

天弘中证500指数型发起式证券投资基金2016年年度报告

2016年12月31日

基金管理人：天弘基金管理有限公司

基金托管人：国泰君安证券股份有限公司

送出日期：2017年3月30日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

基金托管人国泰君安证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年3月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

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

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

本报告期自2016年1月1日起至2016年12月31日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
3.3 过去三年基金的利润分配情况	9
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见	16
§6 审计报告	16
6.1 审计报告基本信息	16
6.2 审计报告的基本内容	16
§7 年度财务报表	17
7.1 资产负债表	17
7.2 利润表	19
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	21
7.4 报表附注	22
§8 投资组合报告	48
8.1 期末基金资产组合情况	48
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	49
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细	51
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	67
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	69
8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	69
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	69
8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	69
8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	69
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	70
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	70
8.12 投资组合报告附注	70
§9 基金份额持有人信息	71
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	71

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	71
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	71
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况	72
§10 开放式基金份额变动	72
§11 重大事件揭示	72
11.1 基金份额持有人大会决议	72
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	72
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	73
11.4 基金投资策略的改变	73
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	73
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	73
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	73
11.8 其他重大事件	74
§12 备查文件目录	81
12.1 备查文件目录	81
12.2 存放地点	82
12.3 查阅方式	82

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	天弘中证500指数型发起式证券投资基金
基金简称	天弘中证500
基金主代码	000962
基金运作方式	契约型开放式、发起式
基金合同生效日	2015年1月20日
基金管理人	天弘基金管理有限公司
基金托管人	国泰君安证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	588,058,121.23份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
名称	天弘基金管理有限公司	国泰君安证券股份有限公司
信息披露	姓名	童建林
		王健

露负责人	联系电话	022-83310208	021-38676252
	电子邮箱	service@thfund.com.cn	wangj222@gtjas.com
客户服务电话		4007109999	95521
传真		022-83865569	021-38677819
注册地址		天津自贸区(中心商务区)响螺湾旷世国际大厦A座 1704-241号	中国(上海)自由贸易试验区 商城路618号
办公地址		天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层	上海市浦东新区银城中路68号32层
邮政编码		300203	200120
法定代表人		井贤栋	杨德红

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016年	2015年1月20日-2015
---------------	-------	-----------------

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

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3、期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

4、本基金《基金合同》自2015年1月20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

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-1.40%	0.77%	-0.95%	0.78%	-0.45%	-0.01%
过去六个月	1.55%	0.85%	2.21%	0.88%	-0.66%	-0.03%
过去一年	-16.42%	1.83%	-16.77%	1.81%	0.35%	0.02%
自基金合同生效日起至今（2015年01月20日-2016年12月31日）	1.15%	2.37%	18.43%	2.30%	-17.28%	0.07%

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

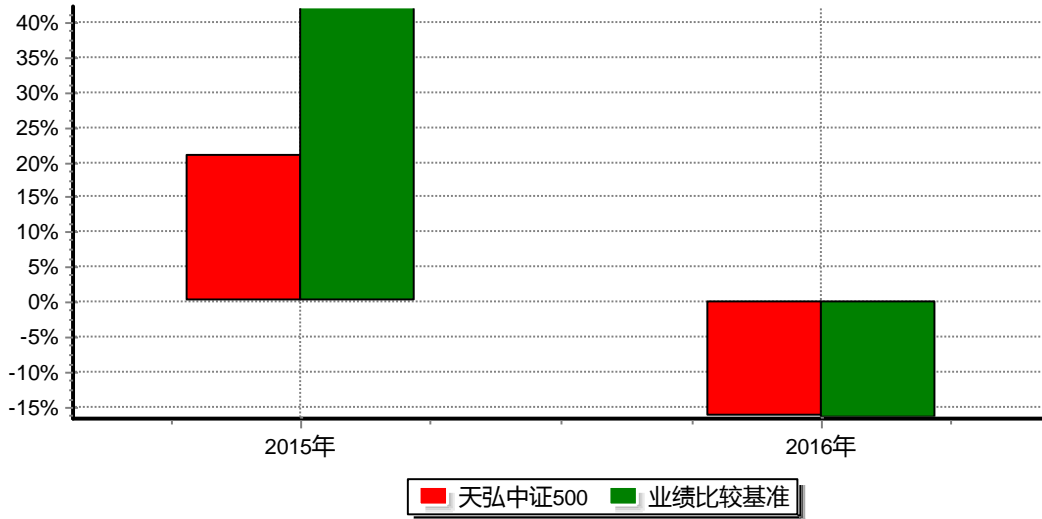
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、本基金合同于2015年1月20日生效。

2、本报告期内，本基金的各项投资比例达到基金合同约定的各项比例要求。

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



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

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效以来无利润分配情况，符合相关法规及基金合同的规定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

截至2016年12月31日，本基金管理人共管理53只基金：天弘精选混合型证券投资基金

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

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		
李蕴炜	本基金基金经理。	2015年1月	2016年2月	10年	男，理学硕士。历任亚洲证券有限责任公司股票分析师、Ophedge investment services运

					营分析师。2007年加盟本公司, 历任本公司交易员、行业研究员、高级研究员、股票研究部副总经理、基金经理助理等。
刘冬	本基金基金经理。	2016年2月	—	10年	男, 经济学硕士。2007年7月至2008年10月在长江证券股份有限公司研究部任宏观策略研究员。2008年11月加盟本公司, 历任本公司投资部固定收益研究员、宏观策略研究员、基金经理助理等。

注: 1、上述任职日期为基金合同生效日或本基金管理人对外披露的任职日期。

2、上述离任日期为本基金管理人对外披露的离任日期。

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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 公平交易制度和控制方法

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

针对公司旗下所有投资组合的交易所公开竞价交易, 通过交易系统内的公平交易程序, 对于不同投资组合同日同向买卖同一证券的指令自动进行比例分配。针对场外网下交易业务, 依照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部场外、网

下交易业务的相关规定，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。对于以公司名义进行的交易严格按照发行分配的原则或价格优先、比例分配的原则在各投资组合间进行分配。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

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

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

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

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

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

本基金跟踪的标的指数为中证500指数，基金业绩比较基准为：中证500指数收益率 $\times 95\%$ + 人民币活期存款税后利率 $\times 5\%$ 。中证500指数综合反映沪深证券市场内小市值公司的整体状况，天弘中证500基金自2015年1月20日成立以来，采取了对指数的被动复制策略及适当的替代优化策略，将年化跟踪误差和日均跟踪偏离度控制在了基金合同约定

的范围之内。

市场方面，2016年初受人民币短期贬值、资本流出压力加大及监管措施实施等原因，A股市场经历了一波较大幅度的调整，之后随着人民币汇率逐步企稳、央行积极投放货币、市场监管措施调整等因素影响，A股逐步企稳并保持基本平稳运行状态至年末。

本基金在运作过程中严格遵守基金合同，坚持既定的指数化投资策略，对指数基金操作采取被动复制与组合优化相结合的方式。本基金跟踪误差的主要来源是申购赎回与成分股停牌因素，当由于申赎变动、指数成分股权重调整等原因引发组合调整时，在操作过程中坚守合规第一、风控第一的前提下，结合市场趋势预判，应用指数复制和其他合理方法构建和优化基金投资组合，在遇到巨额申购资金在途不可用情形时会适当配置中证500股指期货，最大限度降低冲击成本和减少跟踪误差，使本基金与所跟踪指数的市场表现尽量一致，努力为投资者提供一个良好的指数投资工具。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2016年12月31日，本基金份额净值为1.0115元，本报告期份额净值增长率-16.42%，同期业绩比较基准增长率-16.77%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016年的经济基本面，在库存回补与需求温和回暖共同作用下出现平稳的态势，总体并有小幅回升；终端需求主要受地产、汽车以及基建等拉动比较明显，经济增长的结构方面仍然是传统模式为主，结构调整带来的经济回升不明显，地产、汽车的政策相对16年不那么宽松的情况下，2017年的终端需求多少会受到一些影响，且结构调整的效果也比较缓慢；因此，2017年总体的政策环境还是以偏稳为主，根据经济、通胀的强弱会辅以动态调整，经济总体情况还是比较平稳，资本市场总体上存在机会。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人的监察稽核工作一切从合规运作、防范和控制风险、保障基金份额持有人利益出发，由独立的监察稽核部门按照规定的权限和程序，认真履行职责，对公司、基金运作及员工行为的合法性、合规性进行定期和不定期监督和检查。发现问题及时提出建议并督促相关部门改进完善，及时与有关人员沟通，并定期制作监察稽核报告报公司董事会。公司经理层面成立了风险管理委员会，根据公司总体风险控制目标，分配各业务和各环节风险控制目标和要求；落实公司重大风险管理的决定或决议；听取并讨论会议成员的报告；对会议成员提出的或发现的已经存在的风险点，在充分讨论、协调基础上形成具体的风险控制措施；对潜在风险点分析讨论，拟定应对措施；对发生的风险事件和重大差错，分析原因、总结经验教训、风险定级、划分责任，向总经理办公会报告。同时，本基金管理人根据全面性原则、独立性原则、相互制约原则、定性和定量相结合原则、重要性原则建立了一套比较完整的内部控制体系，该内部控制

体系由一系列业务管理制度及相应的业务处理、控制程序组成，具体包括控制环境、风险评估、控制活动、信息和沟通、监控等要素。本基金管理人已通过了ISAE3402（《国际鉴证业务准则第3402号》）认证，获得无保留意见的控制设计适当性报告。本报告期，本基金管理人全面开展基金运作监察稽核工作，确保基金投资、营销及后台运作等各环节的合法合规。通过定期检查、不定期抽查等工作方法，完善内部控制，基金运作没有出现违规行为。本报告期内，本基金管理人有关本基金的监察稽核主要工作如下：

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

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

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

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

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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、风险管理人员、监察稽核人员及基金运营人员组成。

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

报告期内，本基金管理人未与任何第三方签定与估值相关的定价服务。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内本基金管理人无应说明预警信息。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，国泰君安证券股份有限公司（以下称“本托管人”）在天弘中证500指数型发起式证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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

本报告期内，本托管人根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法

规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2017)第20790号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	天弘中证500指数型发起式证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的天弘中证500指数型发起式证券投资基金(以下简称“天弘中证500指数型发起式基金”)的财务报表，包括2016年12月31日的资产负债表、2016年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是天弘中证500指数型发起式基金的基金管理人天弘基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括： (1)按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，并使其实现公允反映； (2)设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务

	报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
审计意见段	我们认为，上述天弘中证500指数型发起式基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中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，公允反映了天弘中证500指数型发起式基金2016年12月31日的财务状况以及2016年度的经营成果和基金净值变动情况。
注册会计师的姓名	薛竞、周祎
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
会计师事务所的地址	中国上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
审计报告日期	2017-03-30

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：天弘中证500指数型发起式证券投资基金

报告截止日：2016年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	25,340,482.06	45,896,001.68
结算备付金		10,539,913.07	5,179,154.66
存出保证金		2,179,983.83	1,603,692.13
交易性金融资产	7.4.7.2	560,852,589.94	606,416,681.36
其中：股票投资		560,852,589.94	606,416,681.36
基金投资			
债券投资		—	—
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
衍生金融资产	7.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	7.4.7.4	—	—
应收证券清算款		—	523,134.51
应收利息	7.4.7.5	15,977.69	21,505.09
应收股利		—	—
应收申购款		2,530,831.87	1,143,431.91
递延所得税资产		—	—
其他资产	7.4.7.6	—	—
资产总计		601,459,778.46	660,783,601.34
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
负债：			
短期借款		—	—
交易性金融负债		—	—
衍生金融负债	7.4.7.3	—	—
卖出回购金融资产款		—	—
应付证券清算款		297,071.35	39,364.82

应付赎回款		5,399,277.25	5,034,272.33
应付管理人报酬		247,963.75	291,053.09
应付托管费		49,592.75	58,210.60
应付销售服务费		—	—
应付交易费用	7.4.7.7	242,577.43	83,782.44
应交税费		—	—
应付利息		—	—
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	7.4.7.8	405,637.50	361,532.98
负债合计		6,642,120.03	5,868,216.26
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	588,058,121.23	541,157,410.82
未分配利润	7.4.7.10	6,759,537.20	113,757,974.26
所有者权益合计		594,817,658.43	654,915,385.08
负债和所有者权益总计		601,459,778.46	660,783,601.34

注：注：1、报告截止日2016年12月31日，基金份额净值1.0115元，基金份额总额588,058,121.23份；

2、本财务报表的比较期间为2015年1月20日(基金合同生效日)至2015年12月31日。

7.2 利润表

会计主体：天弘中证500指数型发起式证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016年1月1日至 2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月20日至2015 年12月31日
一、收入		-71,209,347.02	-138,729,937.47
1. 利息收入		998,792.83	1,269,363.46
其中：存款利息收入	7.4.7.11	998,792.83	786,689.49
债券利息收入		—	482,673.97
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）		-87,439,387.70	-107,954,204.72
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-90,241,689.07	-111,983,256.24
基金投资收益			
债券投资收益	7.4.7.13	—	-57,000.00
资产支持证券投资收益		—	—
贵金属投资收益	7.4.7.14	—	—
衍生工具收益	7.4.7.15	-1,731,200.00	—
股利收益	7.4.7.16	4,533,501.37	4,086,051.52
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	15,231,247.85	-32,045,096.21
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）			
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	—	—
减：二、费用		7,434,925.87	6,951,936.22
1. 管理人报酬		3,417,190.50	3,076,222.09
2. 托管费		683,438.10	615,244.40
3. 销售服务费		—	—
4. 交易费用	7.4.7.19	2,786,978.95	2,801,573.70
5. 利息支出		—	—
其中：卖出回购金融资产支出		—	—
6. 其他费用	7.4.7.20	547,318.32	458,896.03
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-78,644,272.89	-145,681,873.69
减：所得税费用		—	—

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-78,644,272.89	-145,681,873.69
-------------------	--	----------------	-----------------

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：天弘中证500指数型发起式证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	541,157,410.82	113,757,974.26	654,915,385.08
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	-78,644,272.89	-78,644,272.89
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	46,900,710.41	-28,354,164.17	18,546,546.24
其中：1. 基金申购款	3,626,689,424.50	-4,035,515.17	3,622,653,909.33
2. 基金赎回款	-3,579,788,714.09	-24,318,649.00	-3,604,107,363.09
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	—	—	—
五、期末所有者权益(基金净值)	588,058,121.23	6,759,537.20	594,817,658.43
项目	上年度可比期间 2015年1月20日至2015年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	10,000,000.00	—	10,000,000.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	-145,681,873.69	-145,681,873.69

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)	531,157,410.82	259,439,847.95	790,597,258.77
其中：1. 基金申购款	3,369,457,250.16	1,315,217,978.28	4,684,675,228.44
2. 基金赎回款	-2,838,299,839.34	-1,055,778,130.33	-3,894,077,969.67
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)	541,157,410.82	113,757,974.26	654,915,385.08

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

郭树强

韩海潮

薄贺龙

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

天弘中证500指数型发起式证券投资基金（以下简称“本基金”）经中国证券监督管理委员会（以下简称“中国证监会”）证监许可[2015]1364号《关于准予天弘中证500指数型发起式证券投资基金注册的批复》核准，由天弘基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘中证500指数型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次募集期间为2015年1月19日，首次设立募集不包括认购资金利息共募集10,000,000.00元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第010号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《天弘中证500指数型发起式证券投资基金基金合同》于2015年1月20日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为10,000,000.00份基金份额。本基金的基金管理人为天弘基金管理有限公司，基金托管人为国泰君安证券股份有限公司。

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘中证500指数型发起式证券投资

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

本财务报表由本基金的基金管理人天弘基金管理有限公司于2017年3月30日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则—基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定（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颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《天弘中证500指数型发起式证券投资基金合同》和如财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2016年度财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2016年12月31日的财务状况以及2016年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。比较财务报表的实际编制期间为2015年1月20日（基金合同生效日）至2015年12月31日止期间。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

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

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

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

(2) 金融负债的分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和衍生工具(主要为股指期货投资)按如下原则确定公允价

值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

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

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以

下类别股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

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

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

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

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

(含1年)的, 暂减按50%计入应纳税所得额; 持股期限超过1年的, 暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股, 解禁后取得的股息、红利收入, 按照上述规定计算纳税, 持股时间自解禁日起计算; 解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位: 人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
活期存款	25,340,482.06	45,896,001.68
定期存款	—	—
其中: 存款期限1-3个月	—	—
其他存款	—	—
合计	25,340,482.06	45,896,001.68

7.4.7.2 交易性金融资产

单位: 人民币元

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

项目	上年度末 2015年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	638,461,777.57	606,416,681.36	-32,045,096.21
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	638,461,777.57	606,416,681.36	-32,045,096.21

注：截至2016年12月31日，股票投资余额中包含按照指数收益法估值的特殊事项停牌相关股票。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有因买断式逆回购而取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
应收活期存款利息	11,643.80	19,098.73
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	3,254.79	1,612.49

应收债券利息	—	—
应收买入返售证券利息	—	—
应收申购款利息	—	—
应收黄金合约拆借孳息	—	—
其他	1,079.10	793.87
合计	15,977.69	21,505.09

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
交易所市场应付交易费用	242,577.43	83,782.44
银行间市场应付交易费用	—	—
合计	242,577.43	83,782.44

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
应付券商交易单元保证金	—	—
应付赎回费	2,694.05	2,517.59
预提费用	369,000.00	325,000.00
其他应付	33,943.45	34,015.39
合计	405,637.50	361,532.98

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2016年1月1日至2016年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额

上年度末	541,157,410.82	541,157,410.82
本期申购	3,626,689,424.50	3,626,689,424.50
本期赎回（以“-”号填列）	-3,579,788,714.09	-3,579,788,714.09
本期末	588,058,121.23	588,058,121.23

注：申购含转换转入份额，赎回含转换转出份额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-100,960,889.61	214,718,863.87	113,757,974.26
本期利润	-93,875,520.74	15,231,247.85	-78,644,272.89
本期基金份额交易产生的变动数	9,780,448.47	-38,134,612.64	-28,354,164.17
其中：基金申购款	-988,903,565.45	984,868,050.28	-4,035,515.17
基金赎回款	998,684,013.92	-1,023,002,662.92	-24,318,649.00
本期已分配利润	—	—	—
本期末	-185,055,961.88	191,815,499.08	6,759,537.20

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月20日至2015年12月31日
活期存款利息收入	875,689.51	699,143.42
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	103,800.06	53,637.11
其他	19,303.26	33,908.96
合计	998,792.83	786,689.49

7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月20日至2015年12月31日
卖出股票成交总额	1,687,803,151.96	1,557,152,352.75
减：卖出股票成本总额	1,778,044,841.03	1,669,135,608.99
买卖股票差价收入	-90,241,689.07	-111,983,256.24

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月20日至2015年12月31日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	—	-57,000.00
债券投资收益——赎回差价收入	—	—
债券投资收益——申购差价收入	—	—
合计	—	-57,000.00

注：本基金本报告期未取得债券投资收益。

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月20日至2015年12月31日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	—	20,728,000.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	—	20,057,000.00

减：应收利息总额	—	728,000.00
买卖债券差价收入	—	-57,000.00

7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间未取得资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间未取得贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

7.4.7.15.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期及上年度可比期间均无买卖权证差价收入。

7.4.7.15.2 衍生工具收益——其他投资收益

金额单位：人民币元

项目	本期收益金额 2016年1月1日至2016年12 月31日	上年度可比期间收益金额 2015年1月20日至2015年 12月31日
股指期货投资收益	-1,731,200.00	—

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12 月31日	上年度可比期间 2015年1月20日至2015年 12月31日
股票投资产生的股利收益	4,533,501.37	4,086,051.52
基金投资产生的股利收益	—	—
合计	4,533,501.37	4,086,051.52

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月20日至2015年12月31日
1. 交易性金融资产	15,231,247.85	-32,045,096.21
——股票投资	15,231,247.85	-32,045,096.21
——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	—	—
合计	15,231,247.85	-32,045,096.21

7.4.7.18 其他收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他收入。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月20日至2015年12月31日
交易所市场交易费用	2,786,978.95	2,801,573.70
银行间市场交易费用	—	—
合计	2,786,978.95	2,801,573.70

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月20日至2015年12月31日
审计费用	108,000.00	25,000.00

信息披露费	300,000.00	300,000.00
其他费用	—	880.00
汇划手续费	2,630.70	9,967.16
指数使用费	136,687.62	123,048.87
合计	547,318.32	458,896.03

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

财政部、国家税务总局于2016年12月21日颁布《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[2016]140号)，要求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，自2017年5月1日起执行。

根据财政部、国家税务总局于2017年1月6日颁布的《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税[2017]2号)，2017年7月1日(含)以后，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，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在2017年7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。资管产品运营过程中发生增值税应税行为的具体征收管理办法，由国家税务总局另行制定。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
天弘基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构
国泰君安证券股份有限公司(“国泰君安证券”)	基金托管人、基金销售机构
浙江蚂蚁小微金融服务集团股份有限公司	基金管理人的股东
天津信托有限责任公司	基金管理人的股东
内蒙古君正能源化工集团股份有限公司	基金管理人的股东

芜湖高新投资有限公司	基金管理人的股东
新疆天瑞博丰股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
新疆天惠新盟股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
新疆天阜恒基股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
新疆天聚宸兴股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
天弘创新资产管理有限公司（“天弘创新”）	基金管理人的全资子公司

注：1、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2、2016年度内，本基金管理人股东“浙江蚂蚁小微金融服务集团有限公司”的名称变更为“浙江蚂蚁小微金融服务集团股份有限公司”。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月20日至2015年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
国泰君安证券股份有限公司	3,404,161,359.02	100.00%	3,864,518,468.71	100.00%

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期
-------	----

	2016年1月1日至2016年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国泰君安证券股份有限公司	787,430.16	100.00%	242,577.43	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2015年1月20日至2015年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
国泰君安证券股份有限公司	826,258.78	100.00%	83,782.44	100.00%

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

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

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月20日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	3,417,190.50	3,076,222.09
其中：支付销售机构的客户维护费	424,395.21	23,394.47

注：1、支付基金管理人天弘基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值0.5%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬=前一日基金资产净值X0.5%/当年天数。

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

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月 31日	上年度可比期间 2015年1月20日至2015年12月 31日
当期发生的基金应支付的托管费	683,438.10	615,244.40

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

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12 月31日	上年度可比期间 2015年1月20日至2015年 12月31日
基金合同生效日（2015年1月20日）持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
期初持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
期间申购/买入总份额	—	—
期间因拆分变动份额	—	—
减：期间赎回/卖出总份额	—	—
期末持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
期末持有的基金份额 占基金总份额比例	1.70%	1.85%

注：期间申购/买入总份额含转换转入份额，期间赎回/卖出总份额含转换转出份额。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

于本基金本报告期末及上年度末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月20日至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
国泰君安证券 活期存款	25,340,482.06	875,689.51	45,896,001.68	699,143.42

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

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金本期无利润分配情况。

7.4.12 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末 估值单价	复牌 日期	复牌 开盘单价	数量 (单 位： 股)	期末 成本总额	期末 估值总额
000563	陕国投A	2016-10-14	重大资产重组	7.48	2017-01-18	6.73	298,100	1,836,411.11	2,229,788.00
002602	世纪华通	2016-12-15	重大事项	46.89	2017-01-09	50.00	44,604	1,478,455.26	2,091,481.56
601168	西部矿业	2016-12-19	重大资产重组	7.83		—	255,800	1,855,695.52	2,002,914.00

000887	中鼎股份	2016-11-18	重大资产重组	25.94	2017-02-15	23.99	76,200	1,787,790.42	1,976,628.00
000547	航天发展	2016-04-19	重大资产重组	15.36	2017-01-03	16.90	123,330	3,104,680.58	1,894,348.80
300088	长信科技	2016-09-12	重大资产重组	15.80		—	113,900	1,541,769.01	1,799,620.00
000748	长城信息	2016-11-01	重大资产重组	20.31		—	88,080	1,876,028.70	1,788,904.80
600687	刚泰控股	2016-07-25	重大资产重组	16.42	2017-01-18	16.38	106,500	1,727,236.76	1,748,730.00
600673	东阳光科	2016-11-16	重大资产重组	7.29		—	225,700	1,524,532.68	1,645,353.00
600655	豫园商城	2016-12-20	重大事项未公告	11.42		—	142,029	1,694,510.09	1,621,971.18
002400	省广股份	2016-11-28	重大事项	13.79		—	117,590	1,789,532.64	1,621,566.10
000050	深天马A	2016-09-12	重大资产重组	18.82	2017-03-23	20.70	79,300	1,499,255.20	1,492,426.00
002491	通鼎互联	2016-12-22	重大事项	15.54	2017-01-03	15.89	95,170	1,553,131.80	1,478,941.80
600151	航天机电	2016-11-11	重大资产重组	10.97		—	122,300	1,354,950.75	1,341,631.00
000697	炼石有色	2016-11-17	重大资产重组	23.51		—	56,500	1,318,007.31	1,328,315.00
600161	天坛生物	2016-12-06	重大资产重组	39.40	2017-03-24	43.34	32,368	1,220,145.53	1,275,299.20
002440	闰土股份	2016-10-21	重大资产重组	16.34	2017-01-12	15.22	77,700	1,289,507.65	1,269,618.00
600645	中源协和	2016-12-13	重大资产重组	26.80		—	43,751	1,612,856.32	1,172,526.80
000727	华东科技	2016-11-17	重大资产重组	3.37	2017-02-15	3.47	344,700	1,157,191.88	1,161,639.00
000829	天音控股	2016-09-29	重大事项	11.28		—	100,503	1,335,190.48	1,133,673.84
600171	上海贝岭	2016-12-14	重大事项未公告	14.05	2017-02-16	14.90	76,099	1,179,116.53	1,069,190.95
601005	重庆钢铁	2016-06-02	重大资产重组	2.52		—	422,600	1,385,175.12	1,064,952.00
002635	安洁科技	2016-11-08	重大资产重组	36.40	2017-02-08	33.50	26,628	838,533.17	969,259.20
002025	航天电器	2016-09-12	重大资产重组	25.20		—	36,546	851,088.74	920,959.20
00239	星网	2016-	重大事项	19.70	2017-	18.35	45,74	927,304.5	901,255.3

6	锐捷	09-12	未公告		02-21		9	2	0
600537	亿晶光电	2016-12-27	重大事项未公告	7.43	2017-01-13	8.17	116,224	898,730.13	863,544.32
002727	一心堂	2016-12-28	重大事项	21.20	2017-01-05	21.66	37,030	821,629.03	785,036.00
600859	王府井	2016-09-27	重大资产重组	16.28		—	47,830	824,651.86	778,672.40
002681	奋达科技	2016-12-19	重大资产重组	12.93		—	53,760	777,511.41	695,116.80
000693	ST华泽	2016-03-01	重大事项	12.50		—	49,788	1,135,492.48	622,350.00
603555	贵人鸟	2016-12-12	重大资产重组	30.76		—	17,464	481,414.45	537,192.64
603169	兰石重装	2016-11-24	重大资产重组	13.36	2017-03-21	14.32	39,301	519,027.18	525,061.36
002745	木林森	2016-07-18	重大资产重组	36.49		—	14,100	451,297.46	514,509.00
600551	时代出版	2016-11-28	重大资产重组	20.32		—	25,121	492,816.18	510,458.72

注：1. 本基金截至2016年12月31日止持有以上因公布的重大事项或重大资产重组可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

2. 根据长城信息产业股份有限公司(以下简称“长城信息”)于2016年10月25日公布的《关于中国长城计算机深圳股份有限公司换股合并公司事宜的提示性公告》和中国长城计算机深圳股份有限公司(以下简称“长城电脑”)于2017年1月20日公布的《中国长城计算机深圳股份有限公司换股合并长城信息产业股份有限公司及重大资产置换和发行股份购买资产并募集配套资金暨关联交易报告书(修订稿)》，长城电脑将向长城信息全体股东发行A股股票，以换股比例1:0.5424取得长城信息股东持有的长城信息全部股票，吸收合并长城信息；长城信息自2016年11月1日起连续停牌。换股合并后新增的长城电脑股票于2017年1月18日上市流通，当日开盘单价为10.63元。长城信息人民币普通股股票自2017年1月18日起终止上市并摘牌。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2016年12月31日，本基金未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2016年12月31日，本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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

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

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

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在具有基金托管资格的中国工商银行股份有限公司，与银行存款相关的信

用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

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2016年12月31日，本基金无债券投资（2015年12月31日：同）。

7.4.13.3 流动性风险

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

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

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限的投资品种比例等。本基金投资于同一机构发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有同一机构发行的具有投票权的证券不得超过该类证券发行总量的10%。本基金所持全部证券均在证券交易所上市，除附注7.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。

于2016年12月31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。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利

率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末2016年 12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	25,340,482.06	—	—	—	25,340,482.06
结算备付金	10,539,913.07	—	—	—	10,539,913.07
存出保证金	2,179,983.83	—	—	—	2,179,983.83
交易性金融资产	—	—	—	560,852,589.94	560,852,589.94
应收利息	—	—	—	15,977.69	15,977.69
应收申购款	—	—	—	2,530,831.87	2,530,831.87
资产总计	38,060,378.96	—	—	563,399,399.50	601,459,778.46
负债					
应付证券清算款	—	—	—	297,071.35	297,071.35
应付赎回款	—	—	—	5,399,277.25	5,399,277.25
应付管理人报酬	—	—	—	247,963.75	247,963.75

应付托管费	—	—	—	49,592.75	49,592.75
应付交易费用	—	—	—	242,577.43	242,577.43
其他负债	—	—	—	405,637.50	405,637.50
负债总计	—	—	—	6,642,120.03	6,642,120.03
利率敏感度缺口	38,060,378.96	—	—	556,757,279.47	594,817,658.43
上年度末2015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	45,896,001.68	—	—	—	45,896,001.68
结算备付金	5,179,154.66	—	—	—	5,179,154.66
存出保证金	1,603,692.13	—	—	—	1,603,692.13
交易性金融资产	—	—	—	606,416,681.36	606,416,681.36
应收证券清算款	—	—	—	523,134.51	523,134.51
应收利息	—	—	—	21,505.09	21,505.09
应收申购款	—	—	—	1,143,431.91	1,143,431.91
资产总计	52,678,848.47	—	—	608,104,752.87	660,783,601.34
负债					
应付证券清算款	—	—	—	39,364.82	39,364.82
应付赎回款	—	—	—	5,034,272.33	5,034,272.33
应付管理人报酬	—	—	—	291,053.09	291,053.09

应付托管费	—	—	—	58,210.60	58,210.60
应付交易费用	—	—	—	83,782.44	83,782.44
其他负债	—	—	—	361,532.98	361,532.98
负债总计	—	—	—	5,868,216.26	5,868,216.26
利率敏感度缺口	52,678,848.47	—	—	602,236,536.61	654,915,385.08

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

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2016年12月31日，本基金未持有交易性债券投资(2015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(2015年12月31日：同)。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日		上年度末 2015年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净	公允价值	占基金 资产净

		值比例 (%)		值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	560,852,589.94	94.29	606,416,681.36	92.59
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	560,852,589.94	94.29	606,416,681.36	92.59

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注7.4.1)以外的其他市场变量保持不变。		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币元)	
		本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
	1. 业绩比较基准(附注7.4.1)上升5%	30,055,095.35	33,728,142.33
	2. 业绩比较基准(附注7.4.1)下降5%	-30,055,095.35	-33,728,142.33

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次:除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次:相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2016年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为518,019,655.97元，属于第二层次的余额为42,832,933.97元，无属于第三层次的余额。（2015年12月31日：第一层次538,369,843.39元，第二层次68,046,837.97元，无属于第三层次的余额）。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

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

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2016年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产（2015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。

§ 8 投资组合报告

8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	560,852,589.94	93.25
	其中：股票	560,852,589.94	93.25
2	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
3	贵金属投资	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	银行存款和结算备付金合计	35,880,395.13	5.97
7	其他各项资产	4,726,793.39	0.79
8	合计	601,459,778.46	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	7,127,740.22	1.20
B	采矿业	21,114,448.75	3.55
C	制造业	344,092,953.88	57.85
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	17,226,877.33	2.90
E	建筑业	15,767,920.55	2.65
F	批发和零售业	33,637,910.96	5.66
G	交通运输、仓储和邮政业	16,017,382.23	2.69
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	33,451,063.67	5.62
J	金融业	5,666,848.10	0.95
K	房地产业	36,008,583.52	6.05

L	租赁和商务服务业	8,026,320.25	1.35
M	科学研究和技术服务业	1,663,683.98	0.28
N	水利、环境和公共设施管理业	2,701,176.28	0.45
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	290,664.00	0.05
Q	卫生和社会工作	1,448,320.00	0.24
R	文化、体育和娱乐业	8,021,251.04	1.35
S	综合	4,925,515.18	0.83
	合计	557,188,659.94	93.67

8.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	622,350.00	0.10
C	制造业	3,041,580.00	0.51
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	—	—
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—
R	文化、体育和娱乐业	—	—

S	综合	—	—
	合计	3,663,930.00	0.62

注：由于指数成份股调整，上表所列示股票被调出成份股后停牌，故以积极投资股票列示（下同）。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	000656	金科股份	539,704	2,828,048.96	0.48
2	600525	长园集团	198,997	2,776,008.15	0.47
3	600522	中天科技	262,698	2,766,209.94	0.47
4	600201	生物股份	86,363	2,728,207.17	0.46
5	600682	南京新百	71,200	2,653,624.00	0.45
6	300136	信维通信	91,900	2,619,150.00	0.44
7	600584	长电科技	146,191	2,580,271.15	0.43
8	600079	人福医药	127,550	2,544,622.50	0.43
9	600643	爱建集团	204,010	2,531,764.10	0.43
10	600219	南山铝业	798,500	2,467,365.00	0.41
11	600158	中体产业	103,442	2,438,127.94	0.41
12	002405	四维图新	121,288	2,346,922.80	0.39
13	601012	隆基股份	170,794	2,286,931.66	0.38
14	600487	亨通光电	120,348	2,245,693.68	0.38
15	002092	中泰化学	184,700	2,234,870.00	0.38
16	000563	陕国投A	298,100	2,229,788.00	0.37
17	000661	长春高新	19,613	2,193,714.05	0.37
18	002572	索菲亚	39,708	2,150,585.28	0.36
19	002602	世纪华通	44,604	2,091,481.56	0.35
20	300156	神雾环保	81,506	2,038,465.06	0.34
21	600166	福田汽车	658,000	2,033,220.00	0.34
22	300115	长盈精密	77,099	2,009,199.94	0.34

23	601168	西部矿业	255,800	2,002,914.00	0.34
24	300266	兴源环境	36,400	1,997,632.00	0.34
25	600143	金发科技	255,964	1,991,399.92	0.33
26	600436	片仔癀	43,252	1,980,509.08	0.33
27	600521	华海药业	89,786	1,977,985.58	0.33
28	300296	利亚德	58,500	1,972,620.00	0.33
29	600315	上海家化	72,400	1,962,764.00	0.33
30	002460	赣锋锂业	73,500	1,948,485.00	0.33
31	600699	均胜电子	58,602	1,939,140.18	0.33
32	002407	多氟多	70,800	1,932,132.00	0.32
33	002366	台海核电	35,840	1,921,740.80	0.32
34	600503	华丽家族	230,300	1,909,187.00	0.32
35	002508	老板电器	51,827	1,907,233.60	0.32
36	000547	航天发展	123,330	1,894,348.80	0.32
37	002422	科伦药业	117,496	1,894,035.52	0.32
38	002340	格林美	288,026	1,886,570.30	0.32
39	000581	威孚高科	84,000	1,884,960.00	0.32
40	000998	隆平高科	87,840	1,882,411.20	0.32
41	300026	红日药业	344,800	1,872,264.00	0.31
42	600879	航天电子	122,700	1,869,948.00	0.31
43	002168	深圳惠程	117,800	1,868,308.00	0.31
44	000930	中粮生化	136,200	1,830,528.00	0.31
45	002439	启明星辰	87,500	1,819,125.00	0.31
46	600664	哈药股份	211,392	1,813,743.36	0.30
47	000997	新大陆	93,089	1,808,719.27	0.30
48	300088	长信科技	113,900	1,799,620.00	0.30
49	600978	宜华木业	168,400	1,793,460.00	0.30
50	600266	北京城建	134,500	1,792,885.00	0.30
51	000748	长城信息	88,080	1,788,904.80	0.30
52	002004	华邦健康	196,490	1,782,164.30	0.30
53	600614	鼎立股份	151,200	1,769,040.00	0.30

54	600687	刚泰控股	106,500	1,748,730.00	0.29
55	000690	宝新能源	187,988	1,742,648.76	0.29
56	600497	驰宏锌锗	245,852	1,728,339.56	0.29
57	002701	奥瑞金	199,415	1,722,945.60	0.29
58	600500	中化国际	146,300	1,705,858.00	0.29
59	002176	江特电机	142,100	1,695,253.00	0.29
60	600635	大众公用	277,998	1,670,767.98	0.28
61	002030	达安基因	71,682	1,663,022.40	0.28
62	002311	海大集团	110,431	1,661,986.55	0.28
63	002013	中航机电	90,685	1,658,628.65	0.28
64	000961	中南建设	158,455	1,647,932.00	0.28
65	600673	东阳光科	225,700	1,645,353.00	0.28
66	600426	华鲁恒升	123,215	1,632,598.75	0.27
67	600138	中青旅	77,664	1,628,614.08	0.27
68	002271	东方雨虹	74,846	1,623,409.74	0.27
69	600655	豫园商城	142,029	1,621,971.18	0.27
70	002400	省广股份	117,590	1,621,566.10	0.27
71	000970	中科三环	120,400	1,607,340.00	0.27
72	300324	旋极信息	82,500	1,594,725.00	0.27
73	600122	宏图高科	130,072	1,589,479.84	0.27
74	002573	清新环境	90,305	1,577,628.35	0.27
75	600759	洲际油气	160,525	1,576,355.50	0.27
76	002038	双鹭药业	58,791	1,570,307.61	0.26
77	300113	顺网科技	57,682	1,551,068.98	0.26
78	600418	江淮汽车	133,841	1,547,201.96	0.26
79	002179	中航光电	42,513	1,542,796.77	0.26
80	300253	卫宁健康	78,729	1,542,301.11	0.26
81	600751	天海投资	183,400	1,533,224.00	0.26
82	002273	水晶光电	76,140	1,515,186.00	0.25
83	600240	华业资本	140,700	1,511,118.00	0.25
84	002001	新和成	77,000	1,509,200.00	0.25

85	600312	平高电气	95,759	1,495,755.58	0.25
86	000400	许继电气	82,400	1,495,560.00	0.25
87	600388	龙净环保	120,800	1,494,296.00	0.25
88	000050	深天马 A	79,300	1,492,426.00	0.25
89	600594	益佰制药	89,402	1,488,543.30	0.25
90	600565	迪马股份	200,600	1,488,452.00	0.25
91	000598	兴蓉环境	257,000	1,480,320.00	0.25
92	002491	通鼎互联	95,170	1,478,941.80	0.25
93	000959	首钢股份	222,980	1,476,127.60	0.25
94	002665	首航节能	166,975	1,462,701.00	0.25
95	002223	鱼跃医疗	46,960	1,456,699.20	0.24
96	600094	大名城	163,400	1,454,260.00	0.24
97	600601	方正科技	315,436	1,451,005.60	0.24
98	300244	迪安诊断	45,260	1,448,320.00	0.24
99	600811	东方集团	201,920	1,443,728.00	0.24
100	000975	银泰资源	91,784	1,435,501.76	0.24
101	000878	云南铜业	121,300	1,432,553.00	0.24
102	000566	海南海药	112,382	1,428,375.22	0.24
103	002221	东华能源	114,810	1,422,495.90	0.24
104	000939	凯迪生态	110,488	1,421,980.56	0.24
105	600056	中国医药	74,700	1,421,541.00	0.24
106	002217	合力泰	79,301	1,419,487.90	0.24
107	000078	海王生物	224,550	1,414,665.00	0.24
108	002353	杰瑞股份	69,400	1,408,820.00	0.24
109	600198	大唐电信	88,601	1,406,097.87	0.24
110	000012	南玻 A	123,800	1,403,892.00	0.24
111	000988	华工科技	89,500	1,400,675.00	0.24
112	300055	万邦达	85,500	1,400,490.00	0.24
113	000806	银河生物	88,200	1,397,088.00	0.23
114	000031	中粮地产	156,050	1,391,966.00	0.23
115	600478	科力远	139,150	1,391,500.00	0.23

116	300134	大富科技	54,790	1,389,474.40	0.23
117	600881	亚泰集团	253,198	1,384,993.06	0.23
118	600528	中铁二局	100,640	1,384,806.40	0.23
119	300159	新研股份	101,700	1,381,086.00	0.23
120	603589	口子窖	42,946	1,379,854.98	0.23
121	600200	江苏吴中	71,399	1,378,714.69	0.23
122	002410	广联达	94,318	1,377,042.80	0.23
123	600176	中国巨石	139,786	1,375,494.24	0.23
124	600549	厦门钨业	62,100	1,367,442.00	0.23
125	002408	齐翔腾达	124,198	1,366,178.00	0.23
126	300273	和佳股份	80,036	1,365,414.16	0.23
127	000979	中弘股份	515,640	1,361,289.60	0.23
128	002250	联化科技	84,100	1,360,738.00	0.23
129	000667	美好置业	368,500	1,359,765.00	0.23
130	600787	中储股份	149,400	1,355,058.00	0.23
131	600410	华胜天成	124,580	1,354,184.60	0.23
132	600435	北方导航	103,844	1,354,125.76	0.23
133	002191	劲嘉股份	130,001	1,353,310.41	0.23
134	600851	海欣股份	104,300	1,348,599.00	0.23
135	600755	厦门国贸	164,436	1,348,375.20	0.23
136	600026	中海发展	197,534	1,345,206.54	0.23
137	600151	航天机电	122,300	1,341,631.00	0.23
138	600516	方大炭素	144,800	1,340,848.00	0.23
139	000612	焦作万方	115,045	1,328,769.75	0.22
140	000697	炼石有色	56,500	1,328,315.00	0.22
141	000786	北新建材	129,000	1,327,410.00	0.22
142	002048	宁波华翔	59,698	1,321,713.72	0.22
143	000960	锡业股份	100,600	1,319,872.00	0.22
144	000999	华润三九	53,000	1,310,690.00	0.22
145	601929	吉视传媒	312,600	1,309,794.00	0.22
146	600572	康恩贝	177,883	1,300,324.73	0.22

147	601699	潞安环能	161,480	1,299,914.00	0.22
148	000488	晨鸣纸业	125,338	1,298,501.68	0.22
149	601000	唐山港	323,780	1,298,357.80	0.22
150	600575	皖江物流	224,582	1,291,346.50	0.22
151	000006	深振业 A	135,793	1,283,243.85	0.22
152	600967	北方创业	94,000	1,275,580.00	0.21
153	000758	中色股份	159,612	1,275,299.88	0.21
154	600161	天坛生物	32,368	1,275,299.20	0.21
155	600325	华发股份	99,581	1,274,636.80	0.21
156	600120	浙江东方	44,003	1,272,566.76	0.21
157	002440	闰土股份	77,700	1,269,618.00	0.21
158	000825	太钢不锈	322,142	1,269,239.48	0.21
159	000860	顺鑫农业	57,597	1,267,134.00	0.21
160	600108	亚盛集团	220,700	1,262,404.00	0.21
161	600633	浙报传媒	71,403	1,260,976.98	0.21
162	002018	华信国际	123,940	1,260,469.80	0.21
163	603019	中科曙光	45,098	1,254,626.36	0.21
164	600098	广州发展	111,300	1,248,786.00	0.21
165	600160	巨化股份	117,969	1,248,112.02	0.21
166	601880	大连港	443,703	1,242,368.40	0.21
167	300287	飞利信	103,301	1,229,281.90	0.21
168	600307	酒钢宏兴	449,100	1,226,043.00	0.21
169	600511	国药股份	40,500	1,219,050.00	0.20
170	002375	亚厦股份	115,200	1,218,816.00	0.20
171	002672	东江环保	69,050	1,215,280.00	0.20
172	600064	南京高科	72,469	1,213,855.75	0.20
173	600717	天津港	120,300	1,212,624.00	0.20
174	002051	中工国际	52,834	1,210,955.28	0.20
175	002390	信邦制药	122,250	1,209,052.50	0.20
176	600022	山东钢铁	483,600	1,209,000.00	0.20
177	600499	科达洁能	159,846	1,208,435.76	0.20

178	600863	内蒙华电	390,900	1,203,972.00	0.20
179	002444	巨星科技	77,139	1,203,368.40	0.20
180	600466	蓝光发展	124,200	1,201,014.00	0.20
181	002657	中科金财	27,802	1,199,934.32	0.20
182	002276	万马股份	79,802	1,199,424.06	0.20
183	002078	太阳纸业	179,291	1,197,663.88	0.20
184	600409	三友化工	127,400	1,196,286.00	0.20
185	002384	东山精密	60,700	1,190,327.00	0.20
186	002544	杰赛科技	42,300	1,190,322.00	0.20
187	002595	豪迈科技	56,360	1,186,378.00	0.20
188	603766	隆鑫通用	57,000	1,184,460.00	0.20
189	002489	浙江永强	155,940	1,180,465.80	0.20
190	600416	湘电股份	80,100	1,178,271.00	0.20
191	000028	国药一致	17,603	1,177,640.70	0.20
192	002155	湖南黄金	102,604	1,174,815.80	0.20
193	600645	中源协和	43,751	1,172,526.80	0.20
194	600316	洪都航空	59,600	1,171,736.00	0.20
195	600808	马钢股份	412,802	1,168,229.66	0.20
196	600587	新华医疗	46,500	1,167,615.00	0.20
197	000066	长城电脑	93,804	1,166,921.76	0.20
198	600348	阳泉煤业	173,200	1,165,636.00	0.20
199	002281	光迅科技	14,802	1,161,957.00	0.20
200	000727	华东科技	344,700	1,161,639.00	0.20
201	600039	四川路桥	244,977	1,161,190.98	0.20
202	600611	大众交通	176,700	1,160,919.00	0.20
203	000685	中山公用	104,241	1,160,202.33	0.20
204	002022	科华生物	57,967	1,159,340.00	0.19
205	000513	丽珠集团	19,482	1,159,179.00	0.19
206	002019	亿帆医药	75,800	1,158,982.00	0.19
207	002268	卫士通	36,798	1,156,193.16	0.19
208	000543	皖能电力	151,865	1,155,692.65	0.19

209	002266	浙富控股	198,750	1,144,800.00	0.19
210	600884	杉杉股份	81,070	1,141,465.60	0.19
211	600062	华润双鹤	51,300	1,140,399.00	0.19
212	000829	天音控股	100,503	1,133,673.84	0.19
213	600597	光明乳业	86,800	1,133,608.00	0.19
214	300199	翰宇药业	62,874	1,130,474.52	0.19
215	002261	拓维信息	94,793	1,129,932.56	0.19
216	002477	雏鹰农牧	224,777	1,128,380.54	0.19
217	000401	冀东水泥	94,781	1,127,893.90	0.19
218	600187	国中水务	208,300	1,122,737.00	0.19
219	600300	维维股份	167,900	1,121,572.00	0.19
220	600183	生益科技	101,483	1,116,313.00	0.19
221	002603	以岭药业	64,700	1,115,428.00	0.19
222	600380	健康元	112,200	1,114,146.00	0.19
223	600770	综艺股份	107,375	1,111,331.25	0.19
224	300122	智飞生物	67,400	1,110,078.00	0.19
225	600872	中炬高新	78,582	1,106,434.56	0.19
226	000089	深圳机场	138,100	1,104,800.00	0.19
227	002050	三花智控	100,000	1,104,000.00	0.19
228	600366	宁波韵升	55,991	1,102,462.79	0.19
229	600600	青岛啤酒	37,400	1,101,056.00	0.19
230	000592	平潭发展	162,038	1,095,376.88	0.18
231	600267	海正药业	83,100	1,092,765.00	0.18
232	002122	天马股份	85,800	1,088,802.00	0.18
233	002431	棕榈股份	118,725	1,087,521.00	0.18
234	000519	中兵红箭	72,947	1,086,910.30	0.18
235	002308	威创股份	72,912	1,074,722.88	0.18
236	002073	软控股份	94,240	1,069,624.00	0.18
237	600171	上海贝岭	76,099	1,069,190.95	0.18
238	002640	跨境通	58,400	1,068,720.00	0.18
239	600970	中材国际	150,296	1,065,598.64	0.18

240	600073	上海梅林	92,818	1,062,766.10	0.18
241	002373	千方科技	76,901	1,061,233.80	0.18
242	600422	昆药集团	78,102	1,055,158.02	0.18
243	600017	日照港	260,400	1,054,620.00	0.18
244	300274	阳光电源	99,905	1,052,998.70	0.18
245	600086	东方金钰	96,774	1,052,901.12	0.18
246	600392	盛和资源	78,450	1,045,738.50	0.18
247	000810	创维数字	74,101	1,042,601.07	0.18
248	000926	福星股份	81,700	1,040,858.00	0.17
249	600284	浦东建设	78,692	1,037,947.48	0.17
250	600067	冠城大通	144,900	1,037,484.00	0.17
251	600216	浙江医药	81,702	1,035,981.36	0.17
252	600260	凯乐科技	66,901	1,035,627.48	0.17
253	000703	恒逸石化	68,821	1,034,379.63	0.17
254	600298	安琪酵母	58,000	1,033,560.00	0.17
255	000418	小天鹅A	31,965	1,033,108.80	0.17
256	600536	中国软件	42,917	1,032,583.02	0.17
257	000816	智慧农业	162,300	1,032,228.00	0.17
258	300291	华录百纳	46,301	1,031,586.28	0.17
259	600651	飞乐音响	97,728	1,029,075.84	0.17
260	002437	誉衡药业	124,319	1,028,118.13	0.17
261	000937	冀中能源	151,859	1,023,529.66	0.17
262	600125	铁龙物流	126,500	1,022,120.00	0.17
263	000762	西藏矿业	59,625	1,015,413.75	0.17
264	002479	富春环保	68,300	1,012,206.00	0.17
265	002358	森源电气	52,704	1,010,862.72	0.17
266	002002	鸿达兴业	137,012	1,005,668.08	0.17
267	600557	康缘药业	59,100	1,000,563.00	0.17
268	600694	大商股份	24,937	995,734.41	0.17
269	002512	达华智能	60,503	988,013.99	0.17
270	601801	皖新传媒	56,045	984,710.65	0.17

271	002028	思源电气	74,662	984,045.16	0.17
272	000021	深科技	104,108	981,738.44	0.17
273	601311	骆驼股份	60,004	979,865.32	0.16
274	300166	东方国信	47,000	977,130.00	0.16
275	601010	文峰股份	185,050	973,363.00	0.16
276	002399	海普瑞	53,420	973,312.40	0.16
277	600880	博瑞传播	110,800	970,608.00	0.16
278	600169	太原重工	240,572	969,505.16	0.16
279	002635	安洁科技	26,628	969,259.20	0.16
280	300010	立思辰	58,211	967,466.82	0.16
281	600175	美都能源	193,424	957,448.80	0.16
282	002503	搜于特	66,500	956,935.00	0.16
283	600765	中航重机	66,518	953,202.94	0.16
284	601231	环旭电子	89,000	953,190.00	0.16
285	002325	洪涛股份	118,830	951,828.30	0.16
286	000777	中核科技	42,498	951,105.24	0.16
287	300202	聚龙股份	38,103	937,333.80	0.16
288	002041	登海种业	49,620	936,825.60	0.16
289	600058	五矿发展	61,472	936,218.56	0.16
290	600517	置信电气	95,760	931,744.80	0.16
291	600270	外运发展	56,300	931,202.00	0.16
292	300001	特锐德	53,700	931,158.00	0.16
293	600736	苏州高新	102,683	927,227.49	0.16
294	600259	广晟有色	21,760	924,582.40	0.16
295	000848	承德露露	82,510	923,286.90	0.16
296	002025	航天电器	36,546	920,959.20	0.15
297	600809	山西汾酒	36,800	920,736.00	0.15
298	002244	滨江集团	131,800	919,964.00	0.15
299	002581	未名医药	37,900	919,833.00	0.15
300	601717	郑煤机	130,700	918,821.00	0.15
301	002707	众信旅游	58,800	914,340.00	0.15

302	002285	世联行	120,188	913,428.80	0.15
303	000620	新华联	107,418	910,904.64	0.15
304	002106	莱宝高科	80,900	909,316.00	0.15
305	002269	美邦服饰	181,350	908,563.50	0.15
306	002368	太极股份	29,601	906,086.61	0.15
307	600291	西水股份	47,200	905,296.00	0.15
308	000158	常山股份	72,300	903,750.00	0.15
309	002396	星网锐捷	45,749	901,255.30	0.15
310	001696	宗申动力	95,754	900,087.60	0.15
311	000600	建投能源	101,100	897,768.00	0.15
312	600545	新疆城建	73,800	897,408.00	0.15
313	000587	金洲慈航	60,300	897,264.00	0.15
314	600639	浦东金桥	48,269	895,872.64	0.15
315	002589	瑞康医药	27,487	891,953.15	0.15
316	600835	上海机电	45,644	890,970.88	0.15
317	002063	远光软件	67,676	889,262.64	0.15
318	002344	海宁皮城	78,476	888,348.32	0.15
319	600220	江苏阳光	204,100	885,794.00	0.15
320	002123	梦网荣信	58,500	877,500.00	0.15
321	603188	亚邦股份	48,994	875,032.84	0.15
322	002354	天神娱乐	12,606	871,830.96	0.15
323	603077	和邦生物	169,800	869,376.00	0.15
324	600993	马应龙	43,380	866,298.60	0.15
325	600053	九鼎投资	18,805	866,158.30	0.15
326	600481	双良节能	115,000	864,800.00	0.15
327	002277	友阿股份	60,153	863,797.08	0.15
328	600537	亿晶光电	116,224	863,544.32	0.15
329	000636	风华高科	88,392	862,705.92	0.15
330	600282	南钢股份	278,256	862,593.60	0.15
331	601678	滨化股份	117,287	855,022.23	0.14
332	000616	海航投资	163,791	854,989.02	0.14

333	000572	海马汽车	159,100	852,776.00	0.14
334	002317	众生药业	69,032	852,545.20	0.14
335	601777	力帆股份	88,801	848,937.56	0.14
336	300257	开山股份	49,201	844,289.16	0.14
337	300147	香雪制药	65,410	843,789.00	0.14
338	002161	远望谷	73,000	841,690.00	0.14
339	600580	卧龙电气	92,377	840,630.70	0.14
340	000062	深圳华强	29,519	838,634.79	0.14
341	600277	亿利洁能	117,663	836,583.93	0.14
342	600894	广日股份	60,686	829,577.62	0.14
343	600826	兰生股份	30,203	825,145.96	0.14
344	000726	鲁泰A	64,400	824,964.00	0.14
345	000973	佛塑科技	109,895	824,212.50	0.14
346	002505	大康农业	232,300	822,342.00	0.14
347	600805	悦达投资	96,830	822,086.70	0.14
348	002482	广田集团	88,750	820,937.50	0.14
349	600433	冠豪高新	102,300	820,446.00	0.14
350	000652	泰达股份	148,200	818,064.00	0.14
351	000541	佛山照明	83,020	816,916.80	0.14
352	000090	天健集团	84,560	816,849.60	0.14
353	000501	鄂武商A	41,788	815,701.76	0.14
354	000528	柳工	111,570	815,576.70	0.14
355	002428	云南锗业	64,184	813,211.28	0.14
356	000830	鲁西化工	145,000	810,550.00	0.14
357	600729	重庆百货	34,502	808,381.86	0.14
358	600289	亿阳信通	62,400	808,080.00	0.14
359	002498	汉缆股份	187,838	807,703.40	0.14
360	002005	德豪润达	140,300	806,725.00	0.14
361	600112	天成控股	73,301	804,844.98	0.14
362	002463	沪电股份	168,038	803,221.64	0.14
363	002056	横店东磁	57,630	801,633.30	0.13

364	600458	时代新材	56,641	801,470.15	0.13
365	300297	蓝盾股份	64,400	801,136.00	0.13
366	000669	金鸿能源	46,688	800,699.20	0.13
367	600823	世茂股份	113,540	797,050.80	0.13
368	600750	江中药业	25,817	795,679.94	0.13
369	002128	露天煤业	92,285	793,651.00	0.13
370	000680	山推股份	142,900	790,237.00	0.13
371	002242	九阳股份	43,796	789,641.88	0.13
372	600596	新安股份	77,092	789,422.08	0.13
373	002064	华峰氨纶	143,500	787,815.00	0.13
374	002727	一心堂	37,030	785,036.00	0.13
375	600006	东风汽车	113,598	781,554.24	0.13
376	600351	亚宝药业	79,014	780,658.32	0.13
377	600859	王府井	47,830	778,672.40	0.13
378	002190	成飞集成	24,300	777,114.00	0.13
379	601689	拓普集团	26,400	776,688.00	0.13
380	000861	海印股份	159,980	775,903.00	0.13
381	600395	盘江股份	95,900	773,913.00	0.13
382	002690	美亚光电	36,490	772,128.40	0.13
383	000897	津滨发展	179,500	768,260.00	0.13
384	600628	新世界	54,300	767,259.00	0.13
385	002254	泰和新材	61,396	758,854.56	0.13
386	000969	安泰科技	71,884	757,657.36	0.13
387	601233	桐昆股份	52,755	757,561.80	0.13
388	000681	视觉中国	39,651	755,748.06	0.13
389	000596	古井贡酒	16,548	752,934.00	0.13
390	600428	中远航运	123,000	752,760.00	0.13
391	300032	金龙机电	46,700	751,403.00	0.13
392	603198	迎驾贡酒	34,717	748,151.35	0.13
393	600790	轻纺城	103,540	745,488.00	0.13
394	600869	智慧能源	96,000	743,040.00	0.12

395	002011	盾安环境	77,630	739,037.60	0.12
396	002642	荣之联	36,550	734,655.00	0.12
397	002588	史丹利	64,700	734,345.00	0.12
398	000552	靖远煤电	193,681	734,050.99	0.12
399	600773	西藏城投	61,521	733,945.53	0.12
400	000049	德赛电池	17,439	733,309.95	0.12
401	002699	美盛文化	21,671	732,479.80	0.12
402	600141	兴发集团	48,100	731,601.00	0.12
403	600496	精工钢构	170,680	730,510.40	0.12
404	601001	大同煤业	118,506	724,071.66	0.12
405	300043	星辉娱乐	71,400	723,996.00	0.12
406	002345	潮宏基	59,706	721,248.48	0.12
407	300039	上海凯宝	70,242	718,575.66	0.12
408	600850	华东电脑	29,673	717,493.14	0.12
409	600720	祁连山	87,800	717,326.00	0.12
410	000099	中信海直	60,869	712,775.99	0.12
411	600563	法拉电子	19,401	711,434.67	0.12
412	600757	长江传媒	85,530	710,754.30	0.12
413	600280	中央商场	82,432	709,739.52	0.12
414	603369	今世缘	54,000	708,480.00	0.12
415	600329	中新药业	40,582	707,750.08	0.12
416	603883	老百姓	15,105	704,648.25	0.12
417	601886	江河创建	66,080	703,752.00	0.12
418	600059	古越龙山	68,475	701,184.00	0.12
419	000869	张裕A	19,465	700,740.00	0.12
420	002663	普邦股份	114,823	696,975.61	0.12
421	002681	奋达科技	53,760	695,116.80	0.12
422	600292	中电远达	55,999	692,707.63	0.12
423	600862	南通科技	56,400	690,336.00	0.12
424	002371	七星电子	25,949	690,243.40	0.12
425	600586	金晶科技	146,300	677,369.00	0.11

426	002332	仙琚制药	52,500	675,675.00	0.11
427	002093	国脉科技	61,028	675,579.96	0.11
428	000417	合肥百货	77,403	667,987.89	0.11
429	600460	士兰微	107,360	667,779.20	0.11
430	600657	信达地产	107,800	657,580.00	0.11
431	000931	中关村	77,442	655,933.74	0.11
432	002029	七匹狼	64,000	653,440.00	0.11
433	002342	巨力索具	94,511	653,071.01	0.11
434	600825	新华传媒	74,901	650,889.69	0.11
435	002309	中利集团	45,500	646,555.00	0.11
436	600195	中牧股份	30,273	643,301.25	0.11
437	600831	广电网络	48,800	637,328.00	0.11
438	000426	兴业矿业	72,960	636,211.20	0.11
439	002551	尚荣医疗	31,827	633,675.57	0.11
440	600748	上实发展	76,610	627,435.90	0.11
441	002416	爱施德	42,300	623,079.00	0.10
442	600640	号百控股	30,702	613,425.96	0.10
443	601908	京运通	85,912	611,693.44	0.10
444	002414	高德红外	26,819	610,936.82	0.10
445	002251	步步高	36,945	607,745.25	0.10
446	601002	晋亿实业	63,800	607,376.00	0.10
447	000877	天山股份	85,800	604,890.00	0.10
448	002698	博实股份	38,809	604,256.13	0.10
449	600743	华远地产	133,650	594,742.50	0.10
450	600180	瑞茂通	43,900	594,406.00	0.10
451	600776	东方通信	68,602	587,233.12	0.10
452	000919	金陵药业	42,624	576,702.72	0.10
453	603528	多伦科技	8,800	575,080.00	0.10
454	600251	冠农股份	67,500	547,425.00	0.09
455	600338	西藏珠峰	18,722	542,563.56	0.09
456	600801	华新水泥	69,600	539,400.00	0.09

457	603555	贵人鸟	17,464	537,192.64	0.09
458	603355	莱克电气	11,606	535,849.02	0.09
459	600425	青松建化	114,900	534,285.00	0.09
460	600335	国机汽车	43,899	533,372.85	0.09
461	603806	福斯特	11,504	532,290.08	0.09
462	603001	奥康国际	22,951	525,577.90	0.09
463	603169	兰石重装	39,301	525,061.36	0.09
464	002327	富安娜	59,000	519,200.00	0.09
465	002118	紫鑫药业	72,104	519,148.80	0.09
466	002745	木林森	14,100	514,509.00	0.09
467	600397	安源煤业	99,300	512,388.00	0.09
468	600551	时代出版	25,121	510,458.72	0.09
469	600864	哈投股份	44,598	509,309.16	0.09
470	601016	节能风电	57,100	505,335.00	0.08
471	000631	顺发恒业	102,760	503,524.00	0.08
472	002315	焦点科技	8,318	501,492.22	0.08
473	002392	北京利尔	85,901	494,789.76	0.08
474	600483	福能股份	44,420	491,729.40	0.08
475	603698	航天工程	17,802	491,157.18	0.08
476	600874	创业环保	60,300	490,239.00	0.08
477	002646	青青稞酒	25,334	487,679.50	0.08
478	603005	晶方科技	16,101	483,674.04	0.08
479	603567	珍宝岛	24,316	480,484.16	0.08
480	002233	塔牌集团	51,200	478,720.00	0.08
481	600184	光电股份	21,754	469,451.32	0.08
482	600618	氯碱化工	32,100	468,339.00	0.08
483	603328	依顿电子	14,298	457,250.04	0.08
484	000517	荣安地产	85,800	451,308.00	0.08
485	600971	恒源煤电	71,289	446,982.03	0.08
486	000723	美锦能源	29,500	446,040.00	0.07
487	002249	大洋电机	50,800	438,404.00	0.07

488	603568	伟明环保	18,491	430,840.30	0.07
489	000025	特力A	7,600	420,052.00	0.07
490	600088	中视传媒	18,843	413,038.56	0.07
491	002194	武汉凡谷	31,427	404,151.22	0.07
492	600468	百利电气	30,280	394,245.60	0.07
493	002238	天威视讯	26,120	382,658.00	0.06
494	603868	飞科电器	6,900	323,334.00	0.05
495	600917	重庆燃气	23,691	312,484.29	0.05
496	603377	东方时尚	7,200	290,664.00	0.05
497	600981	汇鸿集团	33,600	285,264.00	0.05
498	603025	大豪科技	7,007	273,483.21	0.05
499	603866	桃李面包	6,100	267,790.00	0.05
500	000761	本钢板材	43,000	231,340.00	0.04

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	000887	中鼎股份	76,200	1,976,628.00	0.33
2	601005	重庆钢铁	422,600	1,064,952.00	0.18
3	000693	ST华泽	49,788	622,350.00	0.10

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	002466	天齐锂业	9,085,239.51	1.39
2	600079	人福医药	7,794,163.03	1.19
3	300072	三聚环保	7,400,583.41	1.13
4	600201	生物股份	7,380,395.60	1.13

5	600584	长电科技	6,876,008.54	1.05
6	600521	华海药业	6,852,908.38	1.05
7	600522	中天科技	6,822,680.87	1.04
8	002508	老板电器	6,796,788.20	1.04
9	600699	均胜电子	6,733,206.28	1.03
10	002426	胜利精密	6,498,439.30	0.99
11	002030	达安基因	6,494,414.01	0.99
12	002572	索菲亚	6,460,678.66	0.99
13	002405	四维图新	6,256,457.32	0.96
14	002131	利欧股份	6,233,715.65	0.95
15	000656	金科股份	6,225,279.02	0.95
16	000887	中鼎股份	6,100,261.61	0.93
17	600664	哈药股份	5,886,335.93	0.90
18	002085	万丰奥威	5,870,332.58	0.90
19	000661	长春高新	5,809,732.77	0.89
20	002038	双鹭药业	5,734,622.32	0.88

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

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002466	天齐锂业	12,660,744.12	1.93
2	300072	三聚环保	11,969,416.23	1.83
3	002085	万丰奥威	8,417,611.02	1.29
4	600079	人福医药	8,171,165.91	1.25
5	600498	烽火通信	7,389,995.39	1.13
6	600201	生物股份	7,286,606.03	1.11
7	600522	中天科技	7,174,950.06	1.10
8	600521	华海药业	7,075,299.24	1.08
9	002049	紫光国芯	7,055,251.57	1.08

10	002508	老板电器	6,885,328.77	1.05
11	600978	宜华生活	6,829,964.20	1.04
12	002310	东方园林	6,820,279.13	1.04
13	600584	长电科技	6,751,711.89	1.03
14	600482	风帆股份	6,718,435.19	1.03
15	002030	达安基因	6,696,576.30	1.02
16	002405	四维图新	6,679,456.91	1.02
17	002426	胜利精密	6,581,124.81	1.00
18	000887	中鼎股份	6,553,076.96	1.00
19	002131	利欧股份	6,432,581.97	0.98
20	002299	圣农发展	6,330,001.66	0.97

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

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	1,717,249,501.76
卖出股票的收入（成交）总额	1,687,803,151.96

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

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。

8.12.2

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。

8.12.3 期末其他各项资产构成

金额单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,179,983.83
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	15,977.69
5	应收申购款	2,530,831.87
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	4,726,793.39

8.12.4 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。

8.12.5 期末股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 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。

8.12.5.2 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	000887	中鼎股份	1,976,628.00	0.33	重大事项
2	601005	重庆钢铁	1,064,952.00	0.18	重要事项未公告
3	000693	ST华泽	622,350.00	0.10	重大资产重组

8.12.6 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。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	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
440,897	1,333.78	10,148,082.45	1.73%	577,910,038.78	98.27%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	2,833,295.29	0.480%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	持有基金份额总量的数量区间 (万份)
本公司高级管理人员、基金投资和研	>100

究部门负责人持有本开放式基金	
本基金基金经理持有本开放式基金	

9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	1.70%	10,000,000.00	1.70%	三年
基金管理人高级管理人员	—	—	—	—	
基金经理等人员	—	—	—	—	
基金管理人股东	—	—	—	—	
其他	—	—	—	—	
合计	10,000,000.00	1.70%	10,000,000.00	1.70%	

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2015年1月20日)基金份额总额	10,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	541,157,410.82
本报告期基金总申购份额	3,626,689,424.50
减：本报告期基金总赎回份额	3,579,788,714.09
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	588,058,121.23

注：总申购份额含转换转入份额，总赎回份额含转换转出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，宁辰、张磊先生已离任本公司副总经理职务，具体信息请参见基金管理人于2016年4月30日和2016年7月2日披露的《天弘基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略没有改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内应向普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）支付服务费6.9万元。截至本报告期末，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）已为本基金提供审计服务2年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内管理人、托管人及其高级管理人员没有发生受稽查或处罚的情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占股票成交总额比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
国泰君安	2	3,404,161,359.02	100.00%	787,430.16	100.00%	

11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占债券成交总额比例	成交金额	占债券回购成交总额比例	成交金额	占权证成交总额比例

国泰君安	—	—	—	—	—	—
------	---	---	---	---	---	---

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

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

3、本基金报告期内新租用交易单元：无。

4、本基金报告期内停止租用交易单元：无。

11.8 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2016年1月4日指数熔断期间调整旗下部分基金开放时间的公告	中国证监会指定媒介	2016-01-04
2	天弘基金管理有限公司关于在指数熔断实施期间调整旗下交易所场内基金开放时间的公告	中国证监会指定媒介	2016-01-06
3	天弘基金管理有限公司关于2016年1月7日指数熔断期间调整旗下部分基金开放时间的公告	中国证监会指定媒介	2016-01-07
4	天弘基金管理有限公司关于增加上海长量基金销售投资顾问有限公司为旗下基金代销机构并开通定投及转换业务以及参加其相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-01-08
5	天弘基金管理有限公司关于增加深圳市新兰德证券投资咨询有限公司为旗下基金代销机构并开通定投及转换业务以及参加其相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-01-14
6	天弘基金管理有限公司关于增加中经北证（北京）资产管理有限公司为旗下基金代销机构并开	中国证监会指定媒介	2016-01-20

	通定投及转换业务以及参加其相关费率优惠活动的公告		
7	天弘中证500指数型发起式证券投资基金2015年第4季度报告	中国证监会指定媒介	2016-01-22
8	天弘基金管理有限公司关于对使用余额宝支付功能申购的投资者开展费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-01-28
9	天弘基金管理有限公司关于增加上海好买基金销售有限公司为旗下基金代销机构并开通定投及转换业务以及参加其相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-02-01
10	天弘基金管理有限公司关于增加上海陆金所资产管理有限公司为旗下基金代销机构并参加其相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-02-15
11	天弘基金管理有限公司关于调整天弘中证500指数型发起式证券投资基金基金经理的公告	中国证监会指定媒介	2016-02-22
12	天弘基金管理有限公司关于对使用“财富通”银联支付渠道进行申（认）购的投资者开展费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-02-24
13	天弘基金管理有限公司关于增加北京蕙次方资产管理有限公司为旗下基金代销机构并开通定投及转换业务以及参加其相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-03-04
14	天弘中证500指数型发起式证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会指定媒介	2016-03-04
15	天弘中证500指数型发起式证券投资基金招募说明书（更新）摘要	中国证监会指定媒介	2016-03-04

16	天弘基金管理有限公司关于提醒客户谨防虚假客服电话诈骗的风险提示公告	中国证监会指定媒介	2016-03-05
17	天弘基金管理有限公司关于对使用余额宝支付功能申（认）购的投资者开展费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-03-09
18	天弘基金管理有限公司关于增加上海中正达广投资管理有限公司为旗下基金代销机构并开通定投及转换业务以及参加其相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-03-11
19	天弘中证500指数型发起式证券投资基金2015年年度报告摘要	中国证监会指定媒介	2016-03-30
20	天弘中证500指数型发起式证券投资基金2015年年度报告	中国证监会指定媒介	2016-03-30
21	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金参加深圳市新兰德证券投资咨询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	2016-04-01
22	天弘基金管理有限公司广州分公司关于营业场所变更的公告	中国证监会指定媒介	2016-04-07
23	天弘基金管理有限公司关于增加上海利得基金销售有限公司为旗下基金代销机构以及参加其相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-04-08
24	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金参加北京葱次方资产管理有限公司申购等费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-04-13
25	天弘中证500指数型发起式证券投资基金2016年第1季度报告	中国证监会指定媒介	2016-04-21
26	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会指定媒介	2016-04-23
27	天弘基金管理有限公司关于高级	中国证监会指定媒介	2016-04-30

	管理人员变更的公告		
28	天弘基金管理有限公司关于参加中证金牛（北京）投资咨询有限公司相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-05-09
29	天弘基金管理有限公司关于增加泰信财富投资管理有限公司为旗下基金代销机构并开通转换业务以及参加其相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-05-11
30	天弘基金管理有限公司关于开展指定基金份额转换业务费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-05-18
31	天弘基金管理有限公司关于旗下基金参加杭州数米基金销售有限公司（认）申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-05-30
32	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金开通基金转换业务的公告	中国证监会指定媒介	2016-06-07
33	天弘基金管理有限公司关于增加北京广源达信投资管理有限公司为旗下基金销售机构并开通转换业务以及参加其相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-06-16
34	天弘基金管理有限公司关于在网上交易系统开通易宝支付的第三方支付业务并实施申购费率优惠的公告	中国证监会指定媒介	2016-06-24
35	天弘基金管理有限公司旗下基金2016年6月30日基金资产净值公告	中国证监会指定媒介	2016-07-01
36	天弘基金管理有限公司关于旗下基金在陆金所资管开通定投业务	中国证监会指定媒介	2016-07-01

	并参与其费率优惠活动的公告		
37	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会指定媒介	2016-07-02
38	天弘基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会指定媒介	2016-07-02
39	天弘基金管理有限公司关于增加深圳前海凯恩斯基金销售有限公司为旗下基金销售机构并开通定投及转换业务以及参加其相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-07-11
40	天弘中证500指数型发起式证券投资基金2016年第2季度报告	中国证监会指定媒介	2016-07-19
41	天弘基金管理有限公司关于增加上海万得投资顾问有限公司为旗下部分基金销售机构并开通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	2016-07-29
42	天弘基金管理有限公司关于对通过大树财富移动客户端银网络支付渠道进行申（认）购的投资者开展费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-08-02
43	天弘基金管理有限公司关于增加上海大智慧财富管理有限公司为旗下部分基金销售机构以及参加其相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-08-18
44	天弘基金管理有限公司关于增加北京乐融多源投资咨询有限公司为旗下部分基金销售机构并开通定投及转换业务以及参加其相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-08-18
45	天弘中证500指数型发起式证券投资基金2016年半年度报告	中国证监会指定媒介	2016-08-29
46	天弘中证500指数型发起式证券投资基金2016年半年度报告摘要	中国证监会指定媒介	2016-08-29

47	天弘基金管理有限公司关于增加北京肯特瑞财富投资管理有限公司为旗下基金销售机构并开通申购、赎回、转换业务以及 参加其相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-08-31
48	天弘基金管理有限公司关于增加北京创金启富投资管理有限公司为旗下基金销售机构并开通申购、赎回、转换及定投业务 以及参加其相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-08-31
49	天弘中证500指数型发起式证券投资基金招募说明书（更新）摘要	中国证监会指定媒介	2016-09-02
50	天弘中证500指数型发起式证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会指定媒介	2016-09-02
51	天弘基金管理有限公司关于增加众升财富（北京）基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、转换及定投业务以及参加其相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-09-06
52	天弘基金管理有限公司关于增加奕丰金融服务（深圳）有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、转换及定投业务以及参加其相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-09-06
53	天弘基金管理有限公司关于增加北京汇成基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、转换及定投业务以及参加其相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-09-06
54	天弘基金管理有限公司关于降低旗下部分基金最低赎回限额及最	中国证监会指定媒介	2016-09-14

	低持有份额的公告		
55	天弘基金管理有限公司关于增加钱滚滚财富投资管理（上海）有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投及转换业务以及参加其相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-09-19
56	天弘基金管理有限公司关于增加北京格上富信投资顾问有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投及转换业务以及参加其相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-10-17
57	天弘基金管理有限公司关于增加上海汇付金融服务有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投及转换业务以及参加其相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-10-18
58	天弘基金管理有限公司关于增加北京广源达信投资管理有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投及转换业务以及参加其相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-10-24
59	天弘中证500指数型发起式证券投资基金2016年第3季度报告	中国证监会指定媒介	2016-10-26
60	天弘基金管理有限公司关于增加浙江金观诚财富管理有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投及转换业务以及参加其相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-10-27
61	天弘基金管理有限公司关于增加北京新浪仓石基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构并开通	中国证监会指定媒介	2016-10-28

	申购、赎回、定投及转换业务以及参加其相关费率优惠活动的公告		
62	天弘基金管理有限公司关于增加北京钱景财富投资管理有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投及转换业务以及参加其相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-11-01
63	天弘基金管理有限公司关于对使用余额宝支付功能申购旗下部分基金的投资者开展申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-11-08
64	天弘基金管理有限公司关于增加凤凰金信（银川）投资管理有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投及转换业务以及参加其相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-11-11
65	天弘基金管理有限公司关于在网上交易系统开通浦发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	2016-12-01
66	天弘基金管理有限公司旗下基金2016年12月30日基金资产净值公告	中国证监会指定媒介	2016-12-30
67	天弘基金管理有限公司旗下基金2016年12月31日基金资产净值公告	中国证监会指定媒介	2016-12-31

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准天弘中证500指数型发起式证券投资基金募集的文件

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

12.2 存放地点

天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层

12.3 查阅方式

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

公司网站：www.thfund.com.cn

天弘基金管理有限公司

二〇一七年三月三十日