969,722.00	0.14
293	600848	上海临港	44,700	968,649.00	0.14
294	002233	塔牌集团	84,600	967,824.00	0.14
295	000519	中兵红箭	124,547	967,730.19	0.14
296	000667	美好置业	454,300	967,659.00	0.14

297	002212	南洋股份	81,353	967,287.17	0.14
298	600908	无锡银行	164,000	965,960.00	0.14
299	002242	九阳股份	54,597	965,820.93	0.14
300	002118	紫鑫药业	134,704	963,133.60	0.14
301	603515	欧普照明	20,600	962,844.00	0.14
302	000937	冀中能源	232,959	957,461.49	0.14
303	600633	浙数文化	114,403	954,121.02	0.14
304	002512	达华智能	98,204	952,578.80	0.14
305	002916	深南电路	14,900	946,299.00	0.14
306	600751	海航科技	145,393	943,600.57	0.14
307	600098	广州发展	145,100	935,895.00	0.14
308	000563	陕国投 A	274,400	932,960.00	0.14
309	600993	马应龙	54,780	931,807.80	0.14
310	600478	科力远	182,650	931,515.00	0.14
311	002354	天神娱乐	99,765	923,823.90	0.13
312	601717	郑煤机	158,656	921,791.36	0.13
313	002477	雏鹰农牧	276,277	914,476.87	0.13
314	300197	铁汉生态	170,050	913,168.50	0.13
315	601001	大同煤业	183,406	909,693.76	0.13
316	000727	华东科技	482,400	906,912.00	0.13
317	002249	大洋电机	210,400	906,824.00	0.13
318	002635	安洁科技	52,442	902,002.40	0.13
319	600141	兴发集团	77,409	901,814.85	0.13
320	600195	中牧股份	45,774	890,304.30	0.13
321	000021	深科技	130,508	890,064.56	0.13
322	600280	中央商场	101,932	888,847.04	0.13
323	000612	焦作万方	169,245	888,536.25	0.13
324	300376	易事特	165,400	888,198.00	0.13
325	002022	科华生物	74,868	887,185.80	0.13
326	600395	盘江股份	145,200	881,364.00	0.13
327	002807	江阴银行	156,500	879,530.00	0.13

328	600580	卧龙电气	114,777	874,600.74	0.13
329	002707	众信旅游	90,500	868,800.00	0.13
330	002254	泰和新材	75,896	863,696.48	0.13
331	601311	骆驼股份	75,213	862,693.11	0.13
332	002064	华峰氨纶	208,300	860,279.00	0.13
333	002424	贵州百灵	75,282	855,203.52	0.12
334	600694	大商股份	26,037	846,462.87	0.12
335	300297	蓝盾股份	104,300	845,873.00	0.12
336	600416	湘电股份	117,500	844,825.00	0.12
337	601016	节能风电	294,000	843,780.00	0.12
338	002434	万里扬	95,800	841,124.00	0.12
339	000543	皖能电力	190,660	840,810.60	0.12
340	000501	鄂武商A	68,314	839,579.06	0.12
341	000400	许继电气	107,400	838,794.00	0.12
342	002002	鸿达兴业	181,212	835,387.32	0.12
343	002544	杰赛科技	60,800	832,352.00	0.12
344	601928	凤凰传媒	135,500	823,840.00	0.12
345	002048	宁波华翔	66,698	822,386.34	0.12
346	600770	综艺股份	138,375	816,412.50	0.12
347	000766	通化金马	68,700	816,156.00	0.12
348	603000	人民网	98,200	815,060.00	0.12
349	600312	平高电气	144,459	814,748.76	0.12
350	002277	友阿股份	176,006	811,387.66	0.12
351	002308	威创股份	97,269	807,332.70	0.12
352	000158	常山北明	117,340	806,125.80	0.12
353	601801	皖新传媒	105,900	805,899.00	0.12
354	000426	兴业矿业	111,660	805,068.60	0.12
355	601608	中信重工	309,300	804,180.00	0.12
356	002437	誉衡药业	129,419	802,397.80	0.12
357	600545	卓郎智能	100,900	801,146.00	0.12
358	600108	亚盛集团	276,500	799,085.00	0.12

359	000712	锦龙股份	79,500	793,410.00	0.12
360	600777	新潮能源	362,100	792,999.00	0.12
361	000090	天健集团	127,572	790,946.40	0.11
362	600259	广晟有色	26,762	783,591.36	0.11
363	603198	迎驾贡酒	42,517	781,037.29	0.11
364	600971	恒源煤电	109,289	780,323.46	0.11
365	000592	平潭发展	274,338	779,119.92	0.11
366	600317	营口港	344,700	779,022.00	0.11
367	002463	沪电股份	208,138	778,436.12	0.11
368	002503	搜于特	221,800	776,300.00	0.11
369	600073	上海梅林	116,618	774,343.52	0.11
370	600422	昆药集团	99,902	774,240.50	0.11
371	600611	大众交通	194,300	773,314.00	0.11
372	002509	天广中茂	265,400	772,314.00	0.11
373	000980	众泰汽车	108,600	772,146.00	0.11
374	002073	软控股份	132,840	763,830.00	0.11
375	600565	迪马股份	257,800	760,510.00	0.11
376	600366	宁波韵升	124,484	759,352.40	0.11
377	002657	中科金财	47,902	758,767.68	0.11
378	600086	东方金钰	75,474	757,758.96	0.11
379	000877	天山股份	111,700	753,975.00	0.11
380	000062	深圳华强	38,421	753,051.60	0.11
381	601689	拓普集团	38,700	752,328.00	0.11
382	600578	京能电力	239,495	747,224.40	0.11
383	600169	太原重工	317,172	742,182.48	0.11
384	600869	智慧能源	157,200	741,984.00	0.11
385	603659	璞泰来	11,600	741,124.00	0.11
386	002302	西部建设	67,500	726,975.00	0.11
387	600151	航天机电	178,700	725,522.00	0.11
388	603188	亚邦股份	70,894	723,118.80	0.11
389	600874	创业环保	77,302	722,000.68	0.10

390	600338	西藏珠峰	34,715	719,294.80	0.10
391	600765	中航重机	96,618	718,837.92	0.10
392	603228	景旺电子	14,500	716,880.00	0.10
393	002428	云南锗业	92,784	716,292.48	0.10
394	000762	西藏矿业	73,925	711,897.75	0.10
395	002815	崇达技术	44,200	711,620.00	0.10
396	600316	洪都航空	76,301	711,125.32	0.10
397	000600	建投能源	127,200	708,504.00	0.10
398	600759	洲际油气	179,225	706,146.50	0.10
399	002489	浙江永强	193,040	702,665.60	0.10
400	000572	海马汽车	204,300	700,749.00	0.10
401	002251	步步高	61,345	698,106.10	0.10
402	002345	潮宏基	80,306	690,631.60	0.10
403	000829	天音控股	94,203	690,507.99	0.10
404	603444	吉比特	5,400	690,066.00	0.10
405	002093	国脉科技	89,329	688,726.59	0.10
406	000541	佛山照明	114,773	687,490.27	0.10
407	000969	安泰科技	109,284	683,025.00	0.10
408	002681	奋达科技	78,760	682,061.60	0.10
409	300273	和佳股份	100,414	680,806.92	0.10
410	600300	维维股份	207,698	677,095.48	0.10
411	300039	上海凯宝	116,715	676,947.00	0.10
412	000536	华映科技	245,500	675,125.00	0.10
413	600187	国中水务	234,800	666,832.00	0.10
414	600155	华创阳安	92,600	665,794.00	0.10
415	600393	粤泰股份	180,000	651,600.00	0.09
416	002482	广田集团	109,100	651,327.00	0.09
417	000061	农产品	120,500	650,700.00	0.09
418	002642	荣之联	70,435	647,297.65	0.09
419	002276	万马股份	110,202	643,579.68	0.09
420	603556	海兴电力	35,240	640,310.80	0.09

421	600750	江中药业	36,007	639,124.25	0.09
422	002375	亚厦股份	119,000	635,460.00	0.09
423	600058	五矿发展	76,072	632,158.32	0.09
424	002147	新光圆成	61,330	630,472.40	0.09
425	002818	富森美	23,798	627,791.24	0.09
426	000990	诚志股份	44,400	621,600.00	0.09
427	603888	新华网	36,800	620,448.00	0.09
428	002841	视源股份	11,600	619,556.00	0.09
429	600335	国机汽车	59,199	617,445.57	0.09
430	603568	伟明环保	24,391	617,092.30	0.09
431	000049	德赛电池	21,841	616,353.02	0.09
432	600757	长江传媒	107,630	612,414.70	0.09
433	601777	力帆股份	116,203	607,741.69	0.09
434	600773	西藏城投	87,121	602,877.32	0.09
435	001696	宗申动力	121,952	597,564.80	0.09
436	002414	高德红外	44,319	595,647.36	0.09
437	002699	美盛文化	31,731	595,273.56	0.09
438	002920	德赛西威	19,500	583,050.00	0.08
439	000587	金洲慈航	117,200	581,312.00	0.08
440	600006	东风汽车	141,998	580,771.82	0.08
441	603328	依顿电子	53,204	577,263.40	0.08
442	600657	信达地产	135,300	575,025.00	0.08
443	600640	号百控股	56,479	574,391.43	0.08
444	002663	普邦股份	191,223	567,932.31	0.08
445	600639	浦东金桥	45,271	564,982.08	0.08
446	300134	大富科技	62,290	556,872.60	0.08
447	601127	小康股份	32,200	556,738.00	0.08
448	002344	海宁皮城	113,776	552,951.36	0.08
449	002261	拓维信息	118,238	543,894.80	0.08
450	002190	成飞集成	31,803	543,513.27	0.08
451	600428	中远海特	152,400	541,020.00	0.08

452	600687	刚泰控股	59,300	539,037.00	0.08
453	002588	史丹利	102,600	531,468.00	0.08
454	600458	时代新材	71,441	525,805.76	0.08
455	603056	德邦股份	18,700	512,193.00	0.07
456	300202	聚龙股份	48,798	508,963.14	0.07
457	300291	华录百纳	72,101	508,312.05	0.07
458	000806	银河生物	117,100	507,043.00	0.07
459	002011	盾安环境	78,930	505,152.00	0.07
460	300156	神雾环保	74,900	499,583.00	0.07
461	600748	上实发展	98,210	494,978.40	0.07
462	600350	山东高速	119,500	483,975.00	0.07
463	600651	飞乐音响	123,128	480,199.20	0.07
464	300032	金龙机电	85,500	479,655.00	0.07
465	600939	重庆建工	96,700	477,698.00	0.07
466	300116	坚瑞沃能	172,700	476,652.00	0.07
467	600862	中航高科	74,100	455,715.00	0.07
468	002342	巨力索具	119,211	451,809.69	0.07
469	002479	富春环保	79,300	448,045.00	0.07
470	600184	光电股份	36,063	446,820.57	0.06
471	600517	置信电气	120,360	445,332.00	0.06
472	600481	双良节能	144,796	443,075.76	0.06
473	300043	星辉娱乐	110,400	441,600.00	0.06
474	600743	华远地产	166,550	428,033.50	0.06
475	603355	莱克电气	14,212	427,070.60	0.06
476	002041	登海种业	62,420	425,704.40	0.06
477	603377	东方时尚	30,244	418,879.40	0.06
478	603868	飞科电器	8,603	416,127.11	0.06
479	600126	杭钢股份	69,100	412,527.00	0.06
480	600996	贵广网络	55,500	411,810.00	0.06
481	603806	福斯特	18,617	409,760.17	0.06
482	600167	联美控股	40,700	407,000.00	0.06

483	600292	远达环保	69,299	406,785.13	0.06
484	600053	九鼎投资	23,007	395,030.19	0.06
485	603225	新凤鸣	19,400	387,418.00	0.06
486	601020	华钰矿业	28,081	387,236.99	0.06
487	002416	爱施德	65,920	386,950.40	0.06
488	601019	山东出版	48,200	386,082.00	0.06
489	601969	海南矿业	69,400	380,312.00	0.06
490	603169	兰石重装	74,601	373,751.01	0.05
491	000987	越秀金控	47,300	371,778.00	0.05
492	603877	太平鸟	10,302	343,365.66	0.05
493	600618	氯碱化工	39,900	339,549.00	0.05
494	000761	本钢板材	80,174	323,902.96	0.05
495	000025	特力A	9,640	310,118.80	0.05
496	601811	新华文轩	28,101	273,141.72	0.04
497	603025	大豪科技	12,388	239,583.92	0.03
498	600917	重庆燃气	33,191	226,030.71	0.03
499	603569	长久物流	13,941	199,077.48	0.03
500	000008	神州高铁	3,600	17,856.00	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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	000939	*ST凯迪	167,776	837,202.24	0.12
2	002005	德豪润达	134,599	586,851.64	0.09
3	000669	金鸿控股	57,943	420,086.75	0.06
4	601330	绿色动力	4,971	81,226.14	0.01
5	000693	*ST华泽	49,788	67,711.68	0.01
6	603693	江苏新能	5,384	48,456.00	0.01
7	603706	东方环宇	1,765	23,103.85	0.00
8	603105	芯能科技	3,410	16,470.30	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	000661	长春高新	4,595,915.00	0.81
2	600201	生物股份	3,973,880.72	0.70
3	600176	中国巨石	3,945,656.84	0.69
4	600516	方大炭素	3,598,156.92	0.63
5	603019	中科曙光	3,503,206.00	0.62
6	600426	华鲁恒升	3,489,549.00	0.61
7	000830	鲁西化工	3,462,417.60	0.61
8	002049	紫光国微	3,435,611.00	0.60
9	600521	华海药业	3,426,525.40	0.60
10	600525	长园集团	3,361,558.54	0.59
11	600584	长电科技	3,191,264.44	0.56
12	000786	北新建材	3,189,438.00	0.56
13	002129	中环股份	3,108,653.00	0.55
14	002340	格林美	3,105,039.00	0.55
15	002410	广联达	2,981,491.00	0.52
16	600256	广汇能源	2,892,469.96	0.51
17	600298	安琪酵母	2,889,131.70	0.51
18	002422	科伦药业	2,884,371.00	0.51
19	002078	太阳纸业	2,876,754.90	0.51
20	601233	桐昆股份	2,852,456.20	0.50

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	600516	方大炭素	7,248,896.31	1.27
2	600176	中国巨石	7,093,748.80	1.25
3	002422	科伦药业	6,660,011.02	1.17
4	002405	四维图新	5,784,534.00	1.02
5	000786	北新建材	5,624,401.28	0.99
6	002271	东方雨虹	4,828,233.14	0.85
7	002001	新 和 成	4,084,456.81	0.72
8	000998	隆平高科	4,065,890.48	0.71
9	600346	恒力股份	3,908,054.98	0.69
10	002050	三花智控	3,899,683.16	0.69
11	002311	海大集团	3,591,901.78	0.63
12	600438	通威股份	3,558,838.00	0.63
13	000050	深天马 A	3,296,583.92	0.58
14	000661	长春高新	3,217,593.00	0.57
15	601699	潞安环能	2,938,143.40	0.52
16	600201	生物股份	2,891,974.83	0.51
17	600566	济川药业	2,884,741.32	0.51
18	600315	上海家化	2,783,064.69	0.49
19	000981	银亿股份	2,611,470.01	0.46
20	002410	广联达	2,593,263.71	0.46

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

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	714,026,904.82
卖出股票收入（成交）总额	518,119,222.57

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

7.10.1 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 (买/卖)	合约市值 (元)	公允价值 变动(元)	风险说明
IC1809	中证500 期货 1809合 约	6	6,135,120.00	-399,880.00	本基金组合中持有少量的基准指数的股指期货多头合约，主要原因是基金流动性新规在2017年10月1日起执行，期货保证金将不再属于现金部分，而本基金经常遇到来自代销渠道大额资金的申购，而这个申购资金在次交易日是不可用的，为了降低跟踪风险，需要进行股指期货交易，即在次交易日用部分可用资金买入基准指数的股指期货多头合约进行部分仓位套保。本基金进行股指期货交易的目的是不是投机或收益增强，完全是为了降低跟踪偏离而进

					行的部分仓位的套保功能,并且股票仓位+期货仓位严格遵守基金合同要求和公司风控规定,不会对基金产生额外风险。
公允价值变动总额合计(元)					-399,880.00
股指期货投资本期收益(元)					-1,862,160.00
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-424,680.00

7.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本指数基金的股指期货买入套保主要为应对基金组合申购的资金未到位造成基金组合的股票仓位过低的风险,股指期货在买入时总持仓量采用双限制策略,一是限制基金组合中总的股指期货持仓量不能超过向中金所申请并获批的套保总量;二是限制基金组合持有的股指期货合约价值加上基金组合中其他有价证券市值占基金净资产的比例不能超过法规规定的上限。并在股指期货的交易过程中严格遵守基金合同的约束和中金所的规定。根据本基金的基金合同、投资范围、投资目标、投资策略以及对市场走势研判的基础上,结合基金日常的申购赎回情况,制定套期保值交易的合理期限。套期保值的期限一般不超过股指期货当前的最远到期日合约,即次季合约。按照交易月份相近的原则,综合考虑并动态跟踪不同到期日的期货合约的流动性、价差状况和展期风险等因素,选择合适月份的期货合约进行开仓和展期交易来实现远期套保的目的。另外对于交割月的股指期货,通常情况下,最晚在合约交割日进行平仓,尽量避免进行交割。在未来的股指期货交易过程中,本基金将严格遵守《证券投资基金参与股指期货交易指引》,以及中国金融期货交易所颁布的《中国金融期货交易所交易规则》、《中国金融期货交易所套期保值与套利交易管理办法》等相关规定,以套期保值为主要目的参与股指期货,严格控制交易中的各种风险。

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 本报告期投资基金情况

本基金本报告期末未持有基金。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 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。

7.13.2 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。

7.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,929,031.19
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	30,854.17
5	应收申购款	5,108,018.58
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	7,067,903.94

7.13.4 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。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.13.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限情况。

7.13.5.2 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	000939	*ST凯迪	837,202.24	0.12	实行退市风险警示公告
2	002005	德豪润达	586,851.64	0.09	重大资产重组
3	000669	金鸿控股	420,086.75	0.06	重大资产重组
4	000693	*ST华泽	67,711.68	0.01	未及时披露定期报告

7.13.6 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。

§ 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500A	343,994	2,199.27	58,457,851.05	7.73%	698,076,227.60	92.27%
天弘中证500C	4,513	7,633.96	9,952,413.63	28.89%	24,499,638.10	71.11%
合计	348,507	2,269.64	68,410,264.68	8.65%	722,575,865.70	91.35%

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、B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500A	1,550,141.22	0.20%
	天弘中证500C	43,860.15	0.13%
	合计	1,594,001.37	0.20%

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）。

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）

本公司高级管理人员、基金投资和研 究部门负责人持有本开放式基金	天弘中证500A	>100
	天弘中证500C	—
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	天弘中证500A	—
	天弘中证500C	—
	合计	—

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

本基金成立后有10,000,000.00份为发起份额，发起份额承诺的持有期限为2015年1月20日至2018年01月20日。截至本报告期末，发起资金持有份额为0份。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	天弘中证500A	天弘中证500C
基金合同生效日(2015年01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	556,594,702.48	—
本报告期基金总申购份额	1,285,446,651.21	42,048,664.86
减：本报告期基金总赎回份额	1,085,507,275.04	7,596,613.13
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	756,534,078.65	34,452,051.73

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

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

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 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。

10.6 基金改聘会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生改变。

10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况

本报告期内本基金管理人、托管人及其高级管理人员没有发生受稽查或处罚的情况。

10.8 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

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	
东方财富证券	2	280,930,648.22	22.85%	121,166.82	23.93%	
广发证券	1	74,401,094.23	6.05%	32,089.75	6.34%	
国泰君安证券	2	119,567,927.76	9.72%	27,657.16	5.46%	
海通证券	1	375,918,282.59	30.57%	162,137.85	32.02%	
中泰证券	1	378,741,839.98	30.80%	163,354.56	32.26%	
光大证券	1	—	—	—	—	

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：6个，其中包括东方财富证券上海交易单元1个，东方财富证券深圳交易单元1个，中泰证券上海交易单元1个，广发证券深圳交易单元1个，光大证券深圳交易单元

1个，海通证券深圳交易单元1个。

4、本基金报告期内停止租用交易单元：无。

10.9 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	天弘中证500指数型发起式证券投资基金2017年第4季度报告	中国证监会指定媒介	2018-01-19
2	天弘基金管理有限公司关于设立深圳分公司的公告	中国证监会指定媒介	2018-02-02
3	天弘基金管理有限公司关于在上海利得基金销售有限公司开通定投及转换业务以及参加其相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2018-02-06
4	天弘基金管理有限公司关于增聘天弘中证500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	2018-02-12
5	天弘基金管理有限公司关于增加嘉实财富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	2018-03-02
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	2018-03-05
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	2018-03-05
8	天弘基金管理有限公司关于旗下部分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	2018-03-13
9	天弘基金管理有限公司关于增加恒天明泽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相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2018-03-15
10	天弘基金管理有限公司关于调整旗下	中国证监会指定媒介	2018-03-24

	部分公开募集开放式证券投资基金赎回费的公告		
11	天弘中证500指数型发起式证券投资基金2017年年度报告摘要	中国证监会指定媒介	2018-03-29
12	天弘中证500指数型发起式证券投资基金2017年年度报告	中国证监会指定媒介	2018-03-29
13	天弘基金管理有限公司关于天弘中证500指数型发起式证券投资基金修订基金合同部分条款的公告	中国证监会指定媒介	2018-03-30
14	天弘中证500指数型发起式证券投资基金托管协议	中国证监会指定媒介	2018-03-30
15	天弘中证500指数型发起式证券投资基金基金合同	中国证监会指定媒介	2018-03-30
16	天弘基金管理有限公司关于增加深圳盈信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相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2018-03-31
17	天弘基金管理有限公司关于增加通华财富(上海)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费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2018-03-31
18	天弘基金管理有限公司关于增加大泰金石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费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2018-03-31
19	天弘基金管理有限公司关于增加北京展恒基金销售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费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2018-03-31

20	天弘基金管理有限公司关于设立四川分公司的公告	中国证监会指定媒介	2018-04-03
21	天弘中证500指数型发起式证券投资基金2018年第1季度报告	中国证监会指定媒介	2018-04-23
22	天弘基金管理有限公司关于天弘中证500指数型发起式证券投资基金之C类基金份额开放日常申购、赎回、定期定额投资及转换业务的公告	中国证监会指定媒介	2018-04-24
23	关于天弘中证500指数型发起式证券投资基金增设C类基金份额并相应修订基金合同部分条款的公告	中国证监会指定媒介	2018-04-24
24	天弘中证500指数型发起式证券投资基金基金合同	中国证监会指定媒介	2018-04-24
25	天弘中证500指数型发起式证券投资基金托管协议	中国证监会指定媒介	2018-04-24
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、定投及转换业务的公告	中国证监会指定媒介	2018-04-26
27	天弘基金管理有限公司关于天弘沪深300C、天弘中证500C增加销售机构并开通申购、赎回、定投及转换业务的公告	中国证监会指定媒介	2018-05-09
28	天弘基金管理有限公司关于增加和耕传承基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回业务以及参加其费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2018-05-12
29	天弘基金管理有限公司关于天弘沪深300C、天弘中证500C增加销售机构并开通申购、赎回、定投及转换业务的公告	中国证监会指定媒介	2018-05-12
30	天弘基金管理有限公司关于对旗下基金在网上交易系统的指定支付渠道开	中国证监会指定媒介	2018-05-15

	展申购费率优惠活动的公告		
31	天弘基金管理有限公司关于在天弘爱理财APP开展“弘钱包”账户交易费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2018-05-24
32	天弘基金管理有限公司关于增加上海基煜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费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2018-06-08
33	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金在国泰君安证券股份有限公司开通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	2018-06-23
34	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会指定媒介	2018-06-26
35	天弘基金管理有限公司旗下基金2018年6月29日基金资产净值公告	中国证监会指定媒介	2018-06-29
36	天弘基金管理有限公司旗下基金2018年6月30日基金资产净值公告	中国证监会指定媒介	2018-06-30

§ 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

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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金增设C类基金份额并相应修订基金合同部分条款，具体信息请参见基金管理人于2018年4月24日在指定媒介披露的《关于天弘中证500指数型发起式证券投资基金增设C类基金份额并相应修订基金合同部分条款的公告》及相应更新后的基金法律文件。

§ 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

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

天弘基金管理有限公司
二〇一八年八月二十七日