

天弘中证 800 指数型发起式证券投资基金

2019 年半年度报告

2019 年 06 月 30 日

基金管理人:天弘基金管理有限公司

基金托管人:广发证券股份有限公司

送出日期:2019 年 08 月 24 日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人广发证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年08月21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2019年01月01日起至2019年06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	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	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合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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	20
§7 投资组合报告	42
7.1 期末基金资产组合情况	42
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	71
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	73
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	73
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	73
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	73
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	73
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	74
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	74
7.12 投资组合报告附注	74
§8 基金份额持有人信息	75
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	75
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	75

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.....	76
8.4	发起式基金发起资金持有份额情况.....	76
§9	开放式基金份额变动.....	76
§10	重大事件揭示.....	77
10.1	基金份额持有人大会决议.....	77
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.....	77
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	77
10.4	基金投资策略的改变.....	77
10.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	77
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	77
10.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	78
10.8	其他重大事件.....	79
§11	影响投资者决策的其他重要信息.....	82
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.....	82
11.2	影响投资者决策的其他重要信息.....	82
§12	备查文件目录.....	82
12.1	备查文件目录.....	83
12.2	存放地点.....	83
12.3	查阅方式.....	83

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	天弘中证800指数型发起式证券投资基金	
基金简称	天弘中证800	
基金主代码	001588	
基金运作方式	契约型开放式、发起式	
基金合同生效日	2015年07月16日	
基金管理人	天弘基金管理有限公司	
基金托管人	广发证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	83,611,609.70份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	天弘中证800A	天弘中证800C
下属分级基金的交易代码	001588	001589
报告期末下属分级基金的份额总额	52,331,843.79份	31,279,765.91份

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数，追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化，实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。
投资策略	本基金采用完全复制标的指数的方法，进行被动指数化投资。股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合复制标的指数，并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整，以复制和跟踪标的指数。本基金在严格控制基金的日均跟踪偏离度和年跟踪误差的前提下，力争获取与标的指数相似的投资收益。
业绩比较基准	中证800指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		天弘基金管理有限公司	广发证券股份有限公司
信息披露 负责人	姓名	童建林	崔瑞娟
	联系电话	022-83310208	020-66338888
	电子邮箱	service@thfund.com.cn	cuirj@gf.com.cn
客户服务电话		95046	95575
传真		022-83865569	020-87555129
注册地址		天津自贸区(中心商务区)响螺湾旷世国际大厦A座1704-241号	广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街2号618室
办公地址		天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层	广州市天河区马场路26号广发证券大厦34楼
邮政编码		300203	510627
法定代表人		井贤栋	孙树明

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
登载基金半年度报告正文的基金管理人互联网网址	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

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2019年01月01日-2019年06月30日)	
	天弘中证800A	天弘中证800C
本期已实现收益	-2,090,137.76	-1,945,842.54
本期利润	9,014,701.52	5,664,519.60
加权平均基金份额本期利润	0.1760	0.1880
本期加权平均净值利润率	20.50%	22.23%
本期基金份额净值增长率	26.82%	26.71%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年06月30日)	
期末可供分配利润	-4,817,234.29	-3,144,609.83
期末可供分配基金份额利润	-0.0921	-0.1005
期末基金资产净值	47,514,609.50	28,135,156.08
期末基金份额净值	0.9079	0.8995
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	-9.21%	-10.05%

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

天弘中证800A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	4.78%	1.13%	4.08%	1.13%	0.70%	0.00%
过去三个月	-1.52%	1.49%	-3.38%	1.49%	1.86%	0.00%
过去六个月	26.82%	1.48%	23.75%	1.49%	3.07%	-0.01%
过去一年	9.68%	1.44%	5.28%	1.46%	4.40%	-0.02%

过去三年	18.90%	1.06%	8.74%	1.06%	10.16%	0.00%
自基金合同生效起至今	-9.21%	1.40%	-11.34%	1.41%	2.13%	-0.01%

天弘中证800C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	4.78%	1.13%	4.08%	1.13%	0.70%	0.00%
过去三个月	-1.56%	1.48%	-3.38%	1.49%	1.82%	-0.01%
过去六个月	26.71%	1.48%	23.75%	1.49%	2.96%	-0.01%
过去一年	9.48%	1.44%	5.28%	1.46%	4.20%	-0.02%
过去三年	18.09%	1.06%	8.74%	1.06%	9.35%	0.00%
自基金合同生效起至今	-10.05%	1.40%	-11.34%	1.41%	1.29%	-0.01%

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

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

天弘中证800A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2015年07月16日-2019年06月30日)



天弘中证800C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2015年07月16日-2019年06月30日)



注：1、本基金合同于 2015 年 07 月 16 日生效。
2、本报告期内，本基金的各项投资比例达到基金合同约定的各项比例要求。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

天弘基金管理有限公司（以下简称“公司”或“本基金管理人”）经中国证监会证监基金字[2004]164号文批准，于2004年11月8日正式成立。注册资本金为5.143亿元人民币，总部设在天津，在北京、上海、广州、天津、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2019年6月30日，本基金管理人共管理49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、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、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、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、天弘上证50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、天弘中证电子指数型发起式证券投资基金、天弘中证计算机主题指数型发起式证券投资基金（原“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、天弘价值精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、天弘信利债券型证券投资基金、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、天弘穗利一年定期开放债券型证券投资基金、天弘弘丰增强回报债券型证券投资基金、天弘港股通精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、天弘增强回报债券型证券投资基金、天弘安益债券型证券投资基金、天弘华享三个月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		
张子法	本基金基金经理。	2017年04月	-	17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02月	-	8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、基金经理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遵规守信情况的说明

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

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

本报告期内，本基金运作合法合规，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

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

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，本基金秉承合规第一、风控第一的原则，坚持既定的指数化投资策略，力争投资回报与所跟踪指数保持一致，积极应对基金申购赎回等因素对指数跟踪效果的影响，努力为投资者提供一个良好的指数投资工具。

报告期内，本基金跟踪误差的来源主要是申购赎回、成分股权重调整与成分股停牌因素。当由于申赎变动、指数成分股权重调整、成分股停牌等情况可能对指数跟踪效果带来影响时，本基金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。报告期内，本基金整体运行平稳。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2019年06月30日，天弘中证800A基金份额净值为0.9079元，天弘中证800C基金份额净值为0.8995元。报告期内份额净值增长率天弘中证800A为26.82%，天弘中证800C为26.71%，同期业绩比较基准增长率均为23.75%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2季度的宏观经济形势出现了一些不确定性的因素。特别是外需加入了更多的不确定性，包商银行被接管也在短期对流动性带来了扰动。从数据上来看，工业增加值当月同比增速在5月下降到5.0%，制造业投资累计同比增速在4月仅有2.5%，PMI在5-6月连续两月为49.4，低于荣枯线。这些数据反映出相对较弱的经济活动。在这样的时间点往后看，经济能否企稳可能仍然是未来一段时间的核心矛盾。

目前，经济中的一部分会逐渐出现一些让经济企稳的迹象，包括基建投资、房地产投资、汽车消费等；下半年的不确定性，一方面来自对房地产融资的收紧，另一方面来自外需；通胀的压力在3季度明显减轻，PPI可能会同比负增长；社融、M2等指标整体来说依然是逐步改善的。政策努力做到在稳增长和防风险中的平衡，根据国内外经济形势的变化，及时预调微调。整体来看，经济处在一个“信用修复改善，但经济改善存在波折”的状态，我们判断经济大概率可以企稳。

在这种状态下，股票市场可能不会大跌，但要出现明显趋势性反弹，还需要盈利层面的支撑。目前企业盈利增速虽下行压力有限，但也很难马上大幅上行。A股上市公司盈利在经历了2018年年报大幅计提减值损失带来的低点之后，在2019年1季度净利润同比增速出现较明显的改善，我们更倾向于认为2019年下半年盈利增速数据会因为成本端改善以及前期的低基数影响出现回升，后续仍需持续关注需求端真实的景气复苏情况以及企业盈利能力是否改善。

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订与估值相关的定价服务协议。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内本基金管理人无应说明预警信息。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对天弘基金管理有限公司编制和披露的天弘中证800指数型发起式证券投资基金2019年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：天弘中证800指数型发起式证券投资基金

报告截止日：2019年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2019年06月30日	上年度末 2018年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	4,975,158.14	6,488,078.49
结算备付金		30,008.69	46,777.53
存出保证金		39,432.32	157,491.85
交易性金融资产	6.4.7.2	71,073,461.05	78,949,093.98
其中：股票投资		71,073,461.05	78,949,093.98
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		-	-
应收利息	6.4.7.5	1,047.77	1,605.17
应收股利		-	-
应收申购款		252,937.36	982,877.35
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		76,372,045.33	86,625,924.37
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019年06月30日	上年度末 2018年12月31日
负债：			
短期借款		-	-

交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	1,158,133.35
应付赎回款		583,948.77	77,399.55
应付管理人报酬		30,266.74	35,249.39
应付托管费		6,053.37	7,049.86
应付销售服务费		4,541.69	4,340.31
应付交易费用	6.4.7.7	10,000.10	14,303.34
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	87,469.08	168,004.05
负债合计		722,279.75	1,464,479.85
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	83,611,609.70	119,300,943.29
未分配利润	6.4.7.10	-7,961,844.12	-34,139,498.77
所有者权益合计		75,649,765.58	85,161,444.52
负债和所有者权益总计		76,372,045.33	86,625,924.37

注：报告截止日2019年06月30日，天弘中证800指数型发起式证券投资基金A类基金份额净值0.9079元，天弘中证800指数型发起式证券投资基金C类基金份额净值0.8995元；基金份额总额83,611,609.70份，其中天弘中证800指数型发起式证券投资基金A类基金份额52,331,843.79份，天弘中证800指数型发起式证券投资基金C类基金份额31,279,765.91份。

6.2 利润表

会计主体：天弘中证800指数型发起式证券投资基金

本报告期：2019年01月01日至2019年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2019年01月01	上年度可比期间
----	-----	--------------	---------

		日 至2019年06月3 0日	2018年01月01日至201 8年06月30日
一、收入		15,078,529.73	-15,899,140.72
1. 利息收入		16,687.40	36,006.32
其中：存款利息收入	6.4.7.11	16,687.40	36,006.32
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）		-3,666,104.65	2,032,424.99
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-4,354,902.06	939,942.21
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资 收益	6.4.7.13. 2	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	688,797.41	1,092,482.78
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.17	18,715,201.42	-17,974,581.19
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	12,745.56	7,009.16
减：二、费用		399,308.61	750,335.49
1. 管理人报酬	6.4.10.2. 1	171,498.77	347,777.12
2. 托管费	6.4.10.2. 2	34,299.74	69,555.42

3. 销售服务费	6.4.10.2.3	25,190.83	11,734.99
4. 交易费用	6.4.7.19	72,977.92	225,926.61
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.20	95,341.35	95,341.35
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		14,679,221.12	-16,649,476.21
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		14,679,221.12	-16,649,476.21

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：天弘中证800指数型发起式证券投资基金

本报告期：2019年01月01日至2019年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2019年01月01日至2019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）	119,300,943.29	-34,139,498.77	85,161,444.52
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	14,679,221.12	14,679,221.12
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）	-35,689,333.59	11,498,433.53	-24,190,900.06
其中：1. 基金申购款	55,064,745.37	-6,766,852.44	48,297,892.93
2. 基金赎回	-90,754,078.96	18,265,285.97	-72,488,792.99

款			
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）	83,611,609.70	-7,961,844.12	75,649,765.58
项目	上年度可比期间 2018年01月01日至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）	152,833,386.43	-9,790,659.82	143,042,726.61
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-16,649,476.21	-16,649,476.21
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	1,299,542.21	-172,012.33	1,127,529.88
其中：1. 基金申购款	28,816,008.27	-2,362,157.93	26,453,850.34
2. 基金赎回款	-27,516,466.06	2,190,145.60	-25,326,320.46
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）	154,132,928.64	-26,612,148.36	127,520,780.28

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

薄贺龙

肖慧敏

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

天弘中证800指数型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2015]1339号《关于准予天弘中证800指数型发起式证券投资基金注册的批复》注册，由天弘基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘中证800指数型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式发起式基金，存续期限不定，首次募集期间为2015年7月15日，首次设立募集不包括认购资金利息共募集10,000,000.00元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第959号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《天弘中证800指数型发起式证券投资基金基金合同》于2015年7月16日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为10,000,000.00份基金份额。本基金的基金管理人为天弘基金管理有限公司，基金托管人为广发证券股份有限公司。

根据《天弘中证800指数型发起式证券投资基金基金合同》和《天弘中证800指数型发起式证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金根据申购费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。认购/申购、赎回基金时收取认/申购费用、赎回费用，而不是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为天弘中证800指数型发起式证券投资基金A类（以下简称“A类基金”）；认购/申购、赎回基金时不收取认/申购费用、赎回费用，而是在本类别基金资产中计提销售服务费的，称为天弘中证800指数型发起式证券投资基金C类（以下简称“C类基金”）。本基金A类和C类两种收费模式并存，由于基金费用的不同，本基金A类基金份额及C类基金份额分别计算基金份额净值，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。投资者可自行选择申购某一类别的基金份额，但各类别基金份额之间不能相互转换。

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘中证800指数型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资对象是具有良好流动性的金融工具，以中证800指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于其他股票（非标的指数成份股及其备选成份股，含中小板、中证800及其他经中国证监会核准上市的股票）、银行存款、债券、债券回购、权证、股指期货、资产支持证券、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金投资于股票的资产比例不低于基金资产的

90%，投资于中证800指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的80%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准：中证800指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《天弘中证800指数型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以本基金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2019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2019年06月30日的财务状况以及2019年度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项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 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。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

(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。

(5) 本基金的城市维护建设税、教育费附加、地方教育费附加和防洪工程维护费等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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 2019年06月30日
活期存款	4,975,158.14

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	4,975,158.14

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末2019年06月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	67,582,839.82	71,073,461.05	3,490,621.23
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	67,582,839.82	71,073,461.05	3,490,621.23

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有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 2019年06月30日
应收活期存款利息	1,016.47
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	13.50
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	17.80
合计	1,047.77

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 2019年06月30日
交易所市场应付交易费用	10,000.10
银行间市场应付交易费用	-
合计	10,000.10

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	127.73
预提费用	79,341.35

其他应付	8,000.00
合计	87,469.08

6.4.7.9 实收基金

6.4.7.9.1 天弘中证800A

金额单位：人民币元

项目 (天弘中证800A)	本期2019年01月01日至2019年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	78,540,308.17	78,540,308.17
本期申购	20,407,793.19	20,407,793.19
本期赎回(以“-”号填列)	-46,616,257.57	-46,616,257.57
本期末	52,331,843.79	52,331,843.79

6.4.7.9.2 天弘中证800C

金额单位：人民币元

项目 (天弘中证800C)	本期2019年01月01日至2019年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	40,760,635.12	40,760,635.12
本期申购	34,656,952.18	34,656,952.18
本期赎回(以“-”号填列)	-44,137,821.39	-44,137,821.39
本期末	31,279,765.91	31,279,765.91

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

6.4.7.10.1 天弘中证800A

单位：人民币元

项目 (天弘中证800A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-207,227.18	-22,107,076.83	-22,314,304.01
本期利润	-2,090,137.76	11,104,839.28	9,014,701.52
本期基金份额交易产生的变动数	-141,912.84	8,624,281.04	8,482,368.20

其中：基金申购款	-1,187,430.05	-1,249,235.81	-2,436,665.86
基金赎回款	1,045,517.21	9,873,516.85	10,919,034.06
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,439,277.78	-2,377,956.51	-4,817,234.29

6.4.7.10.2 天弘中证800C

单位：人民币元

项目 (天弘中证800C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-400,378.66	-11,424,816.10	-11,825,194.76
本期利润	-1,945,842.54	7,610,362.14	5,664,519.60
本期基金份额交易产生的变动数	649,156.53	2,366,908.80	3,016,065.33
其中：基金申购款	-2,183,609.27	-2,146,577.31	-4,330,186.58
基金赎回款	2,832,765.80	4,513,486.11	7,346,251.91
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-1,697,064.67	-1,447,545.16	-3,144,609.83

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2019年01月01日至2019年06月30日
活期存款利息收入	15,685.09
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	361.52
其他	640.79
合计	16,687.40

6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日

卖出股票成交总额	41,844,435.95
减：卖出股票成本总额	46,199,338.01
买卖股票差价收入	-4,354,902.06

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 衍生工具收益

本基金本报告期未取得衍生工具投资收益。

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2019年01月01日至2019年06月30日
股票投资产生的股利收益	688,797.41
基金投资产生的股利收益	-
合计	688,797.41

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2019年01月01日至2019年06月30日
1. 交易性金融资产	18,715,201.42
——股票投资	18,715,201.42
——债券投资	-
——资产支持证券投资	-
——基金投资	-
——贵金属投资	-

——其他	-
2. 衍生工具	-
——权证投资	-
3. 其他	-
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	-
合计	18,715,201.42

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日
基金赎回费收入	12,564.04
基金转换费收入	181.52
合计	12,745.56

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日
交易所市场交易费用	72,977.92
银行间市场交易费用	-
合计	72,977.92

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	49,588.57
指数使用费	16,000.00
合计	95,341.35

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

关联方名称	与本基金的关系
天弘基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
广发证券股份有限公司（“广发证券”）	基金托管人、基金销售机构

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年01月01日至2019年06月30日		上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日	
	成交金额	占当期 股票成 交总额 的比例	成交金额	占当期 股票成 交总额 的比例
广发证券股份有限公司（“广发证	36,553,985.62	60.89%	276,135,259.42	100.00%

券”)				
-----	--	--	--	--

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年01月01日至2019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	占期末应付佣金总额的比例
广发证券股份有限公司(“广发证券”)	15,767.37	60.89%	5,901.31	59.01%
关联方名称	上年度可比期间 2018年01月01日至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	占期末应付佣金总额的比例
广发证券股份有限公司(“广发证券”)	63,871.17	100.00%	8,922.38	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 2019年01月01日至2019年06月30日	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	171,498.77	347,777.12
其中：支付销售机构的客户维护费	25,153.35	8,079.92

注：1、支付基金管理人天弘基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.50% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 × 0.50% / 当年天数。

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

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2019年01月01日至2019年06月30日	2018年01月01日至2018年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	34,299.74	69,555.42

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

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2019年01月01日至2019年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	天弘中证800A	天弘中证800C	合计
天弘基金管理有限公司	-	14,649.61	14,649.61
广发证券股份有限公司	-	11.72	11.72
合计	-	14,661.33	14,661.33
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间		
	2018年01月01日至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800A	天弘中证800C	合计
天弘基金管理有限公司	-	5,625.56	5,625.56
广发证券股份有限公司	-	35.37	35.37

合计	-	5,660.93	5,660.93
----	---	----------	----------

注：1、支付C类基金份额销售机构的销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给天弘基金管理有限公司，再由天弘基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。销售服务费的计算公式为：日销售服务费=前一日C类基金份额基金资产净值X0.25%/当年天数。

2、根据天弘基金管理有限公司2018年07月03日发布的《天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金开展销售服务费率优惠活动的公告》，自2018年07月03日起至2019年06月30日止期间，本基金C类份额的销售服务费率优惠至0.20%。

3、本基金A类份额不收取销售服务费。

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

天弘中证800A

份额单位：份

项目	本期 2019年01月01日至2019年06 月30日	上年度可比期间 2018年01月01日至2018年06 月30日
报告期初持有的基金份额	5,000,000.00	5,000,000.00
报告期间申购/买入总 份额	-	-
报告期间因拆分变动份 额	-	-
减：报告期间赎回/卖出 总份额	-	-
报告期末持有的基金份 额	5,000,000.00	5,000,000.00
报告期末持有的基金份 额占基金总份额比例	9.55%	3.24%

天弘中证800C

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2019年01月01日至2019年 06月30日	2018年01月01日至2018年 06月30日
报告期初持有的基金份额	17,236,632.82	5,000,000.00
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份 额	-	-
报告期末持有的基金份额	17,236,632.82	5,000,000.00
报告期末持有的基金份额占 基金总份额比例	55.10%	3.24%

注：1、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。

2、报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例，比例的分母分别采用A、C类各自级别的份额总额计算。

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		上年度可比期间	
	2019年01月01日至2019年06月30日		2018年01月01日至2018年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
广发证券股份有限公司	4,975,158.14	15,685.09	8,735,772.49	31,645.34

注：本基金的银行存款由基金托管人广发证券股份有限公司保管，存放在具有基金托管资格的中国建设银行股份有限公司，按银行同业利率或约定利率计息。

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区间指数投资部分的关联交易，严格履行了相关审批程序，且取得托管人同意。

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（2019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
601236	红塔证券	2019-06-26	2019-07-05	新股尚未上市流通	3.46	3.46	9,789	33,869.94	33,869.94	-

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	复牌开盘价	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
600	*ST	201	重	6.2	201	13.	1,045	22,317.22	6,562.60	-

485	信威	6-1 2-2 6	大资产 重组	8	9-0 7-1 2	86				
-----	----	-----------------	-----------	---	-----------------	----	--	--	--	--

注：本基金截至2019年06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2019年06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2019年06月30日，本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为指数型基金，采用指数复制投资策略，标的指数为中证800指数，按照个股在标的指数中的基准权重构建股票组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应地调整，以复制和跟踪标的指数。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现与跟踪指数相同的风险收益目标。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以审计与风险控制委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、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本基金的托管人广发证券股份有限公司开立于具有基金托管资格的中国建设银行股份有限公司的托管账户，因而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2019年06月30日，本基金无债券投资(2018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因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。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2019年06月30日，本基金所承担的全部金融负债的合同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上述比例限制)。

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%。于2019年06月30日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为0.05%。

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。于2019年06月30日，本基金组合资产中7个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

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。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2019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	4,975,158.14	-	-	-	4,975,158.14
结算备付金	30,008.69	-	-	-	30,008.69
存出保证金	39,432.32	-	-	-	39,432.32
交易性金融资 产	-	-	-	71,073,461.05	71,073,461.05
应收利息	-	-	-	1,047.77	1,047.77
应收申购款	-	-	-	252,937.36	252,937.36
资产总计	5,044,599.15	-	-	71,327,446.18	76,372,045.33
负债					
应付赎回款	-	-	-	583,948.77	583,948.77
应付管理人报 酬	-	-	-	30,266.74	30,266.74

应付托管费	-	-	-	6,053.37	6,053.37
应付销售服务费	-	-	-	4,541.69	4,541.69
应付交易费用	-	-	-	10,000.10	10,000.10
其他负债	-	-	-	87,469.08	87,469.08
负债总计	-	-	-	722,279.75	722,279.75
利率敏感度缺口	5,044,599.15	-	-	70,605,166.43	75,649,765.58
上年度末2018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	6,488,078.49	-	-	-	6,488,078.49
结算备付金	46,777.53	-	-	-	46,777.53
存出保证金	157,491.85	-	-	-	157,491.85
交易性金融资产	-	-	-	78,949,093.98	78,949,093.98
应收利息	-	-	-	1,605.17	1,605.17
应收申购款	-	-	-	982,877.35	982,877.35
资产总计	6,692,347.87	-	-	79,933,576.50	86,625,924.37
负债					
应付证券清算款	-	-	-	1,158,133.35	1,158,133.35
应付赎回款	-	-	-	77,399.55	77,399.55
应付管理人报酬	-	-	-	35,249.39	35,249.39
应付托管费	-	-	-	7,049.86	7,049.86
应付销售服务费	-	-	-	4,340.31	4,340.31
应付交易费用	-	-	-	14,303.34	14,303.34
其他负债	-	-	-	168,004.05	168,004.05
负债总计	-	-	-	1,464,479.85	1,464,479.85
利率敏感度缺口	6,692,347.87	-	-	78,469,096.65	85,161,444.52

口					
---	--	--	--	--	--

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2019年06月30日，本基金未持有交易性债券投资(2018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(2018年12月31日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019年06月30日		上年度末 2018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	71,073,461.05	93.95	78,949,093.98	92.71
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	71,073,461.05	93.95	78,949,093.98	92.71

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 2019年06月30日	上年度末 2018年12月31日
	业绩比较基准（附注6.4.1）上升5%	4,025,945.67	4,569,773.42
	业绩比较基准（附注6.4.1）下降5%	-4,025,945.67	-4,569,773.42

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2019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71,033,028.51元，属于第二层次的余额为33,869.94元，属于第三层次的余额为6,562.60元（2018年12月31日：第一层次77,873,905.19元，第二层次1,063,959.99元，第三层次11,228.80元）。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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
2019年01月01日	11,228.80	11,228.80
购买	-	-
出售	112.00	112.00
转入第三层级	-	-
转出第三层级	-	-
当期利得或损失总额	-4,554.20	-4,554.20
——计入损益的利得或损失	-4,554.20	-4,554.20
2019年06月30日公允价值	6,562.60	6,562.60
2019年06月30日仍持有的资产从转入第三层次起未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	-4,556.20	-4,556.20

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2019年06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(2018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	71,073,461.05	93.06
	其中：股票	71,073,461.05	93.06
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	5,005,166.83	6.55
8	其他各项资产	293,417.45	0.38
9	合计	76,372,045.33	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）按行业分类的境内股票投资组合

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	950,441.38	1.26
B	采矿业	2,336,150.77	3.09
C	制造业	30,982,301.62	40.95
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,785,613.20	2.36
E	建筑业	1,957,822.50	2.59
F	批发和零售业	1,638,440.82	2.17
G	交通运输、仓储和邮政业	2,235,330.62	2.95
H	住宿和餐饮业	64,862.00	0.09
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,563,534.71	4.71
J	金融业	19,524,259.60	25.81

K	房地产业	3,284,543.95	4.34
L	租赁和商务服务业	979,860.00	1.30
M	科学研究和技术服务业	65,843.00	0.09
N	水利、环境和公共设施管理业	212,633.28	0.28
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	54,640.80	0.07
Q	卫生和社会工作	379,681.85	0.50
R	文化、体育和娱乐业	596,686.20	0.79
S	综合	228,856.00	0.30
	合计	70,841,502.30	93.64

7.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

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	44,868.45	0.06
C	制造业	120,876.44	0.16
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	32,343.92	0.04
J	金融业	33,869.94	0.04
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		
0	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	231,958.75	0.31

注：由于指数成份股调整，上表所列示股票中，*ST信威（证券代码：600485）被调出成份股后停牌，故以积极投资股票列示。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	48,245	4,274,989.45	5.65
2	600519	贵州茅台	2,200	2,164,800.00	2.86
3	600036	招商银行	43,300	1,557,934.00	2.06
4	000651	格力电器	21,500	1,182,500.00	1.56
5	601166	兴业银行	61,000	1,115,690.00	1.47
6	000333	美的集团	20,586	1,067,589.96	1.41
7	000858	五粮液	8,597	1,014,016.15	1.34
8	600887	伊利股份	27,200	908,752.00	1.20
9	600276	恒瑞医药	12,947	854,502.00	1.13
10	600030	中信证券	35,200	838,112.00	1.11
11	601328	交通银行	115,400	706,248.00	0.93
12	600016	民生银行	104,240	661,924.00	0.87
13	000002	万科A	21,601	600,723.81	0.79
14	601288	农业银行	160,900	579,240.00	0.77
15	600000	浦发银行	49,300	575,824.00	0.76
16	300498	温氏股份	15,600	559,416.00	0.74

17	601668	中国建筑	93,580	538,085.00	0.71
18	601398	工商银行	90,600	533,634.00	0.71
19	600900	长江电力	29,400	526,260.00	0.70
20	600837	海通证券	36,200	513,678.00	0.68
21	601601	中国太保	14,000	511,140.00	0.68
22	000001	平安银行	36,100	497,458.00	0.66
23	002415	海康威视	16,675	459,896.50	0.61
24	600048	保利地产	31,800	405,768.00	0.54
25	600104	上汽集团	15,602	397,851.00	0.53
26	601888	中国国旅	4,300	381,195.00	0.50
27	603288	海天味业	3,600	378,000.00	0.50
28	600585	海螺水泥	8,901	369,391.50	0.49
29	601211	国泰君安	20,100	368,835.00	0.49
30	601169	北京银行	62,100	367,011.00	0.49
31	000725	京东方 A	105,700	363,608.00	0.48
32	600009	上海机场	4,201	351,959.78	0.47
33	601766	中国中车	43,400	351,106.00	0.46
34	000063	中兴通讯	10,600	344,818.00	0.46
35	600031	三一重工	26,100	341,388.00	0.45
36	601688	华泰证券	15,201	339,286.32	0.45
37	601988	中国银行	88,500	330,990.00	0.44
38	600028	中国石化	57,800	316,166.00	0.42
39	002304	洋河股份	2,600	316,056.00	0.42
40	300059	东方财富	22,560	305,688.00	0.40
41	600309	万华化学	6,980	298,674.20	0.39
42	600690	青岛海尔	16,300	281,827.00	0.37
43	601088	中国神华	13,800	281,244.00	0.37
44	002142	宁波银行	11,550	279,972.00	0.37
45	601229	上海银行	22,900	271,365.00	0.36
46	002475	立讯精密	10,931	270,979.49	0.36
47	000338	潍柴动力	21,300	261,777.00	0.35

48	601012	隆基股份	11,266	260,357.26	0.34
49	600340	华夏幸福	7,992	260,299.44	0.34
50	000568	泸州老窖	3,200	258,656.00	0.34
51	600019	宝钢股份	39,692	257,998.00	0.34
52	600050	中国联通	41,500	255,640.00	0.34
53	601818	光大银行	66,900	254,889.00	0.34
54	601857	中国石油	36,100	248,368.00	0.33
55	002027	分众传媒	43,160	228,316.40	0.30
56	601989	中国重工	40,800	226,848.00	0.30
57	001979	招商蛇口	10,500	219,450.00	0.29
58	600999	招商证券	12,700	217,043.00	0.29
59	601390	中国中铁	33,200	216,464.00	0.29
60	002230	科大讯飞	6,500	216,060.00	0.29
61	601006	大秦铁路	26,500	214,385.00	0.28
62	600919	江苏银行	29,100	211,266.00	0.28
63	601939	建设银行	28,200	209,808.00	0.28
64	601628	中国人寿	7,400	209,568.00	0.28
65	002714	牧原股份	3,522	207,058.38	0.27
66	601009	南京银行	25,000	206,500.00	0.27
67	601186	中国铁建	20,500	203,975.00	0.27
68	601336	新华保险	3,701	203,666.03	0.27
69	601899	紫金矿业	54,000	203,580.00	0.27
70	002594	比亚迪	4,000	202,880.00	0.27
71	000661	长春高新	600	202,800.00	0.27
72	600015	华夏银行	25,800	198,660.00	0.26
73	600570	恒生电子	2,860	194,909.00	0.26
74	000538	云南白药	2,302	192,032.84	0.25
75	002024	苏宁易购	16,600	190,568.00	0.25
76	000166	申万宏源	37,820	189,478.20	0.25
77	600352	浙江龙盛	11,600	182,932.00	0.24
78	000776	广发证券	13,200	181,368.00	0.24

79	601933	永辉超市	17,000	173,570.00	0.23
80	300015	爱尔眼科	5,485	169,870.45	0.22
81	600958	东方证券	15,900	169,812.00	0.22
82	601669	中国电建	32,100	169,809.00	0.22
83	601225	陕西煤业	17,800	164,472.00	0.22
84	000876	新希望	9,401	163,295.37	0.22
85	000100	TCL 集团	48,300	160,839.00	0.21
86	601155	新城控股	4,000	159,240.00	0.21
87	300142	沃森生物	5,400	153,144.00	0.20
88	600406	国电南瑞	8,200	152,848.00	0.20
89	002202	金风科技	12,251	152,279.93	0.20
90	600741	华域汽车	7,000	151,200.00	0.20
91	600436	片仔癀	1,300	149,760.00	0.20
92	600588	用友网络	5,547	149,103.36	0.20
93	002736	国信证券	10,900	143,444.00	0.19
94	600660	福耀玻璃	6,200	140,926.00	0.19
95	601377	兴业证券	20,900	140,866.00	0.19
96	600010	包钢股份	81,300	137,397.00	0.18
97	600547	山东黄金	3,300	135,861.00	0.18
98	000783	长江证券	17,200	134,332.00	0.18
99	600795	国电电力	52,600	133,604.00	0.18
100	002008	大族激光	3,800	130,644.00	0.17
101	601901	方正证券	18,300	130,113.00	0.17
102	000157	中联重科	21,500	129,215.00	0.17
103	601111	中国国航	13,300	127,281.00	0.17
104	000069	华侨城 A	18,300	127,185.00	0.17
105	603993	洛阳钼业	31,500	124,740.00	0.16
106	600111	北方稀土	9,700	124,548.00	0.16
107	600703	三安光电	10,900	122,952.00	0.16
108	600705	中航资本	22,600	122,492.00	0.16
109	600011	华能国际	19,600	122,108.00	0.16

110	600438	通威股份	8,600	120,916.00	0.16
111	600089	特变电工	16,562	120,074.50	0.16
112	600383	金地集团	10,000	119,300.00	0.16
113	600029	南方航空	15,300	118,116.00	0.16
114	601800	中国交建	10,400	117,728.00	0.16
115	600886	国投电力	15,100	117,327.00	0.16
116	601985	中国核电	20,800	115,648.00	0.15
117	002236	大华股份	7,950	115,434.00	0.15
118	601108	财通证券	10,500	115,290.00	0.15
119	002007	华兰生物	3,750	114,337.50	0.15
120	601600	中国铝业	29,100	114,072.00	0.15
121	002422	科伦药业	3,800	112,974.00	0.15
122	600271	航天信息	4,900	112,945.00	0.15
123	600196	复星医药	4,400	111,320.00	0.15
124	600606	绿地控股	16,200	110,646.00	0.15
125	600115	东方航空	17,500	109,725.00	0.15
126	601555	东吴证券	10,700	109,675.00	0.14
127	000895	双汇发展	4,400	109,516.00	0.14
128	300003	乐普医疗	4,700	108,194.00	0.14
129	002311	海大集团	3,500	108,150.00	0.14
130	002405	四维图新	6,500	104,650.00	0.14
131	000860	顺鑫农业	2,240	104,496.00	0.14
132	002001	新和成	5,400	104,166.00	0.14
133	600221	海航控股	51,300	104,139.00	0.14
134	600109	国金证券	10,700	104,004.00	0.14
135	002044	美年健康	8,300	103,252.00	0.14
136	600872	中炬高新	2,400	102,792.00	0.14
137	600332	白云山	2,500	102,425.00	0.14
138	300124	汇川技术	4,400	100,804.00	0.13
139	600522	中天科技	10,900	99,953.00	0.13
140	000963	华东医药	3,847	99,868.12	0.13

141	600061	国投资本	7,100	99,471.00	0.13
142	601788	光大证券	8,700	99,354.00	0.13
143	600177	雅戈尔	15,600	99,060.00	0.13
144	002410	广联达	3,000	98,670.00	0.13
145	300033	同花顺	1,000	98,360.00	0.13
146	600487	亨通光电	5,860	98,213.60	0.13
147	600018	上港集团	14,400	98,208.00	0.13
148	601618	中国中冶	31,800	96,672.00	0.13
149	000768	中航飞机	6,100	96,075.00	0.13
150	600637	东方明珠	9,090	95,808.60	0.13
151	000413	东旭光电	18,400	94,576.00	0.13
152	000425	徐工机械	20,900	93,214.00	0.12
153	601607	上海医药	5,090	92,383.50	0.12
154	600893	航发动力	4,000	90,840.00	0.12
155	300122	智飞生物	2,100	90,510.00	0.12
156	600100	同方股份	9,900	89,595.00	0.12
157	300408	三环集团	4,600	89,470.00	0.12
158	600176	中国巨石	9,300	88,629.00	0.12
159	002271	东方雨虹	3,900	88,374.00	0.12
160	600516	方大炭素	7,152	87,898.08	0.12
161	603019	中科曙光	2,500	87,750.00	0.12
162	601877	正泰电器	3,800	87,742.00	0.12
163	300017	网宿科技	8,100	87,318.00	0.12
164	600498	烽火通信	3,112	86,700.32	0.11
165	601919	中远海控	17,200	86,344.00	0.11
166	002352	顺丰控股	2,500	84,900.00	0.11
167	601727	上海电气	15,698	84,455.24	0.11
168	600004	白云机场	4,600	83,720.00	0.11
169	600867	通化东宝	5,400	83,160.00	0.11
170	300136	信维通信	3,400	83,130.00	0.11
171	000728	国元证券	9,000	82,530.00	0.11

172	002157	正邦科技	4,900	81,634.00	0.11
173	600201	生物股份	5,147	80,756.43	0.11
174	000066	中国长城	7,837	80,564.36	0.11
175	600023	浙能电力	18,200	80,444.00	0.11
176	600763	通策医疗	900	79,731.00	0.11
177	002460	赣锋锂业	3,401	79,685.43	0.11
178	000423	东阿阿胶	2,000	79,640.00	0.11
179	002049	紫光国微	1,800	79,398.00	0.10
180	002673	西部证券	7,800	78,624.00	0.10
181	600739	辽宁成大	5,400	78,516.00	0.10
182	600489	中金黄金	7,600	78,052.00	0.10
183	300450	先导智能	2,300	77,280.00	0.10
184	601018	宁波港	17,600	77,264.00	0.10
185	601998	中信银行	12,900	77,013.00	0.10
186	600066	宇通客车	5,900	76,818.00	0.10
187	600068	葛洲坝	12,300	76,629.00	0.10
188	300253	卫宁健康	5,400	76,572.00	0.10
189	002179	中航光电	2,288	76,556.48	0.10
190	002241	歌尔股份	8,602	76,471.78	0.10
191	002466	天齐锂业	3,023	76,421.44	0.10
192	600809	山西汾酒	1,100	75,955.00	0.10
193	002195	二三四五	19,379	75,384.31	0.10
194	600170	上海建工	19,800	74,448.00	0.10
195	600426	华鲁恒升	5,000	74,300.00	0.10
196	300144	宋城演艺	3,200	74,048.00	0.10
197	000401	冀东水泥	4,200	73,962.00	0.10
198	002081	金螳螂	7,100	73,201.00	0.10
199	300024	机器人	4,780	72,799.40	0.10
200	600642	申能股份	12,100	72,721.00	0.10
201	002439	启明星辰	2,700	72,630.00	0.10
202	600398	海澜之家	8,000	72,560.00	0.10

203	601198	东兴证券	6,100	72,468.00	0.10
204	600362	江西铜业	4,600	72,404.00	0.10
205	002146	荣盛发展	7,700	72,303.00	0.10
206	600219	南山铝业	31,960	72,229.60	0.10
207	002129	中环股份	7,400	72,224.00	0.10
208	002463	沪电股份	5,300	72,186.00	0.10
209	601021	春秋航空	1,600	72,000.00	0.10
210	600926	杭州银行	8,620	71,804.60	0.09
211	000961	中南建设	8,200	71,012.00	0.09
212	600482	中国动力	3,000	70,860.00	0.09
213	002506	协鑫集成	10,600	70,808.00	0.09
214	600183	生益科技	4,665	70,208.25	0.09
215	002507	涪陵榨菜	2,300	70,150.00	0.09
216	601881	中国银河	5,700	69,825.00	0.09
217	600536	中国软件	1,300	69,771.00	0.09
218	600895	张江高科	3,400	69,768.00	0.09
219	601997	贵阳银行	8,060	69,719.00	0.09
220	600085	同仁堂	2,400	69,600.00	0.09
221	600298	安琪酵母	2,200	69,586.00	0.09
222	600674	川投能源	7,800	69,420.00	0.09
223	000630	铜陵有色	28,100	69,126.00	0.09
224	000703	恒逸石化	5,060	69,119.60	0.09
225	300383	光环新网	4,100	68,757.00	0.09
226	002465	海格通信	7,200	68,688.00	0.09
227	002127	南极电商	6,100	68,564.00	0.09
228	000623	吉林敖东	4,143	67,903.77	0.09
229	002493	荣盛石化	5,600	67,536.00	0.09
230	603156	养元饮品	1,820	67,485.60	0.09
231	000786	北新建材	3,700	67,081.00	0.09
232	002602	世纪华通	6,129	66,928.68	0.09
233	000975	银泰资源	5,043	66,517.17	0.09

234	601838	成都银行	7,500	66,225.00	0.09
235	000750	国海证券	13,100	65,893.00	0.09
236	002340	格林美	13,950	65,704.50	0.09
237	300070	碧水源	8,432	65,685.28	0.09
238	002456	欧菲光	8,374	65,652.16	0.09
239	600535	天士力	3,960	65,538.00	0.09
240	002223	鱼跃医疗	2,650	65,243.00	0.09
241	603833	欧派家居	600	64,572.00	0.09
242	601138	工业富联	5,300	63,865.00	0.08
243	002268	卫士通	2,570	62,836.50	0.08
244	002739	万达电影	3,400	62,696.00	0.08
245	002384	东山精密	4,300	62,651.00	0.08
246	002555	三七互娱	4,600	62,330.00	0.08
247	600369	西南证券	12,500	61,750.00	0.08
248	603369	今世缘	2,200	61,358.00	0.08
249	002050	三花智控	5,810	61,295.50	0.08
250	600801	华新水泥	3,020	61,155.00	0.08
251	000629	攀钢钒钛	18,000	61,020.00	0.08
252	600297	广汇汽车	13,667	60,954.82	0.08
253	002500	山西证券	7,500	60,750.00	0.08
254	603986	兆易创新	700	60,690.00	0.08
255	603799	华友钴业	2,816	60,008.96	0.08
256	600208	新湖中宝	19,100	59,974.00	0.08
257	600879	航天电子	9,700	59,752.00	0.08
258	002797	第一创业	9,400	59,596.00	0.08
259	000596	古井贡酒	501	59,373.51	0.08
260	002821	凯莱英	600	58,848.00	0.08
261	002075	沙钢股份	7,500	58,800.00	0.08
262	600161	天坛生物	2,328	58,782.00	0.08
263	600118	中国卫星	2,600	58,630.00	0.08
264	600325	华发股份	7,500	58,575.00	0.08

265	600460	士兰微	3,500	58,100.00	0.08
266	002065	东华软件	8,300	58,017.00	0.08
267	300296	利亚德	7,400	57,942.00	0.08
268	000998	隆平高科	4,000	57,920.00	0.08
269	002926	华西证券	5,500	57,750.00	0.08
270	000625	长安汽车	8,700	57,681.00	0.08
271	000656	金科股份	9,500	57,285.00	0.08
272	002624	完美世界	2,200	56,782.00	0.08
273	600528	中铁工业	4,900	56,693.00	0.07
274	000709	河钢股份	18,900	56,511.00	0.07
275	002373	千方科技	3,300	56,430.00	0.07
276	000723	美锦能源	5,400	56,430.00	0.07
277	002508	老板电器	2,070	56,179.80	0.07
278	600346	恒力石化	4,620	56,179.20	0.07
279	002385	大北农	10,600	56,074.00	0.07
280	600153	建发股份	6,300	55,944.00	0.07
281	600779	水井坊	1,100	55,902.00	0.07
282	600663	陆家嘴	3,600	55,800.00	0.07
283	002299	圣农发展	2,200	55,704.00	0.07
284	601992	金隅集团	14,800	55,648.00	0.07
285	603160	汇顶科技	400	55,520.00	0.07
286	002371	北方华创	800	55,400.00	0.07
287	000778	新兴铸管	12,400	55,056.00	0.07
288	600583	海油工程	9,800	54,880.00	0.07
289	601878	浙商证券	5,900	54,870.00	0.07
290	600027	华电国际	14,500	54,665.00	0.07
291	000686	东北证券	6,200	54,622.00	0.07
292	000009	中国宝安	9,500	54,245.00	0.07
293	601168	西部矿业	8,500	54,230.00	0.07
294	000997	新大陆	3,200	54,048.00	0.07
295	600584	长电科技	4,200	53,970.00	0.07

296	000627	天茂集团	8,300	53,867.00	0.07
297	600497	驰宏锌锗	10,600	53,848.00	0.07
298	600699	均胜电子	2,500	53,400.00	0.07
299	600549	厦门钨业	3,730	53,376.30	0.07
300	600038	中直股份	1,300	53,326.00	0.07
301	600848	上海临港	1,713	53,325.69	0.07
302	601128	常熟银行	6,900	53,268.00	0.07
303	600745	闻泰科技	1,600	53,152.00	0.07
304	002032	苏泊尔	700	53,081.00	0.07
305	600820	隧道股份	8,401	53,010.31	0.07
306	601117	中国化学	8,800	52,976.00	0.07
307	600673	东阳光	6,700	52,595.00	0.07
308	600410	华胜天成	4,900	52,577.00	0.07
309	002092	中泰化学	6,600	52,536.00	0.07
310	601005	重庆钢铁	26,100	52,461.00	0.07
311	600909	华安证券	8,000	52,320.00	0.07
312	600760	中航沈飞	1,800	52,254.00	0.07
313	000988	华工科技	3,300	52,206.00	0.07
314	000060	中金岭南	11,100	52,059.00	0.07
315	600875	东方电气	4,900	52,038.00	0.07
316	002572	索菲亚	2,800	51,968.00	0.07
317	300168	万达信息	4,000	51,880.00	0.07
318	600977	中国电影	3,300	51,678.00	0.07
319	600392	盛和资源	4,610	50,986.60	0.07
320	600376	首开股份	5,697	50,874.21	0.07
321	002153	石基信息	1,400	50,666.00	0.07
322	600688	上海石化	9,800	50,568.00	0.07
323	000039	中集集团	4,680	49,982.40	0.07
324	600572	康恩贝	7,800	49,920.00	0.07
325	000999	华润三九	1,700	49,878.00	0.07
326	600415	小商品城	12,100	49,852.00	0.07

327	000690	宝新能源	7,700	49,588.00	0.07
328	601216	君正集团	15,000	49,350.00	0.07
329	600166	福田汽车	20,800	49,296.00	0.07
330	600816	安信信托	9,760	49,288.00	0.07
331	000960	锡业股份	4,400	49,148.00	0.06
332	600811	东方集团	13,200	49,104.00	0.06
333	002558	巨人网络	2,700	49,059.00	0.06
334	603939	益丰药房	700	48,993.00	0.06
335	000830	鲁西化工	4,500	48,960.00	0.06
336	600022	山东钢铁	29,300	48,931.00	0.06
337	002916	深南电路	480	48,921.60	0.06
338	601333	广深铁路	15,100	48,773.00	0.06
339	600718	东软集团	3,800	48,716.00	0.06
340	002353	杰瑞股份	2,100	48,510.00	0.06
341	603858	步长制药	1,880	48,447.60	0.06
342	002191	劲嘉股份	3,900	48,399.00	0.06
343	600839	四川长虹	16,400	48,380.00	0.06
344	002372	伟星新材	2,780	48,372.00	0.06
345	600755	厦门国贸	5,600	48,328.00	0.06
346	000581	威孚高科	2,600	48,256.00	0.06
347	600567	山鹰纸业	14,300	48,191.00	0.06
348	601866	中远海发	17,600	47,872.00	0.06
349	000547	航天发展	4,997	47,771.32	0.06
350	002281	光迅科技	1,800	47,664.00	0.06
351	600804	鹏博士	6,300	47,376.00	0.06
352	600885	宏发股份	1,940	47,142.00	0.06
353	601872	招商轮船	10,800	47,088.00	0.06
354	002078	太阳纸业	6,900	46,989.00	0.06
355	600881	亚泰集团	14,400	46,800.00	0.06
356	600315	上海家化	1,500	46,725.00	0.06
357	000671	阳光城	7,200	46,656.00	0.06

358	600959	江苏有线	10,324	45,941.80	0.06
359	002252	上海莱士	6,600	45,870.00	0.06
360	600808	马钢股份	13,300	45,353.00	0.06
361	600521	华海药业	3,200	45,120.00	0.06
362	603077	和邦生物	23,600	44,840.00	0.06
363	601238	广汽集团	4,100	44,813.00	0.06
364	600094	大名城	7,100	44,659.00	0.06
365	002387	维信诺	3,400	44,370.00	0.06
366	600079	人福医药	4,202	44,121.00	0.06
367	600260	凯乐科技	2,200	43,956.00	0.06
368	002221	东华能源	5,100	43,911.00	0.06
369	601633	长城汽车	5,300	43,831.00	0.06
370	600486	扬农化工	800	43,760.00	0.06
371	603259	药明康德	500	43,340.00	0.06
372	002074	国轩高科	3,300	43,263.00	0.06
373	300027	华谊兄弟	8,800	43,208.00	0.06
374	002217	合力泰	7,800	43,134.00	0.06
375	000970	中科三环	3,800	43,130.00	0.06
376	600160	巨化股份	6,050	43,015.50	0.06
377	300009	安科生物	2,700	42,930.00	0.06
378	002670	国盛金控	3,405	42,903.00	0.06
379	603000	人民网	2,400	42,792.00	0.06
380	300274	阳光电源	4,540	42,449.00	0.06
381	300315	掌趣科技	12,300	42,435.00	0.06
382	000983	西山煤电	7,000	42,420.00	0.06
383	002038	双鹭药业	1,800	42,408.00	0.06
384	600188	兖州煤业	3,900	42,393.00	0.06
385	002085	万丰奥威	5,800	42,224.00	0.06
386	600566	济川药业	1,400	42,154.00	0.06
387	603444	吉比特	200	41,992.00	0.06
388	601319	中国人保	4,400	41,756.00	0.06

389	000402	金融街	5,300	41,552.00	0.05
390	300088	长信科技	8,200	41,492.00	0.05
391	300072	三聚环保	5,229	41,465.97	0.05
392	600967	内蒙一机	3,700	41,440.00	0.05
393	600282	南钢股份	11,800	41,300.00	0.05
394	002273	水晶光电	3,560	41,224.80	0.05
395	600643	爱建集团	4,300	41,194.00	0.05
396	600704	物产中大	7,600	41,192.00	0.05
397	600466	蓝光发展	6,620	41,176.40	0.05
398	000729	燕京啤酒	6,200	41,168.00	0.05
399	600143	金发科技	8,400	41,160.00	0.05
400	600037	歌华有线	4,000	41,000.00	0.05
401	600064	南京高科	3,820	40,912.20	0.05
402	600388	龙净环保	3,300	40,887.00	0.05
403	600737	中粮糖业	4,700	40,796.00	0.05
404	600845	宝信软件	1,430	40,726.40	0.05
405	002010	传化智联	5,400	40,662.00	0.05
406	002002	鸿达兴业	6,556	40,581.64	0.05
407	600863	内蒙华电	12,900	40,506.00	0.05
408	002110	三钢闽光	4,350	40,455.00	0.05
409	601098	中南传媒	3,200	40,448.00	0.05
410	000898	鞍钢股份	10,660	40,401.40	0.05
411	300166	东方国信	3,280	40,311.20	0.05
412	002294	信立泰	1,800	40,284.00	0.05
413	002310	东方园林	6,700	40,200.00	0.05
414	601066	中信建投	1,900	40,052.00	0.05
415	002601	龙麟佰利	2,700	40,041.00	0.05
416	000089	深圳机场	4,500	40,005.00	0.05
417	600266	北京城建	4,960	39,977.60	0.05
418	600021	上海电力	4,600	39,928.00	0.05
419	000513	丽珠集团	1,201	39,909.23	0.05

420	601699	潞安环能	5,000	39,700.00	0.05
421	300001	特锐德	2,200	39,644.00	0.05
422	600026	中远海能	6,100	39,589.00	0.05
423	002131	利欧股份	20,700	39,537.00	0.05
424	002120	韵达股份	1,280	39,449.60	0.05
425	000878	云南铜业	3,700	39,331.00	0.05
426	002019	亿帆医药	3,201	39,212.25	0.05
427	000563	陕国投 A	8,830	39,205.20	0.05
428	002690	美亚光电	1,200	39,120.00	0.05
429	600171	上海贝岭	2,400	39,000.00	0.05
430	603517	绝味食品	1,000	38,910.00	0.05
431	601898	中煤能源	8,100	38,880.00	0.05
432	002773	康弘药业	1,180	38,845.60	0.05
433	002174	游族网络	2,300	38,824.00	0.05
434	600435	北方导航	4,300	38,657.00	0.05
435	601360	三六零	1,800	38,484.00	0.05
436	002607	中公教育	2,800	38,444.00	0.05
437	601106	中国一重	12,200	38,308.00	0.05
438	002440	闰土股份	3,050	38,003.00	0.05
439	002589	瑞康医药	5,000	37,950.00	0.05
440	601718	际华集团	9,700	37,927.00	0.05
441	600258	首旅酒店	2,100	37,758.00	0.05
442	601100	恒立液压	1,200	37,656.00	0.05
443	000636	风华高科	3,100	37,510.00	0.05
444	002155	湖南黄金	3,700	37,259.00	0.05
445	600380	健康元	4,304	37,229.60	0.05
446	601118	海南橡胶	7,200	37,080.00	0.05
447	300413	芒果超媒	900	36,945.00	0.05
448	000930	中粮生化	4,912	36,938.24	0.05
449	300207	欣旺达	3,200	36,864.00	0.05
450	002250	联化科技	3,300	36,597.00	0.05

451	000826	启迪环境	3,100	36,549.00	0.05
452	000559	万向钱潮	6,100	36,478.00	0.05
453	002152	广电运通	5,300	36,305.00	0.05
454	000732	泰禾集团	2,200	36,300.00	0.05
455	601000	唐山港	13,178	36,239.50	0.05
456	600649	城投控股	5,600	36,232.00	0.05
457	000598	兴蓉环境	7,900	35,945.00	0.05
458	601966	玲珑轮胎	2,100	35,700.00	0.05
459	000932	华菱钢铁	7,480	35,679.60	0.05
460	000883	湖北能源	8,200	35,588.00	0.05
461	600008	首创股份	10,100	35,552.00	0.05
462	300316	晶盛机电	2,800	35,532.00	0.05
463	600373	中文传媒	2,800	35,168.00	0.05
464	000938	紫光股份	1,288	35,098.00	0.05
465	002233	塔牌集团	3,000	35,040.00	0.05
466	601231	环旭电子	2,900	34,945.00	0.05
467	600039	四川路桥	9,600	34,944.00	0.05
468	000681	视觉中国	1,800	34,884.00	0.05
469	002411	延安必康	1,985	34,539.00	0.05
470	600500	中化国际	4,600	34,362.00	0.05
471	600827	百联股份	3,500	34,335.00	0.05
472	601228	广州港	8,200	34,276.00	0.05
473	600372	中航电子	2,300	34,132.00	0.05
474	601179	中国西电	9,100	33,670.00	0.04
475	002399	海普瑞	1,600	33,584.00	0.04
476	600648	外高桥	1,600	33,568.00	0.04
477	002583	海能达	4,000	33,560.00	0.04
478	000738	航发控制	2,500	33,500.00	0.04
479	000758	中色股份	6,100	33,489.00	0.04
480	000031	大悦城	5,200	33,384.00	0.04
481	002368	太极股份	1,100	33,330.00	0.04

482	000685	中山公用	3,900	33,306.00	0.04
483	601608	中信重工	7,700	33,264.00	0.04
484	600729	重庆百货	1,100	33,264.00	0.04
485	600598	北大荒	3,100	33,263.00	0.04
486	002266	浙富控股	7,000	33,250.00	0.04
487	300182	捷成股份	7,500	33,075.00	0.04
488	600782	新钢股份	6,600	33,000.00	0.04
489	603501	韦尔股份	600	32,946.00	0.04
490	000027	深圳能源	5,300	32,860.00	0.04
491	600025	华能水电	8,000	32,560.00	0.04
492	000877	天山股份	2,800	32,536.00	0.04
493	300058	蓝色光标	7,600	32,452.00	0.04
494	601678	滨化股份	4,800	32,448.00	0.04
495	002468	申通快递	1,301	32,446.94	0.04
496	000008	神州高铁	8,600	32,422.00	0.04
497	002004	华邦健康	6,668	32,406.48	0.04
498	000807	云铝股份	6,900	32,361.00	0.04
499	002938	鹏鼎控股	1,100	32,296.00	0.04
500	300418	昆仑万维	2,500	32,175.00	0.04
501	600515	海航基础	6,500	32,175.00	0.04
502	000415	渤海租赁	8,200	32,144.00	0.04
503	000488	晨鸣纸业	5,954	31,913.44	0.04
504	600138	中青旅	2,500	31,725.00	0.04
505	002414	高德红外	1,650	31,680.00	0.04
506	600167	联美控股	2,990	31,634.20	0.04
507	600748	上实发展	3,800	31,502.00	0.04
508	002183	怡亚通	6,600	31,482.00	0.04
509	603885	吉祥航空	2,400	31,440.00	0.04
510	600507	方大特钢	3,200	31,296.00	0.04
511	600120	浙江东方	2,452	31,238.48	0.04
512	600339	中油工程	7,400	31,228.00	0.04

513	600409	三友化工	5,500	31,130.00	0.04
514	600056	中国医药	2,300	31,027.00	0.04
515	600998	九州通	2,500	30,900.00	0.04
516	600155	华创阳安	2,300	30,889.00	0.04
517	600633	浙数文化	3,300	30,855.00	0.04
518	600348	阳泉煤业	5,300	30,793.00	0.04
519	600216	浙江医药	3,000	30,720.00	0.04
520	600158	中体产业	3,000	30,690.00	0.04
521	000887	中鼎股份	3,200	30,688.00	0.04
522	002408	齐翔腾达	3,940	30,535.00	0.04
523	000813	德展健康	4,000	30,480.00	0.04
524	600418	江淮汽车	5,900	30,444.00	0.04
525	600823	世茂股份	6,600	30,426.00	0.04
526	603228	景旺电子	760	30,407.60	0.04
527	600060	海信电器	3,500	30,170.00	0.04
528	002603	以岭药业	2,600	30,108.00	0.04
529	000528	柳工	4,510	30,036.60	0.04
530	300133	华策影视	4,440	29,881.20	0.04
531	600511	国药股份	1,300	29,861.00	0.04
532	300113	顺网科技	1,900	29,792.00	0.04
533	600277	亿利洁能	6,100	29,707.00	0.04
534	600525	长园集团	4,700	29,704.00	0.04
535	600970	中材国际	4,600	29,578.00	0.04
536	600777	新潮能源	14,200	29,536.00	0.04
537	601880	大连港	13,800	29,394.00	0.04
538	000028	国药一致	700	29,281.00	0.04
539	603883	老百姓	500	29,240.00	0.04
540	600597	光明乳业	2,700	29,025.00	0.04
541	601958	金钼股份	4,300	28,810.00	0.04
542	600062	华润双鹤	2,280	28,750.80	0.04
543	002244	滨江集团	6,900	28,635.00	0.04

544	600478	科力远	5,100	28,509.00	0.04
545	600717	天津港	4,440	28,504.80	0.04
546	002407	多氟多	2,400	28,416.00	0.04
547	600307	酒钢宏兴	13,900	28,217.00	0.04
548	600259	广晟有色	700	28,210.00	0.04
549	300010	立思辰	3,000	28,170.00	0.04
550	002812	恩捷股份	600	28,050.00	0.04
551	000301	东方盛虹	5,100	27,999.00	0.04
552	600664	哈药股份	6,741	27,907.74	0.04
553	600312	平高电气	3,600	27,684.00	0.04
554	300026	红日药业	8,000	27,600.00	0.04
555	002701	奥瑞金	5,900	27,553.00	0.04
556	000156	华数传媒	2,500	27,525.00	0.04
557	300002	神州泰岳	6,900	27,462.00	0.04
558	601928	凤凰传媒	3,400	27,438.00	0.04
559	002419	天虹股份	2,100	27,426.00	0.04
560	002212	南洋股份	2,000	27,400.00	0.04
561	002056	横店东磁	3,600	27,360.00	0.04
562	601611	中国核建	3,500	27,230.00	0.04
563	600316	洪都航空	1,900	27,189.00	0.04
564	600754	锦江股份	1,100	27,104.00	0.04
565	002242	九阳股份	1,300	27,053.00	0.04
566	000090	天健集团	5,470	27,021.80	0.04
567	601200	上海环境	1,980	26,947.80	0.04
568	600580	卧龙电驱	3,199	26,903.59	0.04
569	300244	迪安诊断	1,580	26,828.40	0.04
570	002128	露天煤业	3,100	26,815.00	0.04
571	603816	顾家家居	840	26,812.80	0.04
572	600557	康缘药业	1,800	26,748.00	0.04
573	002491	通鼎互联	3,300	26,697.00	0.04
574	600073	上海梅林	2,900	26,680.00	0.04

575	002640	跨境通	3,200	26,656.00	0.04
576	600884	杉杉股份	2,500	26,625.00	0.04
577	002470	金正大	7,300	26,572.00	0.04
578	300251	光线传媒	3,900	26,520.00	0.04
579	300324	旋极信息	4,524	26,193.96	0.03
580	002030	达安基因	2,440	26,181.20	0.03
581	002064	华峰氨纶	5,200	26,104.00	0.03
582	000021	深科技	3,200	26,016.00	0.03
583	002426	胜利精密	10,100	25,856.00	0.03
584	600017	日照港	8,200	25,830.00	0.03
585	002176	江特电机	5,300	25,811.00	0.03
586	600125	铁龙物流	4,000	25,800.00	0.03
587	600759	洲际油气	6,600	25,476.00	0.03
588	000078	海王生物	7,300	25,404.00	0.03
589	600751	海航科技	7,985	25,392.30	0.03
590	000727	华东科技	12,100	25,289.00	0.03
591	600575	皖江物流	8,600	25,198.00	0.03
592	600582	天地科技	7,300	25,185.00	0.03
593	300115	长盈精密	2,400	25,176.00	0.03
594	300134	大富科技	1,617	25,112.01	0.03
595	002665	首航节能	7,400	25,086.00	0.03
596	601808	中海油服	2,600	25,038.00	0.03
597	002939	长城证券	1,500	25,035.00	0.03
598	600267	海正药业	2,500	25,000.00	0.03
599	601162	天风证券	2,300	24,932.00	0.03
600	002051	中工国际	2,158	24,752.26	0.03
601	600563	法拉电子	600	24,702.00	0.03
602	002317	众生药业	2,900	24,679.00	0.03
603	000959	首钢股份	7,000	24,640.00	0.03
604	002285	世联行	5,460	24,624.60	0.03
605	601717	郑煤机	4,300	24,553.00	0.03

606	600499	科达洁能	5,600	24,528.00	0.03
607	300197	铁汉生态	6,800	24,412.00	0.03
608	000712	锦龙股份	1,900	24,396.00	0.03
609	300433	蓝思科技	3,500	24,395.00	0.03
610	002358	森源电气	2,400	24,360.00	0.03
611	600859	王府井	1,600	24,304.00	0.03
612	600565	迪马股份	6,500	24,245.00	0.03
613	600291	西水股份	2,400	24,144.00	0.03
614	002505	大康农业	12,200	24,034.00	0.03
615	000519	中兵红箭	3,100	23,963.00	0.03
616	002831	裕同科技	1,240	23,770.80	0.03
617	600901	江苏租赁	3,900	23,751.00	0.03
618	600317	营口港	8,600	23,736.00	0.03
619	000400	许继电气	2,600	23,556.00	0.03
620	603260	合盛硅业	500	23,530.00	0.03
621	000926	福星股份	3,400	23,528.00	0.03
622	603659	璞泰来	500	23,510.00	0.03
623	000717	韶钢松山	5,300	23,479.00	0.03
624	002280	联络互动	6,400	23,424.00	0.03
625	002925	盈趣科技	600	23,406.00	0.03
626	603233	大参林	520	23,400.00	0.03
627	002302	西部建设	2,100	23,394.00	0.03
628	600835	上海机电	1,400	23,240.00	0.03
629	000718	苏宁环球	6,700	23,182.00	0.03
630	002444	巨星科技	2,300	22,954.00	0.03
631	600993	马应龙	1,300	22,945.00	0.03
632	002028	思源电气	2,300	22,908.00	0.03
633	000006	深振业 A	4,200	22,890.00	0.03
634	601326	秦港股份	6,300	22,869.00	0.03
635	002424	贵州百灵	2,300	22,724.00	0.03
636	600770	综艺股份	3,400	22,712.00	0.03

637	600151	航天机电	4,400	22,660.00	0.03
638	002249	大洋电机	5,200	22,568.00	0.03
639	002573	清新环境	2,800	22,540.00	0.03
640	002839	张家港行	4,000	22,520.00	0.03
641	600645	中源协和	1,300	22,503.00	0.03
642	000012	南玻A	5,390	22,422.40	0.03
643	600141	兴发集团	2,180	22,410.40	0.03
644	600787	中储股份	3,900	22,347.00	0.03
645	600611	大众交通	4,800	22,320.00	0.03
646	002807	江阴银行	4,760	22,276.80	0.03
647	000158	常山北明	4,100	22,222.00	0.03
648	002945	华林证券	1,200	22,200.00	0.03
649	600765	中航重机	2,400	22,152.00	0.03
650	000543	皖能电力	4,700	22,137.00	0.03
651	002390	信邦制药	4,200	22,134.00	0.03
652	600908	无锡银行	3,900	21,996.00	0.03
653	600390	五矿资本	2,300	21,689.00	0.03
654	603866	桃李面包	520	21,658.00	0.03
655	000848	承德露露	2,600	21,658.00	0.03
656	603515	欧普照明	670	21,607.50	0.03
657	002366	台海核电	2,300	21,528.00	0.03
658	000408	藏格控股	2,600	21,502.00	0.03
659	000980	众泰汽车	5,100	21,471.00	0.03
660	000553	安道麦A	2,000	21,440.00	0.03
661	300055	万邦达	3,001	21,397.13	0.03
662	600169	太原重工	8,000	21,360.00	0.03
663	600338	西藏珠峰	1,220	21,325.60	0.03
664	603712	七一二	1,000	21,230.00	0.03
665	601019	山东出版	2,700	21,006.00	0.03
666	002332	仙琚制药	3,100	20,956.00	0.03
667	002431	棕榈股份	5,300	20,935.00	0.03

668	600393	粤泰股份	4,500	20,925.00	0.03
669	000564	供销大集	8,000	20,880.00	0.03
670	600458	时代新材	2,000	20,780.00	0.03
671	000600	建投能源	3,100	20,770.00	0.03
672	600862	中航高科	2,300	20,677.00	0.03
673	601828	美凯龙	1,700	20,655.00	0.03
674	601311	骆驼股份	1,900	20,615.00	0.03
675	002048	宁波华翔	1,900	20,558.00	0.03
676	002093	国脉科技	2,202	20,456.58	0.03
677	002672	东江环保	1,800	20,412.00	0.03
678	300287	飞利信	5,100	20,247.00	0.03
679	002635	安洁科技	1,500	20,235.00	0.03
680	300376	易事特	4,100	20,213.00	0.03
681	002254	泰和新材	1,900	20,102.00	0.03
682	002745	木林森	1,700	19,924.00	0.03
683	300297	蓝盾股份	3,300	19,899.00	0.03
684	600233	圆通速递	1,600	19,728.00	0.03
685	603198	迎驾贡酒	1,100	19,701.00	0.03
686	601016	节能风电	7,400	19,684.00	0.03
687	600978	宜华生活	5,200	19,552.00	0.03
688	600694	大商股份	700	19,537.00	0.03
689	002544	杰赛科技	1,500	19,500.00	0.03
690	300159	新研股份	3,900	19,422.00	0.03
691	000869	张裕 A	600	19,272.00	0.03
692	300266	兴源环境	4,200	19,068.00	0.03
693	300308	中际旭创	560	19,034.40	0.03
694	603766	隆鑫通用	4,500	18,855.00	0.02
695	600640	号百控股	1,400	18,732.00	0.02
696	600006	东风汽车	3,500	18,655.00	0.02
697	600757	长江传媒	2,700	18,387.00	0.02
698	601689	拓普集团	1,200	18,384.00	0.02

699	300199	翰宇药业	2,000	18,340.00	0.02
700	600623	华谊集团	2,400	18,336.00	0.02
701	603056	德邦股份	1,300	18,304.00	0.02
702	000501	鄂武商 A	1,690	18,167.50	0.02
703	000937	冀中能源	4,700	18,142.00	0.02
704	000990	诚志股份	1,100	18,051.00	0.02
705	002382	蓝帆医疗	1,300	17,966.00	0.02
706	603888	新华网	900	17,964.00	0.02
707	000062	深圳华强	1,350	17,941.50	0.02
708	600639	浦东金桥	1,100	17,787.00	0.02
709	600545	卓郎智能	2,500	17,775.00	0.02
710	002625	光启技术	1,910	17,743.90	0.02
711	600195	中牧股份	1,280	17,728.00	0.02
712	000426	兴业矿业	3,300	17,721.00	0.02
713	002503	搜于特	6,418	17,649.50	0.02
714	600869	智慧能源	3,900	17,628.00	0.02
715	601298	青岛港	2,100	17,619.00	0.02
716	600750	江中药业	1,350	17,563.50	0.02
717	600416	湘电股份	2,900	17,458.00	0.02
718	603568	伟明环保	810	17,431.20	0.02
719	002815	崇达技术	1,100	17,149.00	0.02
720	600329	中新药业	1,200	17,148.00	0.02
721	002375	亚厦股份	2,900	17,139.00	0.02
722	002709	天赐材料	700	16,940.00	0.02
723	601001	大同煤业	3,700	16,909.00	0.02
724	601212	白银有色	3,800	16,682.00	0.02
725	300257	开山股份	1,500	16,620.00	0.02
726	000537	广宇发展	2,400	16,608.00	0.02
727	000061	农产品	3,000	16,260.00	0.02
728	603377	东方时尚	1,060	16,196.80	0.02
729	600058	五矿发展	1,900	16,055.00	0.02

730	600707	彩虹股份	3,200	16,032.00	0.02
731	002489	浙江永强	4,800	16,032.00	0.02
732	002707	众信旅游	2,600	15,782.00	0.02
733	600874	创业环保	1,900	15,751.00	0.02
734	601127	小康股份	1,200	15,720.00	0.02
735	002920	德赛西威	700	15,680.00	0.02
736	600657	信达地产	3,800	15,656.00	0.02
737	601801	皖新传媒	2,600	15,626.00	0.02
738	002434	万里扬	2,300	15,617.00	0.02
739	600971	恒源煤电	2,660	15,561.00	0.02
740	002948	青岛银行	2,400	15,432.00	0.02
741	002437	誉衡药业	3,900	15,405.00	0.02
742	000536	华映科技	6,100	15,372.00	0.02
743	002517	恺英网络	4,800	15,312.00	0.02
744	601577	长沙银行	1,600	15,264.00	0.02
745	000829	天音控股	2,600	15,132.00	0.02
746	600996	贵广网络	1,400	15,092.00	0.02
747	000541	佛山照明	2,880	15,091.20	0.02
748	603806	福斯特	410	15,059.30	0.02
749	002509	天广中茂	7,300	15,038.00	0.02
750	601869	长飞光纤	400	15,000.00	0.02
751	600733	北汽蓝谷	1,800	14,868.00	0.02
752	002118	紫鑫药业	2,200	14,828.00	0.02
753	300459	金科文化	2,600	14,794.00	0.02
754	600098	广州发展	2,400	14,784.00	0.02
755	002512	达华智能	3,201	14,468.52	0.02
756	002681	奋达科技	3,411	14,462.64	0.02
757	600350	山东高速	3,000	14,400.00	0.02
758	002251	步步高	1,800	14,346.00	0.02
759	000766	通化金马	2,100	14,280.00	0.02
760	601139	深圳燃气	2,500	14,225.00	0.02

761	600428	中远海特	3,800	14,060.00	0.02
762	600053	九鼎投资	600	13,980.00	0.02
763	000552	靖远煤电	5,100	13,821.00	0.02
764	600299	安迪苏	1,300	13,481.00	0.02
765	603328	依顿电子	1,300	13,351.00	0.02
766	002936	郑州银行	2,600	13,208.00	0.02
767	600335	国机汽车	1,900	13,148.00	0.02
768	002482	广田集团	2,700	13,122.00	0.02
769	002818	富森美	1,020	13,086.60	0.02
770	002344	海宁皮城	2,800	13,048.00	0.02
771	600903	贵州燃气	1,000	13,030.00	0.02
772	601615	明阳智能	1,200	13,008.00	0.02
773	601003	柳钢股份	2,200	12,738.00	0.02
774	601777	力帆股份	2,900	12,441.00	0.02
775	603556	海兴电力	870	12,023.40	0.02
776	600939	重庆建工	2,400	11,736.00	0.02
777	000025	特力A	580	11,727.60	0.02
778	000987	越秀金控	1,200	10,824.00	0.01
779	600985	淮北矿业	900	10,206.00	0.01
780	002416	爱施德	1,600	10,000.00	0.01
781	601969	海南矿业	1,700	9,996.00	0.01
782	600126	杭钢股份	2,180	9,940.80	0.01
783	002699	美盛文化	1,601	9,606.00	0.01
784	603225	新凤鸣	756	9,442.44	0.01
785	600280	中央商场	2,500	8,975.00	0.01
786	601068	中铝国际	1,300	8,970.00	0.01
787	603355	莱克电气	400	8,608.00	0.01
788	601811	新华文轩	700	8,547.00	0.01
789	603486	科沃斯	280	8,470.00	0.01
790	603868	飞科电器	200	7,830.00	0.01
791	002941	新疆交建	300	7,800.00	0.01

792	000761	本钢板材	1,700	7,310.00	0.01
793	603650	彤程新材	300	6,552.00	0.01
794	002946	新乳业	400	6,056.00	0.01
795	600917	重庆燃气	800	5,568.00	0.01
796	603025	大豪科技	513	5,253.12	0.01
797	603569	长久物流	400	4,636.00	0.01
798	603877	太平鸟	200	3,104.00	0.00

7.3.2 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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	300782	卓胜微	446	48,578.32	0.06
2	600968	海油发展	12,639	44,868.45	0.06
3	601236	红塔证券	9,789	33,869.94	0.04
4	601698	中国卫通	8,251	32,343.92	0.04
5	300594	朗进科技	613	27,039.43	0.04
6	603867	新化股份	1,045	26,971.45	0.04
7	603863	松炆资源	508	11,724.64	0.02
8	600485	*ST信威	1,045	6,562.60	0.01

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	300498	温氏股份	603,621.00	0.71
2	601318	中国平安	488,465.00	0.57
3	600519	贵州茅台	430,877.00	0.51
4	600989	宝丰能源	270,838.72	0.32
5	601166	兴业银行	269,864.00	0.32
6	600036	招商银行	215,476.00	0.25

7	000333	美的集团	206,079.00	0.24
8	600276	恒瑞医药	141,759.00	0.17
9	000651	格力电器	140,122.00	0.16
10	601088	中国神华	134,359.00	0.16
11	000858	五粮液	115,578.00	0.14
12	000002	万科A	115,515.00	0.14
13	600030	中信证券	111,781.00	0.13
14	601668	中国建筑	110,047.00	0.13
15	600887	伊利股份	107,341.00	0.13
16	601108	财通证券	103,545.00	0.12
17	002948	青岛银行	103,284.64	0.12
18	600016	民生银行	100,493.00	0.12
19	002405	四维图新	100,465.00	0.12
20	601328	交通银行	99,216.00	0.12

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	601318	中国平安	1,641,725.00	1.93
2	600519	贵州茅台	1,066,740.00	1.25
3	600036	招商银行	817,260.94	0.96
4	601166	兴业银行	534,158.00	0.63
5	000333	美的集团	532,484.00	0.63
6	601328	交通银行	462,257.00	0.54
7	000651	格力电器	451,421.00	0.53
8	600989	宝丰能源	411,451.73	0.48
9	600016	民生银行	407,389.00	0.48
10	601288	农业银行	392,185.00	0.46

11	000002	万 科 A	358,888.58	0.42
12	600887	伊利股份	357,712.00	0.42
13	600000	浦发银行	336,767.00	0.40
14	601668	中国建筑	325,067.00	0.38
15	601398	工商银行	320,548.00	0.38
16	600030	中信证券	308,956.00	0.36
17	000858	五 粮 液	281,782.00	0.33
18	600276	恒瑞医药	278,548.00	0.33
19	600900	长江电力	269,280.00	0.32
20	000001	平安银行	266,004.00	0.31

注：本项的“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	19,608,503.66
卖出股票收入（成交）总额	41,844,435.95

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 投资组合报告附注

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

7.12.2 基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	39,432.32
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,047.77
5	应收申购款	252,937.36
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	293,417.45

7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明**

本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限情况。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	601236	红塔证券	33,869.94	0.04	新股未上市

7.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数 (户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
天弘中证800A	2,266	23,094.37	39,419,974.13	75.33%	12,911,869.66	24.67%
天弘中证800C	2,582	12,114.55	17,236,632.82	55.10%	14,043,133.09	44.90%
合计	4,848	17,246.62	56,656,606.95	67.76%	26,955,002.75	32.24%

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

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	天弘中证800A	445.73	0.00%

	天弘中证800 C	11,229.65	0.04%
	合计	11,675.38	0.01%

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800A	0
	天弘中证800C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	天弘中证800A	0
	天弘中证800C	0
	合计	0

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总 份额比例	发起份额总数	发起份 额占基 金总份 额比例	发起份 额承诺 持有期 限
基金管理人固有 资金	10,000,000.00	11.96%	10,000,000.00	11.96%	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	11.96%	10,000,000.00	11.96%	-

注：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07月16日至2018年07月16日。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	天弘中证800A	天弘中证800C
基金合同生效日(2015年07月16日)基金份额总额	5,000,000.00	5,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	78,540,308.17	40,760,635.12
本报告期基金总申购份额	20,407,793.19	34,656,952.18
减:本报告期基金总赎回份额	46,616,257.57	44,137,821.39
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	52,331,843.79	31,279,765.91

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 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生变化。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人及其高级管理人员没有发生受稽查或处罚的情况。

1、2019年3月25日，基金托管人广发证券收到广东证监局《关于对广发证券股份有限公司采取责令改正措施的决定》（广东证监局行政监管措施决定书[2019]20号），指出广发证券存在对境外子公司管控不到位，未有效督促境外子公司强化合规风险管理及

审慎开展业务等问题，决定对广发证券采取责令改正的行政监管措施，要求广发证券应于2019年6月30日之前予以改正，并向广东局提交书面整改报告。

对此，广发证券高度重视，将切实进行整改，采取措施建立并持续完善覆盖境外机构的合规管理、风险管理和内部控制体系，并及时向广东证监局报送了整改报告。

2、2019年4月19日，因基金托管人广发证券存在以低于成本价格参与公司债券项目投标的情形，广东证监局向广发证券下发了《关于对广发证券股份有限公司采取责令改正措施的决定》（广东证监局行政监管措施决定书【2019】28号），责成广发证券对相关问题予以改正，提交书面整改报告，并严格追究相关责任人员责任。

对此，广发证券高度重视，责令相关部门进行整改，组织对监管规定进行再学习，对相关人员进行内部问责，并及时向广东证监局报送了整改报告。

3、2019年8月5日，基金托管人广发证券收到《关于对广发证券股份有限公司采取限制业务活动措施的决定》（中国证券监督管理委员会行政监管措施决定书（2019）31号），因对广发控股（香港）有限公司风险管控缺失、合规管理存在缺陷、内部管控不足及未做好广发控股香港月度数据统计工作等问题，中国证券监督管理委员会对广发证券采取了限制增加场外衍生品业务规模6个月、限制增加新业务种类6个月的行政监管措施。

对此，广发证券高度重视，将切实进行整改，采取措施建立并持续完善覆盖境外机构的合规管理、风险管理和内部控制体系。

10.7 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	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
方正证券	1	23,478,629.73	39.11%	10,127.19	39.11%	-
西藏东方财富证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	3	36,553,985.62	60.89%	15,767.37	60.89%	-

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

信息服务。

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

3、本基金报告期内新租用交易单元：无。

4、本基金报告期内停止租用交易单元：无。

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	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参加中天证券股份有限公司申购及定投费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2019-01-07
2	天弘中证800指数型发起式证券投资基金2018年第4季度报告	中国证监会指定媒介	2019-01-22
3	天弘基金管理有限公司关于增加九江银行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	2019-01-29
4	天弘基金管理有限公司关于参加广发证券股份有限公司申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2019-02-25
5	天弘基金管理有限公司关于增加渤海银行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	2019-02-25
6	天弘基金管理有限公司关于增加中信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	2019-02-27
7	天弘基金管理有限公司关于增加中信证券（山东）有限责任公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投及转换业务的公告	中国证监会指定媒介	2019-02-27

8	天弘基金管理有限公司关于增加中信期货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	2019-02-27
9	天弘中证800指数型发起式证券投资基金招募说明书（更新）摘要	中国证监会指定媒介	2019-03-01
10	天弘中证800指数型发起式证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会指定媒介	2019-03-01
11	天弘基金管理有限公司关于增加国泰君安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	2019-03-19
12	天弘中证800指数型发起式证券投资基金2018年年度报告摘要	中国证监会指定媒介	2019-03-27
13	天弘中证800指数型发起式证券投资基金2018年年度报告	中国证监会指定媒介	2019-03-27
14	天弘基金管理有限公司关于变更官方APP名称的公告	中国证监会指定媒介	2019-03-28
15	天弘中证800指数型发起式证券投资基金2019年第1季度报告	中国证监会指定媒介	2019-04-19
16	天弘基金管理有限公司关于增加西藏东方财富股份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费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2019-04-29
17	天弘基金管理有限公司关于旗下基金在浙江金观诚基金销售有限公司暂停办理相关销售业务的公告	中国证监会指定媒介	2019-05-06
18	天弘基金管理有限公司关于在网上直销交易系统开通中国银行快捷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	2019-05-07
19	天弘基金管理有限公司关于增加江苏汇林保大基金销售有限公司为旗	中国证监会指定媒介	2019-05-10

	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费率优惠活动的公告		
20	天弘基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息的公告	中国证监会指定媒介	2019-05-30
21	天弘基金管理有限公司关于增加长城华西银行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、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	2019-06-04
22	天弘基金管理有限公司关于增加江苏银行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、转换业务的公告	中国证监会指定媒介	2019-06-06
23	天弘基金管理有限公司关于官网交易系统维护的通知	中国证监会指定媒介	2019-06-14
24	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资于科创板股票的公告	中国证监会指定媒介	2019-06-21
25	天弘基金管理有限公司关于官网交易系统维护的通知	中国证监会指定媒介	2019-06-21
26	天弘基金管理有限公司关于增加玄元保险代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费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2019-06-24
27	天弘基金管理有限公司关于增加杭州银行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、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	2019-06-24
28	天弘基金管理有限公司关于旗下基金在网上直销交易系统的中国银行直连渠道开展申购补差费优惠活动	中国证监会指定媒介	2019-06-25

	的公告		
29	天弘基金管理有限公司旗下基金2019年6月28日基金资产净值公告	中国证监会指定媒介	2019-06-28
30	天弘基金管理有限公司旗下基金2019年6月30日基金资产净值公告	中国证监会指定媒介	2019-06-30

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20190101-20190630	64,419,974.13	-	30,000,000.00	34,419,974.13	41.17%
	2	20190104-20190630	22,236,632.82	-	-	22,236,632.82	26.60%
产品特有风险							
<p>基金管理人秉承谨慎勤勉、独立决策、规范运作、充分披露原则，公平对待投资者，保障投资者合法权益。当单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%时，由此可能导致的特有风险主要包括：</p> <p>(1) 超出基金管理人允许的单一投资者持有基金份额比例的申购申请不被确认的风险；</p> <p>(2) 极端市场环境下投资者集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对赎回申请的风险；</p> <p>(3) 持有基金份额占比较高的投资者大额赎回可能引发基金净值大幅波动的风险；</p> <p>(4) 持有基金份额占比较高的投资者在召开基金份额持有人大会并对重大事项进行投票表决时，可能拥有较大话语权；</p> <p>(5) 极端情况下，持有基金份额占比较高的投资者大量赎回后，可能出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元而面临的转换基金运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等风险。</p>							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层

12.3 查阅方式

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

公司网站：www.thfund.com.cn

天弘基金管理有限公司
二〇一九年八月二十四日