

# 天弘量化驱动股票型证券投资基金

## 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:招商证券股份有限公司

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。

基金托管人招商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	10
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	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
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	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	错误!未定义书签。
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	错误!未定义书签。
§6 半年度财务会计报告(未经审计)	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	19
6.4 报表附注	20
§7 投资组合报告	44
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	45
7.3 期末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	46
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	53
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	55
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	55
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	56
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	56
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	56
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	56
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	56
7.12 投资组合报告附注	56
§8 基金份额持有人信息	57
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	57

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	57
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.....	58
§9 开放式基金份额变动.....	58
§10 重大事件揭示.....	59
10.1 基金份额持有人大会决议.....	59
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.....	59
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	59
10.4 基金投资策略的改变.....	59
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	59
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.....	59
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	59
10.8 其他重大事件.....	61
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	63
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.....	63
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	64
§12 备查文件目录.....	64
12.1 备查文件目录.....	64
12.2 存放地点.....	64
12.3 查阅方式.....	64

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	天弘量化驱动股票型证券投资基金	
基金简称	天弘量化驱动股票	
基金主代码	001556	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年01月18日	
基金管理人	天弘基金管理有限公司	
基金托管人	招商证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	41,005,396.23份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	天弘量化驱动股票A	天弘量化驱动股票C
下属分级基金的交易代码	001556	001557
报告期末下属分级基金的份额总额	14,404,514.20份	26,600,882.03份

### 2.2 基金产品说明

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

### 2.3 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	招商证券股份有限公司

信息披露负责人	姓名	童建林	张志斌
	联系电话	022-83310208	0755-82943666
	电子邮箱	service@thfund.com.cn	tgb@cmschina.com.cn
客户服务电话		95046	95565
传真		022-83865569	0755-82960794
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	深圳市福田区福田街道福华一路111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	深圳市福田区福田街道福华一路111号
邮政编码		300203	518000
法定代表人		井贤栋	霍达

## 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)	
	天弘量化驱动股票A	天弘量化驱动股票C

本期已实现收益	1,689,806.92	1,229,394.62
本期利润	2,124,422.17	1,664,774.23
加权平均基金份额本期利润	0.1347	0.0961
本期加权平均净值利润率	18.02%	13.04%
本期基金份额净值增长率	18.14%	17.90%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	报告期末(2019年06月30日)	
期末可供分配利润	-3,532,574.91	-6,782,469.07
期末可供分配基金份额利润	-0.2452	-0.2550
期末基金资产净值	10,871,939.29	19,818,412.96
期末基金份额净值	0.7548	0.7450
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	报告期末(2019年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	-18.03%	-18.52%

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》2018年01月18日起生效。

## 3.2 基金净值表现

### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

天弘量化驱动股票A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	2.51%	1.29%	0.77%	1.18%	1.74%	0.11%

过去三个月	-8.14%	1.66%	-9.02%	1.54%	0.88%	0.12%
过去六个月	18.14%	1.63%	16.38%	1.52%	1.76%	0.11%
过去一年	-2.74%	1.55%	-3.09%	1.43%	0.35%	0.12%
自基金转型 日起至今	-18.03%	1.49%	-16.46%	1.38%	-1.57%	0.11%

## 天弘量化驱动股票C

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	②-④
过去一个月	2.46%	1.29%	0.77%	1.18%	1.69%	0.11%
过去三个月	-8.24%	1.65%	-9.02%	1.54%	0.78%	0.11%
过去六个月	17.90%	1.63%	16.38%	1.52%	1.52%	0.11%
过去一年	-3.13%	1.55%	-3.09%	1.43%	-0.04%	0.12%
自基金转型 日起至今	-18.52%	1.49%	-16.46%	1.38%	-2.06%	0.11%

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

2、基金转型日，指天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金转型为天弘量化驱动股票型证券投资基金的日期，即 2018 年 01 月 18 日，下同。

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



天弘量化驱动股票A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2018年01月18日-2019年06月30日)



天弘量化驱动股票C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2018年01月18日-2019年06月30日)



注：1、本基金合同于2018年01月18日生效，本基金于2018年01月18日由天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金转型而成，名称相应变更为“天弘量化驱动股票型证券投资基金”。

2、按照本基金合同的约定，基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。本基金的建仓期为2018年01月18日至2018

年 07 月 17 日，建仓期结束时及至报告期末，各项资产配置比例均符合基金合同的约定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

天弘基金管理有限公司（以下简称“公司”或“本基金管理人”）经中国证监会证监基金字[2004]164号文批准，于2004年11月8日正式成立。注册资本金为5.143亿元人民币，总部设在天津，在北京、上海、广州、天津、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06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。	2018年01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。
沙川	本基金基金经理。	2018年01月	-	9年	男，数学硕士。历任中国中投证券有限责任公司量化分析师。2013年9月加盟本公司，历任金融工程研究员。

注：1、基金经理任职日期为转型后基金合同生效日期。

2、本基金已于2019年08月12日成功转型为“天弘中证500指数增强型证券投资基金”，基金经理由杨超先生、沙川先生任职。

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

## 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

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

本报告期内，本基金运作合法合规，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

## 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

### 4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

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

### 4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

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

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

## 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金在2019年上半年沿用了之前的自上而下的投资策略。首先，对各类资产的收益率进行预测并对风险进行估计，再采用优化的方法确定股票权重和优势风格指数；然后，对标该风格指数，通过优化方法，在约束风险因子的前提下，最大化股票组合的预期收益率（由因子模型进行估计，使用了估值、成长、盈利、流动性、量价等因子），以此来构建股票组合。

依据此策略，量化团队定期更新数据，再根据具体情况调整投资组合。

报告期内，我们仍以中证500指数作为优势风格指数，并相对基准股票比例进行超配。期间，用于预测股票收益率的因子表现正常，股票组合的表现好于中证500指数；且股票比例相对基准超配，在市场上涨的情况，仓位贡献了一定的正超额收益；整体来看基金表现好于基准，运行情况比较平稳。

### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2019年06月30日，天弘量化驱动股票A基金份额净值为0.7548元，天弘量化驱动股票C基金份额净值为0.7450元。报告期内份额净值增长率天弘量化驱动股票A为18.14%，天弘量化驱动股票C为17.90%，同期业绩比较基准增长率均为16.38%。

## 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

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

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

自2018年11月27日至2019年06月30日，本基金连续60个工作日以上基金资产净值低于5000万元，基金管理人已按照基金合同约定向中国证监会报告并提出解决方案。

截至报告披露前，基金管理人根据法律法规及《基金合同》相关规定决定以通讯方式召开基金份额持有人大会，会议审议通过《关于天弘量化驱动股票型证券投资基金转型有关事项的议案》，自2019年8月12日起，天弘量化驱动股票型证券投资基金正式转型为天弘中证500指数增强型证券投资基金。具体信息请参见基金管理人于2019年8月12日在指定媒介披露的《天弘基金管理有限公司关于天弘量化驱动股票型证券投资基金基金份额持有人大会决议生效的公告》。

## § 5 托管人报告

### 5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

### 5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

## § 6 半年度财务会计报告(未经审计)

### 6.1 资产负债表

会计主体：天弘量化驱动股票型证券投资基金

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
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	1,583,287.75	1,546,218.74
结算备付金		209,440.55	133,992.22
存出保证金		17,811.43	72,253.39
交易性金融资产	6.4.7.2	28,992,688.99	19,257,000.69
其中：股票投资		28,992,688.99	19,257,000.69
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	817.46	842.01
应收股利		-	-
应收申购款		167,879.48	64,264.43
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		30,971,925.66	21,074,571.48
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2019年06月30日</b>	<b>上年度末 2018年12月31日</b>
<b>负 债：</b>			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		16.00	-
应付赎回款		123,168.05	28,902.18
应付管理人报酬		37,143.75	26,739.89
应付托管费		6,190.63	4,456.63
应付销售服务费		6,383.42	3,296.50
应付交易费用	6.4.7.7	29,292.93	28,468.15
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	79,378.63	340,010.69



负债合计		281,573.41	431,874.04
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	41,005,396.23	32,476,848.49
未分配利润	6.4.7.10	-10,315,043.98	-11,834,151.05
所有者权益合计		30,690,352.25	20,642,697.44
负债和所有者权益总计		30,971,925.66	21,074,571.48

注：1、报告截止日2019年06月30日，天弘量化驱动股票型证券投资基金A类基金份额净值0.7548元，天弘量化驱动股票型证券投资基金C类基金份额净值0.7450元；基金份额总额41,005,396.23份，其中天弘量化驱动股票型证券投资基金A类基金份额14,404,514.20份，天弘量化驱动股票型证券投资基金C类基金份额26,600,882.03份。

2、本财务报表的比较期间为2018年01月18日(基金合同生效日)至2018年06月30日（下同）。

## 6.2 利润表

会计主体：天弘量化驱动股票型证券投资基金

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日至2019年06月30日	上年度可比期间 2018年01月18日(基金合同生效日)至2018年06月30日
<b>一、收入</b>		4,234,250.99	-8,781,939.92
1. 利息收入		14,603.57	60,453.35
其中：存款利息收入	6.4.7.11	14,603.57	41,942.11
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	18,511.24
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”		3,318,542.57	3,625,595.50

填列)			
其中：股票投资收益	6.4.7.12	3,044,709.92	3,316,219.85
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-	-
资产支持证券投资 收益	6.4.7.13. 2	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	-	-
股利收益	6.4.7.15	273,832.65	309,375.65
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	6.4.7.16	869,994.86	-12,839,577.42
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	6.4.7.17	31,109.99	371,588.65
<b>减：二、费用</b>		445,054.59	907,450.38
1. 管理人报酬	6.4.10.2. 1	181,506.52	324,501.41
2. 托管费	6.4.10.2. 2	30,251.04	54,083.59
3. 销售服务费	6.4.10.2. 3	25,109.27	55,316.27
4. 交易费用	6.4.7.18	128,846.41	400,773.51
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.19	79,341.35	72,775.60
<b>三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）</b>		3,789,196.40	-9,689,390.30
减：所得税费用		-	-
<b>四、净利润（净亏损以“-”</b>		3,789,196.40	-9,689,390.30

号填列)			
------	--	--	--

### 6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：天弘量化驱动股票型证券投资基金

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)	32,476,848.49	-11,834,151.05	20,642,697.44
二、本期经营活动产生 的基金净值变动 数(本期利润)	-	3,789,196.40	3,789,196.40
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)	8,528,547.74	-2,270,089.33	6,258,458.41
其中：1. 基金申购款	25,827,393.28	-6,151,402.04	19,675,991.24
2. 基金赎回 款	-17,298,845.54	3,881,312.71	-13,417,532.83
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)	41,005,396.23	-10,315,043.98	30,690,352.25
项 目	上年度可比期间 2018年01月18日（基金合同生效日）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)	104,163,445.56	-8,801,887.68	95,361,557.88

二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-9,689,390.30	-9,689,390.30
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	-44,484,548.99	4,839,993.90	-39,644,555.09
其中：1. 基金申购款	76,648,621.84	-10,250,400.29	66,398,221.55
2. 基金赎回款	-121,133,170.83	15,090,394.19	-106,042,776.64
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	59,678,896.57	-13,651,284.08	46,027,612.49

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

郭树强

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

天弘量化驱动股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)系由原天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金(以下简称“原基金”)转型而来。本基金合同生效日为2018年1月18日,本基金的基金管理人为天弘基金管理有限公司,基金托管人为招商证券股份有限公司。

根据原基金基金份额持有人大会以通讯方式通过的《关于天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金转型有关事项的议案》,基金管理人天弘基金管理有限公司于2018年1月18日发布了《关于天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金基金份额持有人大会决议生效的公告》。根据《天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金转型方案说明书》以及相关法律法规的规定,经与基金托管人招商证券股份有限公司协

商一致，基金管理人已将《天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金基金合同》、《天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金托管协议》修订为《天弘量化驱动股票型证券投资基金基金合同》、《天弘量化驱动股票型证券投资基金托管协议》，并据此更新了《天弘量化驱动股票型证券投资基金招募说明书》，上述文件已经中国证监会变更注册。《天弘量化驱动股票型证券投资基金基金合同》和《天弘量化驱动股票型证券投资基金托管协议》自《关于天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金基金份额持有人大会决议生效的公告》发布之日，即2018年1月18日起生效，原《天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金基金合同》、《天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金托管协议》将自同日失效。

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘量化驱动股票型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资对象是具有良好流动性的金融工具，包括国内依法发行上市的股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券(包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、地方政府债券、中小企业私募债券、可转换债券(含分离交易可转债)、可交易债券及其他经中国证监会允许投资的债券)、债券回购、资产支持证券、银行存款、同业存单、货币市场工具、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金投资于股票的资产比例不低于基金资产的80%；投资于权证的资产比例不低于基金资产的3%，本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款。本基金的业绩比较基准：中证500指数收益率×85%+中证综合债券指数收益率×15%。

#### 6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁

布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《天弘量化驱动股票型证券投资基金基金合同》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	1,583,287.75
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	1,583,287.75

### 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	29,524,122.25	28,992,688.99	-531,433.26
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	29,524,122.25	28,992,688.99	-531,433.26

#### 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	715.66
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	93.80
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	8.00
合计	817.46

注：其他为应收交易保证金利息。

#### 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	29,292.93
银行间市场应付交易费用	-
合计	29,292.93

#### 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	37.28
预提费用	79,341.35
合计	79,378.63

#### 6.4.7.9 实收基金

##### 6.4.7.9.1 天弘量化驱动股票A

金额单位：人民币元

项目 (天弘量化驱动股票A)	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	17,221,722.02	17,221,722.02
本期申购	4,278,897.67	4,278,897.67
本期赎回(以“-”号填列)	-7,096,105.49	-7,096,105.49
本期末	14,404,514.20	14,404,514.20

## 6.4.7.9.2 天弘量化驱动股票C

金额单位：人民币元

项目 (天弘量化驱动股票C)	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	15,255,126.47	15,255,126.47
本期申购	21,548,495.61	21,548,495.61
本期赎回(以“-”号填列)	-10,202,740.05	-10,202,740.05
本期末	26,600,882.03	26,600,882.03

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 天弘量化驱动股票A

单位：人民币元

项目 (天弘量化驱动股票A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-5,334,825.93	-884,165.15	-6,218,991.08
本期利润	1,689,806.92	434,615.25	2,124,422.17
本期基金份额交易产生的变动数	656,273.99	-94,279.99	561,994.00
其中：基金申购款	-1,026,102.81	36,097.65	-990,005.16
基金赎回款	1,682,376.80	-130,377.64	1,551,999.16
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,988,745.02	-543,829.89	-3,532,574.91

## 6.4.7.10.2 天弘量化驱动股票C

单位：人民币元

项目 (天弘量化驱动股票C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-4,824,971.46	-790,188.51	-5,615,159.97
本期利润	1,229,394.62	435,379.61	1,664,774.23
本期基金份额交易产生的变动数	-2,167,921.13	-664,162.20	-2,832,083.33
其中：基金申购款	-4,656,452.64	-504,944.24	-5,161,396.88
基金赎回款	2,488,531.51	-159,217.96	2,329,313.55
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-5,763,497.97	-1,018,971.10	-6,782,469.07

## 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	13,270.21
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	955.18
其他	378.18
合计	14,603.57

## 6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日
卖出股票成交总额	67,927,525.75
减：卖出股票成本总额	64,882,815.83
买卖股票差价收入	3,044,709.92

## 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	273,832.65
基金投资产生的股利收益	-
合计	273,832.65

**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	869,994.86
——股票投资	869,994.86
——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	869,994.86

#### 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	30,573.92
基金转换费收入	536.07
合计	31,109.99

#### 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	128,846.41
银行间市场交易费用	-
合计	128,846.41

#### 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
合计	79,341.35

### 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
招商证券股份有限公司（“招商证券”）	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18日（基金合同生效日） 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
招商证券股份有限公司（“招商证券”）	63,463,908.41	44.83%	34,996,234.41	9.06%

##### 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
招商证券股份有限公司（“招商证券”）	14,676.03	30.34%	8,149.69	27.82%
关联方名称	上年度可比期间 2018年01月18日（基金合同生效日）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
招商证券股份有限公司（“招商证券”）	8,094.07	5.07%	8,094.07	18.40%

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

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

#### 6.4.10.2 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18日（基金合同 生效日）至2018年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	181,506.52	324,501.41

其中：支付销售机构的客户维护费	41,000.55	70,256.90
-----------------	-----------	-----------

注：1、支付基金管理人天弘基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬 = 前一日基金资产净值 X 1.50% / 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 2019年01月01日 至2019年06月30 日	上年度可比期间 2018年01月18日（基金合同生 效日）至2018年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	30,251.04	54,083.59

注：支付基金托管人招商证券股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值 0.25% 的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费 = 前一日基金资产净值 X 0.25% / 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		
	天弘量化驱动股票A	天弘量化驱动股票C	合计
天弘基金 管理有限 公司	-	12,115.86	12,115.86
合计	-	12,115.86	12,115.86
获得销售 服务费的 各关联方	上年度可比期间 2018年01月18日（基金合同生效日）至2018年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		



名称	天弘量化驱动股票A	天弘量化驱动股票C	合计
天弘基金管理有限公司	-	32,413.74	32,413.74
合计	-	32,413.74	32,413.74

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0.40%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X0.40%/当年天数。

2、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

天弘量化驱动股票A

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18日（基金合同 生效日）至2018年06月30日
基金合同生效日（2018年01月18日）持有的基金份额	5,000,000.00	5,000,000.00
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

额		
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	34.71%	25.45%

天弘量化驱动股票C

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18日（基金合同 生效日）至2018年06月30日
基金合同生效日（2018年01月18日）持有的基金份额	5,000,000.00	5,000,000.00
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	18.80%	5.92%

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 2019年01月01日至2019年06月30日		上年度可比期间 2018年01月18日（基金合同生效日） 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
招商证券股份有限公司	1,583,287.75	13,270.21	4,081,797.49	37,240.70

注：本基金的银行存款由基金托管人招商证券股份有限公司保管，存放在具有基金托管资格的交通银行股份有限公司，按银行同业利率或约定利率计息。

#### 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期间无须作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

#### 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	新股未上市	3.46	3.46	7,733	26,756.18	26,756.18	-

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	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
000029	深深房A	2016-09-14	重大资产重组	10.97	-	-	6,704	78,333.49	73,542.88	-

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**

本基金为股票型基金，属于较高风险、较高收益预期的基金品种，其风险收益预期高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金投资的金融工具主要包括权益类和固定收益类金融工具等。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在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。

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同责任，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。本基金的活期银行存款存放在由本基金托管人招商证券股份有限公司开立于具有基金托管资格的交通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 market 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期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

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

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注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0.33%。

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	1,583,287.75	-	-	-	1,583,287.75
结算备付金	209,440.55	-	-	-	209,440.55
存出保	17,811.43	-	-	-	17,811.43

证金					
交易性金融资产	-	-	-	28,992,688.99	28,992,688.99
应收利息	-	-	-	817.46	817.46
应收申购款	-	-	-	167,879.48	167,879.48
资产总计	1,810,539.73	-	-	29,161,385.93	30,971,925.66
负债					
应付证券清算款	-	-	-	16.00	16.00
应付赎回款	-	-	-	123,168.05	123,168.05
应付管理人报酬	-	-	-	37,143.75	37,143.75
应付托管费	-	-	-	6,190.63	6,190.63
应付销售服务费	-	-	-	6,383.42	6,383.42
应付交易费用	-	-	-	29,292.93	29,292.93
其他负债	-	-	-	79,378.63	79,378.63
负债总计	-	-	-	281,573.41	281,573.41
利率敏感度缺口	1,810,539.73	-	-	28,879,812.52	30,690,352.25
上年度	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计



末2018 年12月 31日					
资产					
银行存款	1,546,218.74	-	-	-	1,546,218.74
结算备付金	133,992.22	-	-	-	133,992.22
存出保证金	72,253.39	-	-	-	72,253.39
交易性金融资产	-	-	-	19,257,000.69	19,257,000.69
应收利息	-	-	-	842.01	842.01
应收申购款	-	-	-	64,264.43	64,264.43
资产总计	1,752,464.35	-	-	19,322,107.13	21,074,571.48
负债					
应付赎回款	-	-	-	28,902.18	28,902.18
应付管理人报酬	-	-	-	26,739.89	26,739.89
应付托管费	-	-	-	4,456.63	4,456.63
应付销售服务费	-	-	-	3,296.50	3,296.50
应付交易费用	-	-	-	28,468.15	28,468.15
其他负债	-	-	-	340,010.69	340,010.69

债					
负债总计	-	-	-	431,874.04	431,874.04
利率敏感度缺口	1,752,464.35	-	-	18,890,233.09	20,642,697.44

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或银行间同业市场上市交易的股票和债券，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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金股票投资占基金资产的比例不低于基金资产的80%，投资于权证的比例不超过基金资产净值的3%，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。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	28,992,688.99	94.47	19,257,000.69	93.29
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	28,992,688.99	94.47	19,257,000.69	93.29

#### 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%	1,688,604.86	1,066,028.03
	业绩比较基准(附注6.4.1)下降5%	-1,688,604.86	-1,066,028.03

#### 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28,892,389.93元，属于第二层次的余额为100,299.06元，无属于第三层次的余额(2018年12月31日：第一层次18,875,457.01元，第二层次381,543.68元，无第三层次)。

(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

无。

(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	28,992,688.99	93.61

	其中：股票	28,992,688.99	93.61
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	1,792,728.30	5.79
8	其他各项资产	186,508.37	0.60
9	合计	30,971,925.66	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	853,573.00	2.78
B	采矿业	873,775.45	2.85
C	制造业	15,174,322.04	49.44
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,003,200.00	3.27
E	建筑业	411,842.00	1.34
F	批发和零售业	592,473.00	1.93
G	交通运输、仓储和邮政业	1,248,960.00	4.07
H	住宿和餐饮业	125,860.00	0.41
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,313,079.64	7.54
J	金融业	1,483,592.18	4.83
K	房地产业	1,658,614.68	5.40
L	租赁和商务服务业	795,579.00	2.59
M	科学研究和技术服务业	125,454.00	0.41
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-

O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	388,559.00	1.27
Q	卫生和社会工作	534,552.00	1.74
R	文化、体育和娱乐业	673,593.00	2.19
S	综合	735,660.00	2.40
	合计	28,992,688.99	94.47

### 7.3 期末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	002195	二三四五	137,200	533,708.00	1.74
2	002299	圣农发展	20,400	516,528.00	1.68
3	600325	华发股份	62,600	488,906.00	1.59
4	000778	新兴铸管	108,100	479,964.00	1.56
5	600026	中远海能	72,300	469,227.00	1.53
6	002440	闰土股份	37,200	463,512.00	1.51
7	600673	东阳光	58,800	461,580.00	1.50
8	600143	金发科技	93,700	459,130.00	1.50
9	000596	古井贡酒	3,800	450,338.00	1.47
10	601958	金钼股份	66,800	447,560.00	1.46
11	600169	太原重工	166,300	444,021.00	1.45
12	000027	深圳能源	71,500	443,300.00	1.44
13	002129	中环股份	44,100	430,416.00	1.40
14	600125	铁龙物流	61,700	397,965.00	1.30
15	002607	中公教育	28,300	388,559.00	1.27
16	002110	三钢闽光	41,650	387,345.00	1.26
17	600699	均胜电子	18,100	386,616.00	1.26

18	300244	迪安诊断	22,400	380,352.00	1.24
19	601555	东吴证券	35,900	367,975.00	1.20
20	600820	隧道股份	57,600	363,456.00	1.18
21	601615	明阳智能	33,000	357,720.00	1.17
22	000006	深振业 A	64,400	350,980.00	1.14
23	300058	蓝色光标	78,800	336,476.00	1.10
24	000732	泰禾集团	19,400	320,100.00	1.04
25	600745	闻泰科技	9,600	318,912.00	1.04
26	603816	顾家家居	9,980	318,561.60	1.04
27	002859	洁美科技	12,100	318,230.00	1.04
28	600409	三友化工	55,600	314,696.00	1.03
29	002402	和而泰	33,000	312,510.00	1.02
30	601100	恒立液压	9,900	310,662.00	1.01
31	600079	人福医药	29,200	306,600.00	1.00
32	002670	国盛金控	24,300	306,180.00	1.00
33	002092	中泰化学	38,000	302,480.00	0.99
34	002745	木林森	25,500	298,860.00	0.97
35	600329	中新药业	20,600	294,374.00	0.96
36	002603	以岭药业	25,300	292,974.00	0.95
37	300133	华策影视	43,300	291,409.00	0.95
38	300168	万达信息	22,100	286,637.00	0.93
39	002399	海普瑞	13,300	279,167.00	0.91
40	600643	爱建集团	28,700	274,946.00	0.90
41	000009	中国宝安	48,000	274,080.00	0.89
42	600008	首创股份	77,300	272,096.00	0.89
43	002152	广电运通	39,100	267,835.00	0.87
44	002920	德赛西威	11,700	262,080.00	0.85
45	002028	思源电气	25,900	257,964.00	0.84
46	002233	塔牌集团	21,800	254,624.00	0.83
47	000600	建投能源	37,400	250,580.00	0.82
48	600872	中炬高新	5,700	244,131.00	0.80

49	000031	大悦城	37,500	240,750.00	0.78
50	002797	第一创业	37,800	239,652.00	0.78
51	002434	万里扬	34,600	234,934.00	0.77
52	600809	山西汾酒	3,300	227,865.00	0.74
53	002414	高德红外	11,850	227,520.00	0.74
54	603355	莱克电气	10,400	223,808.00	0.73
55	000513	丽珠集团	6,500	215,995.00	0.70
56	002458	益生股份	10,200	199,002.00	0.65
57	600887	伊利股份	5,800	193,778.00	0.63
58	002701	奥瑞金	41,100	191,937.00	0.63
59	600373	中文传媒	15,100	189,656.00	0.62
60	601231	环旭电子	15,500	186,775.00	0.61
61	300383	光环新网	10,900	182,793.00	0.60
62	601872	招商轮船	39,900	173,964.00	0.57
63	002698	博实股份	18,800	169,952.00	0.55
64	000661	长春高新	500	169,000.00	0.55
65	300146	汤臣倍健	8,700	168,780.00	0.55
66	603444	吉比特	800	167,968.00	0.55
67	000061	农产品	30,900	167,478.00	0.55
68	000028	国药一致	4,000	167,320.00	0.55
69	002929	润建股份	5,500	166,430.00	0.54
70	600536	中国软件	3,100	166,377.00	0.54
71	002410	广联达	4,900	161,161.00	0.53
72	300347	泰格医药	2,000	154,200.00	0.50
73	002818	富森美	12,000	153,960.00	0.50
74	300134	大富科技	9,800	152,194.00	0.50
75	000725	京东方A	43,400	149,296.00	0.49
76	000877	天山股份	12,100	140,602.00	0.46
77	600655	豫园股份	17,100	140,049.00	0.46
78	000937	冀中能源	35,900	138,574.00	0.45
79	601336	新华保险	2,500	137,575.00	0.45



80	002251	步步高	17,100	136,287.00	0.44
81	000089	深圳机场	15,000	133,350.00	0.43
82	000983	西山煤电	21,900	132,714.00	0.43
83	000738	航发控制	9,900	132,660.00	0.43
84	000932	华菱钢铁	27,160	129,553.20	0.42
85	002074	国轩高科	9,723	127,468.53	0.42
86	600258	首旅酒店	7,000	125,860.00	0.41
87	002912	中新赛克	1,300	122,031.00	0.40
88	600312	平高电气	15,800	121,502.00	0.40
89	002672	东江环保	10,700	121,338.00	0.40
90	600598	北大荒	11,300	121,249.00	0.40
91	002353	杰瑞股份	5,000	115,500.00	0.38
92	600563	法拉电子	2,800	115,276.00	0.38
93	600645	中源协和	6,600	114,246.00	0.37
94	601098	中南传媒	9,000	113,760.00	0.37
95	300274	阳光电源	12,100	113,135.00	0.37
96	601718	际华集团	28,500	111,435.00	0.36
97	600801	华新水泥	5,460	110,565.00	0.36
98	002127	南极电商	9,700	109,028.00	0.36
99	002815	崇达技术	6,900	107,571.00	0.35
100	002208	合肥城建	13,420	107,225.80	0.35
101	600764	中国海防	3,600	100,368.00	0.33
102	600316	洪都航空	7,000	100,170.00	0.33
103	300418	昆仑万维	7,600	97,812.00	0.32
104	000630	铜陵有色	36,800	90,528.00	0.29
105	600967	内蒙一机	7,900	88,480.00	0.29
106	603712	七一二	4,100	87,043.00	0.28
107	600633	浙数文化	9,300	86,955.00	0.28
108	000878	云南铜业	8,000	85,040.00	0.28
109	002189	中光学	3,700	84,138.00	0.27
110	000623	吉林敖东	5,100	83,589.00	0.27

111	002078	太阳纸业	12,200	83,082.00	0.27
112	002128	露天煤业	9,400	81,310.00	0.26
113	000636	风华高科	6,700	81,070.00	0.26
114	002221	东华能源	9,400	80,934.00	0.26
115	002313	日海智能	3,700	74,740.00	0.24
116	000029	深深房A	6,704	73,542.88	0.24
117	002384	东山精密	5,000	72,850.00	0.24
118	002747	埃斯顿	8,000	70,320.00	0.23
119	601009	南京银行	8,500	70,210.00	0.23
120	600884	杉杉股份	6,300	67,095.00	0.22
121	300003	乐普医疗	2,800	64,456.00	0.21
122	600161	天坛生物	2,400	60,600.00	0.20
123	603766	隆鑫通用	14,300	59,917.00	0.20
124	002699	美盛文化	9,900	59,400.00	0.19
125	600166	福田汽车	24,900	59,013.00	0.19
126	600062	华润双鹤	4,600	58,006.00	0.19
127	600755	厦门国贸	6,700	57,821.00	0.19
128	601179	中国西电	15,200	56,240.00	0.18
129	603363	傲农生物	2,900	55,564.00	0.18
130	600350	山东高速	11,400	54,720.00	0.18
131	300059	东方财富	3,960	53,658.00	0.17
132	300450	先导智能	1,500	50,400.00	0.16
133	002665	首航节能	14,800	50,172.00	0.16
134	600410	华胜天成	4,600	49,358.00	0.16
135	002517	恺英网络	14,300	45,617.00	0.15
136	000970	中科三环	3,800	43,130.00	0.14
137	002358	森源电气	4,200	42,630.00	0.14
138	601808	中海油服	4,100	39,483.00	0.13
139	000962	东方钨业	4,900	38,710.00	0.13
140	002465	海格通信	4,000	38,160.00	0.12
141	600163	中闽能源	8,800	37,224.00	0.12

142	002230	科大讯飞	1,100	36,564.00	0.12
143	600094	大名城	5,700	35,853.00	0.12
144	002051	中工国际	3,000	34,410.00	0.11
145	600064	南京高科	3,200	34,272.00	0.11
146	600908	无锡银行	6,000	33,840.00	0.11
147	002250	联化科技	3,000	33,270.00	0.11
148	300166	东方国信	2,700	33,183.00	0.11
149	002489	浙江永强	9,900	33,066.00	0.11
150	002916	深南电路	300	30,576.00	0.10
151	600418	江淮汽车	5,700	29,412.00	0.10
152	600183	生益科技	1,900	28,595.00	0.09
153	002371	北方华创	400	27,700.00	0.09
154	601236	红塔证券	7,733	26,756.18	0.09
155	603000	人民网	1,500	26,745.00	0.09
156	002368	太极股份	800	24,240.00	0.08
157	002439	启明星辰	900	24,210.00	0.08
158	002281	光迅科技	900	23,832.00	0.08
159	000858	五粮液	200	23,590.00	0.08
160	600053	九鼎投资	1,000	23,300.00	0.08
161	601012	隆基股份	1,000	23,110.00	0.08
162	601865	福莱特	2,200	22,352.00	0.07
163	000887	中鼎股份	2,300	22,057.00	0.07
164	600664	哈药股份	5,300	21,942.00	0.07
165	002463	沪电股份	1,600	21,792.00	0.07
166	603612	索通发展	1,900	20,349.00	0.07
167	601928	凤凰传媒	2,400	19,368.00	0.06
168	300782	卓胜微	173	18,843.16	0.06
169	600968	海油发展	5,079	18,030.45	0.06
170	002563	森马服饰	1,600	17,696.00	0.06
171	603360	百傲化学	700	17,640.00	0.06
172	002234	民和股份	600	16,794.00	0.05

173	600123	兰花科创	2,200	16,104.00	0.05
174	300324	旋极信息	2,600	15,054.00	0.05
175	603867	新化股份	557	14,376.17	0.05
176	002460	赣锋锂业	600	14,058.00	0.05
177	002812	恩捷股份	300	14,025.00	0.05
178	600834	申通地铁	1,800	14,004.00	0.05
179	600557	康缘药业	900	13,374.00	0.04
180	601698	中国卫通	3,367	13,198.64	0.04
181	600138	中青旅	900	11,421.00	0.04
182	300384	三联虹普	600	11,208.00	0.04
183	002707	众信旅游	1,700	10,319.00	0.03
184	600826	兰生股份	900	10,062.00	0.03
185	300033	同花顺	100	9,836.00	0.03
186	300517	海波重科	600	9,744.00	0.03
187	002095	生意宝	400	9,544.00	0.03
188	002605	姚记扑克	900	9,450.00	0.03
189	002507	涪陵榨菜	300	9,150.00	0.03
190	300088	长信科技	1,600	8,096.00	0.03
191	600177	雅戈尔	1,100	6,985.00	0.02
192	600790	轻纺城	1,900	6,897.00	0.02
193	300487	蓝晓科技	200	6,304.00	0.02
194	000723	美锦能源	600	6,270.00	0.02
195	000333	美的集团	115	5,963.90	0.02
196	600787	中储股份	1,000	5,730.00	0.02
197	600307	酒钢宏兴	2,800	5,684.00	0.02
198	002567	唐人神	400	4,620.00	0.02
199	600572	康恩贝	700	4,480.00	0.01
200	601669	中国电建	800	4,232.00	0.01
201	300257	开山股份	356	3,944.48	0.01
202	600282	南钢股份	1,000	3,500.00	0.01
203	601311	骆驼股份	300	3,255.00	0.01

204	300118	东方日升	300	3,054.00	0.01
205	002318	久立特材	400	2,924.00	0.01
206	603895	天永智能	100	2,458.00	0.01
207	002302	西部建设	200	2,228.00	0.01
208	002936	郑州银行	400	2,032.00	0.01
209	002366	台海核电	200	1,872.00	0.01
210	002839	张家港行	200	1,126.00	0.00
211	000488	晨鸣纸业	200	1,072.00	0.00
212	002506	协鑫集成	100	668.00	0.00

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	002299	圣农发展	713,734.00	3.46
2	000031	大悦城	646,232.00	3.13
3	002920	德赛西威	643,679.00	3.12
4	300133	华策影视	615,287.00	2.98
5	002028	思源电气	612,811.00	2.97
6	600655	豫园股份	571,517.00	2.77
7	002463	沪电股份	566,193.00	2.74
8	002195	二三四五	565,996.00	2.74
9	600325	华发股份	539,487.00	2.61
10	600598	北大荒	526,857.00	2.55
11	002440	闰土股份	521,441.00	2.53
12	002371	北方华创	510,477.00	2.47
13	000778	新兴铸管	504,071.00	2.44
14	000596	古井贡酒	496,838.00	2.41
15	600673	东阳光	488,603.00	2.37
16	000656	金科股份	472,741.00	2.29

17	000600	建投能源	470,401.00	2.28
18	600600	青岛啤酒	469,249.00	2.27
19	300058	蓝色光标	468,944.00	2.27
20	600026	中远海能	467,551.00	2.26
21	600079	人福医药	463,234.00	2.24
22	600143	金发科技	462,362.00	2.24
23	300347	泰格医药	459,974.68	2.23
24	600169	太原重工	448,319.00	2.17
25	002129	中环股份	446,736.00	2.16
26	600125	铁龙物流	444,919.00	2.16
27	000027	深圳能源	443,715.00	2.15
28	600820	隧道股份	442,102.00	2.14
29	300244	迪安诊断	437,064.00	2.12
30	002280	联络互动	436,163.00	2.11
31	601958	金钼股份	434,836.00	2.11
32	600699	均胜电子	432,332.00	2.09
33	000090	天健集团	431,747.00	2.09
34	600094	大名城	427,019.93	2.07
35	000006	深振业A	426,658.00	2.07
36	300168	万达信息	417,405.71	2.02
37	002701	奥瑞金	415,567.00	2.01

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	600094	大名城	623,950.33	3.02
2	000656	金科股份	615,212.00	2.98
3	002280	联络互动	583,930.00	2.83

4	600600	青岛啤酒	561,232.00	2.72
5	002463	沪电股份	517,463.00	2.51
6	300498	温氏股份	511,242.00	2.48
7	000988	华工科技	492,561.00	2.39
8	002056	横店东磁	487,572.39	2.36
9	002030	达安基因	471,109.90	2.28
10	000060	中金岭南	458,509.00	2.22
11	600580	卧龙电驱	457,112.00	2.21
12	002371	北方华创	455,370.00	2.21
13	600598	北大荒	453,470.00	2.20
14	600729	重庆百货	451,016.40	2.18
15	600039	四川路桥	447,888.00	2.17
16	600216	浙江医药	440,156.00	2.13
17	002444	巨星科技	418,130.64	2.03
18	002920	德赛西威	416,107.00	2.02
19	601099	太平洋	415,697.00	2.01
20	600388	龙净环保	414,103.00	2.01

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	73,748,509.27
卖出股票收入（成交）总额	67,927,525.75

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	17,811.43
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	817.46
5	应收申购款	167,879.48
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	186,508.37



**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**

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

**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 量化 驱动 股票A	3,840	3,751.18	5,000,000.00	34.71%	9,404,514.20	65.29%
天弘 量化 驱动 股票C	2,261	11,765.10	18,294,336.61	68.77%	8,306,545.42	31.23%
合计	6,101	6,721.09	23,294,336.61	56.81%	17,711,059.62	43.19%

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	天弘量化驱动股票A	22,192.58	0.15%
	天弘量化驱动股票C	50,398.95	0.19%
	合计	72,591.53	0.18%

### 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	天弘量化驱动股票A	0
	天弘量化驱动股票C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	天弘量化驱动股票A	0
	天弘量化驱动股票C	0
	合计	0

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

	天弘量化驱动股票A	天弘量化驱动股票C
基金合同生效日(2018年01月18日)基金份额总额	19,649,870.98	84,513,574.58
本报告期期初基金份额总额	17,221,722.02	15,255,126.47
本报告期基金总申购份额	4,278,897.67	21,548,495.61
减：本报告期基金总赎回份额	7,096,105.49	10,202,740.05
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	14,404,514.20	26,600,882.03

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

截至报告披露前，基金管理人根据法律法规及《基金合同》相关规定以通讯方式召开基金份额持有人大会，会议审议通过《关于天弘量化驱动股票型证券投资基金转型有关事项的议案》。根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的有关规定，基金份额持有人决定的事项自表决通过之日起生效。本基金管理人已将表决通过的事项报中国证监会备案。自2019年8月12日起，原《天弘量化驱动股票型证券投资基金基金合同》、《天弘量化驱动股票型证券投资基金托管协议》失效，《天弘中证500指数增强型证券投资基金基金合同》、《天弘中证500指数增强型证券投资基金托管协议》同日起生效。

### 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未发生重大人事变动。

2019年04月09日，本基金托管人招商证券股份有限公司聘任易卫东担任托管部总经理，秦湘不再担任托管部总经理。

### 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

截至报告披露前，转型后的天弘中证500指数增强型证券投资基金与原天弘量化驱动股票型证券投资基金相比，在投资目标、投资范围、投资策略、投资限制、业绩比较基准、风险收益特征等内容均有所调整。调整后的上述内容可查阅本基金管理人在指定媒介披露的《天弘中证500指数增强型证券投资基金基金合同》中的相关约定。

### 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、托管人及其高级管理人员没有发生受稽查或处罚的情况。

### 10.7 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	
华泰证券	1	-	-	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
天风证券	1	-	-	-	-	-
兴业证券	1	78,114,727.36	55.17%	33,691.67	69.66%	-
招商证券	4	63,463,908.41	44.83%	14,676.03	30.34%	-
西藏东方财富证券	2	-	-	-	-	-
光大证券	2	-	-	-	-	-

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

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

3、本基金报告期内新租用交易单元：2个，其中包括招商证券上海交易单元1个，招商证券深圳交易单元1个。

4、本基金报告期内停止租用交易单元：无。

## 10.8 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	天弘量化驱动股票型证券投资基金2018年第四季度报告	中国证监会指定媒介	2019-01-22
2	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
3	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
4	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
5	天弘量化驱动股票型证券投资基金招募说明书（更新）摘要	中国证监会指定媒介	2019-03-04
6	天弘量化驱动股票型证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会指定媒介	2019-03-04
7	天弘量化驱动股票型证券投资基金2018年年度报告摘要	中国证监会指定媒介	2019-03-27
8	天弘量化驱动股票型证券投资基金2018年年度报告	中国证监会指定媒介	2019-03-27
9	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
10	天弘量化驱动股票型证券投资基金2019年第1季度报告	中国证监会指定媒介	2019-04-19

11	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
12	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
13	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
14	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	2019-05-10
15	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公告的公告	中国证监会指定媒介	2019-05-30
16	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
17	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
18	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
19	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	中国证监会指定媒介	2019-06-24

	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的公告	中国证监会指定媒介	2019-06-25
21	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
22	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	10,000,000.00	-	-	10,000,000.00	24.39%
	2	20190517-20190630	-	13,294.33	-	13,294.33	32.42%
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>							

(2) 极端市场环境下投资者集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对赎回申请的风险；

(3) 持有基金份额占比较高的投资者大额赎回可能引发基金净值大幅波动的风险；

(4) 持有基金份额占比较高的投资者在召开基金份额持有人大会并对重大事项进行投票表决时，可能拥有较大话语权；

(5) 极端情况下，持有基金份额占比较高的投资者大量赎回后，可能出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元而面临的转换基金运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等风险。

## 11.2 影响投资者决策的其他重要信息

自2018年11月27日至2019年06月30日，本基金连续60个工作日以上基金资产净值低于5000万元，基金管理人已按照基金合同约定向中国证监会报告并提出解决方案。

截至报告披露前，基金管理人根据法律法规及《基金合同》相关规定决定以通讯方式召开基金份额持有人大会，会议审议通过《关于天弘量化驱动股票型证券投资基金转型有关事项的议案》，自2019年08月12日起，天弘量化驱动股票型证券投资基金正式转型为天弘中证500指数增强型证券投资基金。具体信息请参见基金管理人于2019年08月12日在指定媒介披露的《天弘基金管理有限公司关于天弘量化驱动股票型证券投资基金基金份额持有人大会决议生效的公告》。

## § 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全指房地产指数型发起式证券投资基金募集的文件
- 2、天弘量化驱动股票型证券投资基金基金合同
- 3、天弘量化驱动股票型证券投资基金托管协议
- 4、天弘量化驱动股票型证券投资基金招募说明书
- 5、报告期内在指定报刊上披露的各项公告
- 6、中国证监会规定的其他文件

### 12.2 存放地点

天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层

### 12.3 查阅方式



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

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

天弘基金管理有限公司  
二〇一九年八月二十四日