

天弘中证800指数型发起式证券投资基金2017年年度报告摘要

2017年12月31日

基金管理人：天弘基金管理有限公司

基金托管人：广发证券股份有限公司

送出日期：2018年03月29日

## § 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。

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

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

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

本年度报告摘要摘自年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读年度报告正文。

本报告期自2017年1月1日起至2017年12月31日止。

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金简称	天弘中证800	
基金主代码	001588	
基金运作方式	契约型开放式、发起式	
基金合同生效日	2015年07月16日	
基金管理人	天弘基金管理有限公司	
基金托管人	广发证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	152,833,386.43份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	天弘中证800A	天弘中证800C
下属分级基金的交易代码	001588	001589
报告期末下属分级基金的份 额总额	142,852,728.31份	9,980,658.12份

### 2.2 基金产品说明

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

### 2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

名称	天弘基金管理有限公司		广发证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	童建林	崔瑞娟
	联系电话	022-83310208	020-87555888
	电子邮箱	service@thfund.com.cn	cuirj@gf.com.cn
客户服务电话	95046	95575	
传真	022-83865569	020-87555129	

## 2.4 信息披露方式

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

## §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	天弘中证800A		
	2017年	2016年	2015年07月 16日-2015年 12月31日
本期已实现收益	16,118,300.59	-297,588.44	-199,370.87
本期利润	21,910,575.42	-653,270.84	-523,828.27
加权平均基金份额本期利润	0.1499	-0.0915	-0.0846
本期基金份额净值增长率	17.73%	-12.52%	-9.09%
3.1.2 期末数据和指标	2017年末	2016年末	2015年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0637	-0.2047	-0.0909
期末基金资产净值	133,755,118.00	5,663,317.14	5,694,251.02
期末基金份额净值	0.9363	0.7953	0.9091

3.1.3 期间数据和指标	天弘中证800C		
	2017年	2016年	2015年07月

			16日-2015年 12月31日
本期已实现收益	1,459,688.24	-225,173.60	-162,053.34
本期利润	1,674,467.31	-598,630.70	-460,038.90
加权平均基金份额本期利润	0.1501	-0.1163	-0.0920
本期基金份额净值增长率	17.46%	-12.74%	-9.20%
<b>3.1.4 期末数据和指标</b>	2017年末	2016年末	2015年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0694	-0.2077	-0.0920
期末基金资产净值	9,287,608.61	4,654,575.73	4,539,961.10
期末基金份额净值	0.9306	0.7923	0.9080

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

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

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

4、本基金《基金合同》2015年7月16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

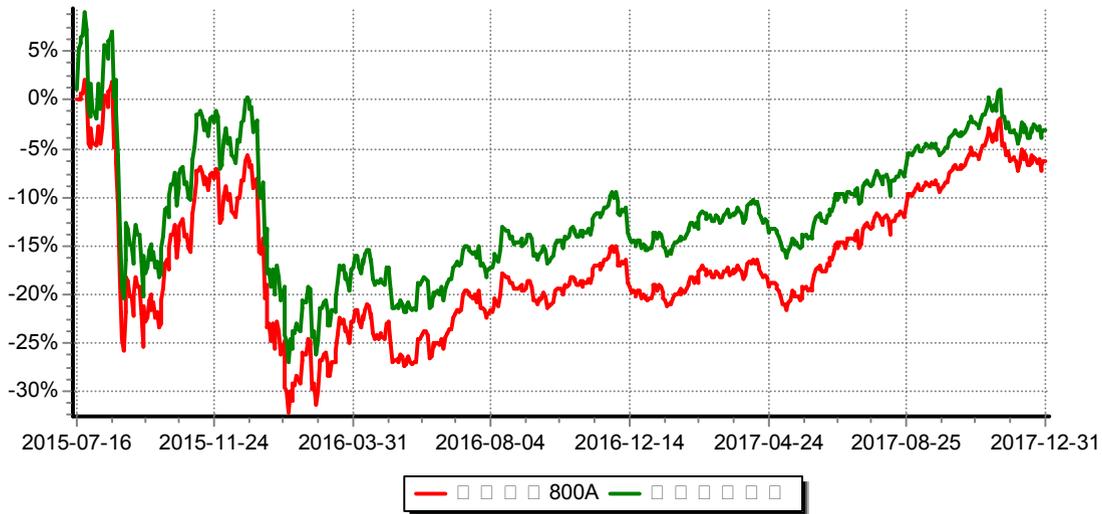
阶段 (天弘中证800A)	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	2.29%	0.72%	2.03%	0.72%	0.26%	0.00%
过去六个月	9.62%	0.66%	7.31%	0.66%	2.31%	0.00%
过去一年	17.73%	0.62%	14.40%	0.62%	3.33%	0.00%
自基金合同生效日起至今	-6.37%	1.43%	-3.02%	1.44%	-3.35%	-0.01%

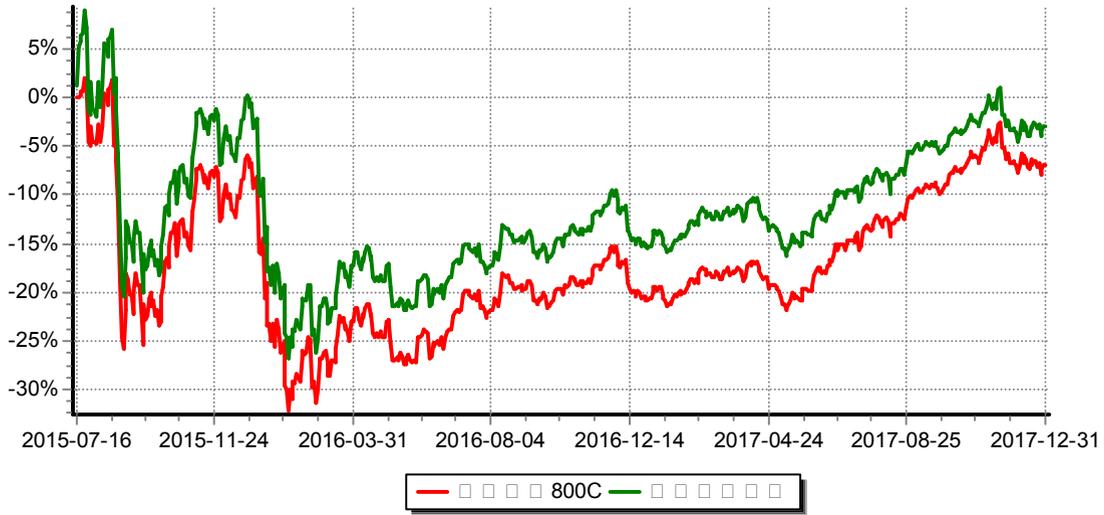
阶段 (天弘中证800C)	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率④	①-③	②-④
------------------	----------	-------------	------------	------------	-----	-----

		差②	③	标准差 ④		
过去三个月	2.24%	0.72%	2.03%	0.72%	0.21%	0.00%
过去六个月	9.51%	0.66%	7.31%	0.66%	2.20%	0.00%
过去一年	17.46%	0.62%	14.40%	0.62%	3.06%	0.00%
自基金合同生效日起 至今	-6.94%	1.43%	-3.02%	1.44%	-3.92%	-0.01%

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

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

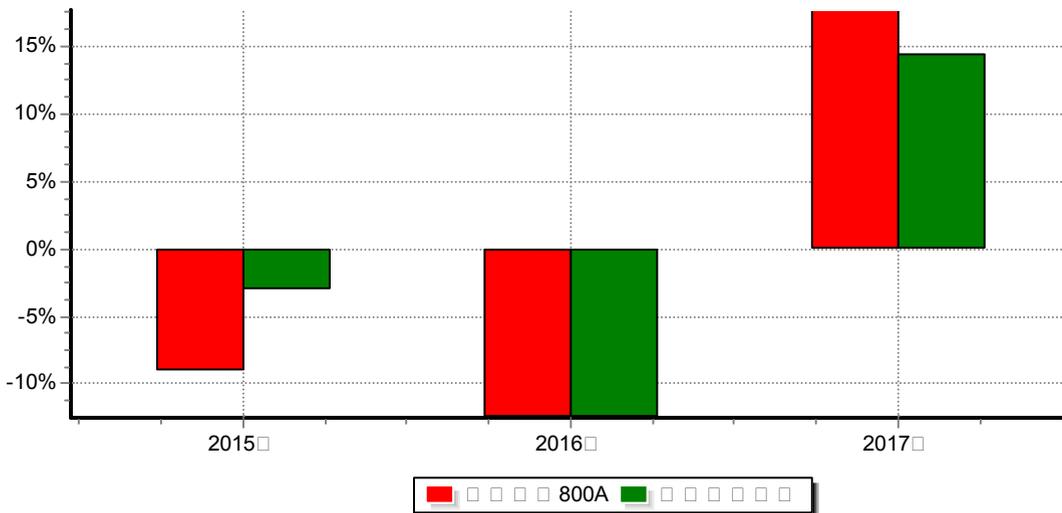


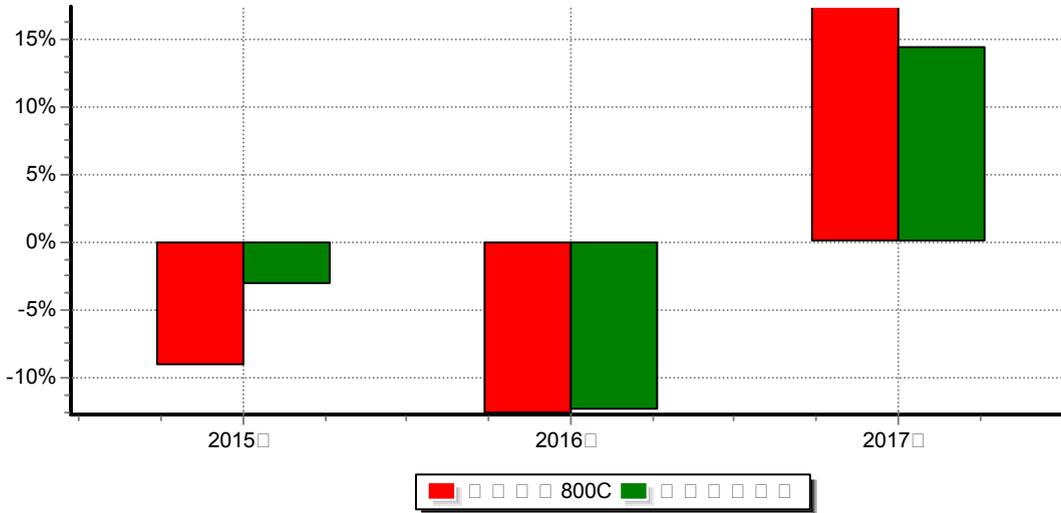


注：1、本《基金合同》于2015年7月16日生效。

2、本报告期内，本基金的各项投资比例达到基金合同约定的各项比例要求。

### 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7月16日生效。基金合同生效当年2015年的净值增长率按照基金合同生效后当年的实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金自基金合同生效以来无利润分配情况，符合相关法规及基金合同的规定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

合计	100%
----	------

截至2017年12月31日，本基金管理人共管理55只基金：天弘精选混合型证券投资基金、天弘永利债券型证券投资基金、天弘永定价值成长混合型证券投资基金、天弘周期策略混合型证券投资基金、天弘文化新兴产业股票型证券投资基金（原“天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金”）、天弘添利债券型证券投资基金（LOF）、天弘丰利债券型证券投资基金（LOF）、天弘现金管家货币市场基金、天弘债券型发起式证券投资基金、天弘安康养老混合型证券投资基金、天弘余额宝货币市场基金、天弘稳利定期开放债券型证券投资基金、天弘弘利债券型证券投资基金、天弘通利混合型证券投资基金、天弘同利债券型证券投资基金（LOF）、天弘瑞利分级债券型证券投资基金、天弘沪深300指数型发起式证券投资基金、天弘中证500指数型发起式证券投资基金、天弘云端生活优选灵活配置混合型证券投资基金、天弘新活力灵活配置混合型发起式证券投资基金、天弘互联网灵活配置混合型证券投资基金、天弘惠利灵活配置混合型证券投资基金、天弘新价值灵活配置混合型证券投资基金、天弘云商宝货币市场基金、天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金、天弘中证医药100指数型发起式证券投资基金、天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金、天弘中证全指运输指数型发起式证券投资基金、天弘中证移动互联网指数型发起式证券投资基金、天弘中证证券保险指数型发起式证券投资基金、天弘中证银行指数型发起式证券投资基金、天弘创业板指数型发起式证券投资基金、天弘中证高端装备制造指数型发起式证券投资基金、天弘上证50指数型发起式证券投资基金、天弘中证100指数型发起式证券投资基金、天弘中证800指数型发起式证券投资基金、天弘中证环保产业指数型发起式证券投资基金、天弘中证电子指数型发起式证券投资基金、天弘中证休闲娱乐指数型发起式证券投资基金、天弘中证计算机指数型发起式证券投资基金、天弘中证食品饮料指数型发起式证券投资基金、天弘弘运宝货币市场基金、天弘裕利灵活配置混合型证券投资基金、天弘乐享保本混合型证券投资基金、天弘价值精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、天弘安盈灵活配置混合型证券投资基金、天弘喜利灵活配置混合型证券投资基金、天弘信利债券型证券投资基金、天弘聚利灵活配置混合型证券投资基金、天弘金利灵活配置混合型证券投资基金、天弘金明灵活配置混合型证券投资基金、天弘天盈灵活配置混合型证券投资基金、天弘策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、天弘优选债券型证券投资基金、天弘尊享定期开放债券型发起式证券投资基金。

#### 4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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

刘冬	本基金基金经理。	2015年07月	2017年04月	11年	男，经济学硕士。2007年7月至2008年10月在长江证券股份有限公司研究部任宏观策略研究员。2008年11月加盟本公司，历任本公司投资部固定收益研究员、宏观策略研究员、基金经理助理等。
张子法	本基金基金经理。	2017年04月	—	15年	男，软件工程硕士。历任华夏基金管理有限公司金融工程师量化研究员。2014年3月加盟本公司，历任股票研究员、基金经理助理。

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、本年度报告截止日至报告批准送出一日之间，本基金管理人于2018年2月12日增聘陈瑶女士为本基金基金经理。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

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

本报告期内，本基金运作合法合规，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

#### 4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

##### 4.3.1 公平交易制度和控制方法

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

针对公司旗下所有投资组合的交易所公开竞价交易，通过交易系统内的公平交易

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

#### 4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

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

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

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

#### 4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

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

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

### 4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

#### 4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内，本基金在运作过程中严格遵守基金合同，坚持既定的指数化投资策略，对指数基金操作采取被动复制与组合优化相结合的方式。

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

#### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2017年12月31日，天弘中证800A基金份额净值为0.9363元，天弘中证800C基金份额净值为0.9306元。报告期内份额净值增长率天弘中证800A为17.73%，天弘中证800C为17.46%，同期业绩比较基准增长率为14.40%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

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

#### 4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

益。估值委员会由公司分管固定收益投资的高级管理人员、督察长、分管估值业务的IT运维总监、投资研究部负责人组成。

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

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

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

报告期内，本基金管理人未与任何第三方签定与估值相关的定价服务。

#### **4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明**

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

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

本报告期内本基金管理人无应说明预警信息。

### **§ 5 托管人报告**

#### **5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明**

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

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

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

本报告期内，天弘中证800指数型发起式证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对天弘基金管理有限公司编制和披露的天弘中证800指数型发起式证券投资基金2017年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

### § 6 审计报告

本报告期本基金财务会计报告经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计, 该所出具了“无保留意见的审计报告”, 且在审计报告中无强调事项。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

### § 7 年度财务报表

#### 7.1 资产负债表

会计主体：天弘中证800指数型发起式证券投资基金

报告截止日：2017年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2017年12月31日	上年度末 2016年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	7.4.7.1	9,385,826.33	748,453.38
结算备付金		39,739.99	2,184.20
存出保证金		34,594.80	1,317.91
交易性金融资产	7.4.7.2	133,771,581.45	9,716,027.39
其中：股票投资		133,771,581.45	9,716,027.39
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		84,410.74	—
应收利息	7.4.7.5	6,540.50	167.82

应收股利		—	—
应收申购款		554,838.75	14,747.24
递延所得税资产		—	—
其他资产	7.4.7.6	—	—
资产总计		143,877,532.56	10,482,897.94
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2017年12月31日</b>	<b>上年度末 2016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	7.4.7.3	—	—
卖出回购金融资产款		—	—
应付证券清算款		—	15.95
应付赎回款		565,629.40	20,125.49
应付管理人报酬		68,825.37	4,380.81
应付托管费		13,765.10	876.15
应付销售服务费		1,955.27	978.59
应付交易费用	7.4.7.7	45,541.91	624.20
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	139,088.90	138,003.88
负债合计		834,805.95	165,005.07
<b>所有者权益:</b>			
实收基金	7.4.7.9	152,833,386.43	12,995,799.45
未分配利润	7.4.7.10	-9,790,659.82	-2,677,906.58
所有者权益合计		143,042,726.61	10,317,892.87
负债和所有者权益总计		143,877,532.56	10,482,897.94

注：报告截止日2017年12月31日，天弘中证800指数型发起式证券投资基金A类基金份额净值0.9363元，天弘中证800指数型发起式证券投资基金C类基金份额净值0.9306元；基金份额总额

152,833,386.43份，其中天弘中证800指数型发起式证券投资基金A类基金份额142,852,728.31份，天弘中证800指数型发起式证券投资基金C类基金份额9,980,658.12份。

## 7.2 利润表

会计主体：天弘中证800指数型发起式证券投资基金

本报告期：2017年01月01日至2017年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2017年01月01日至 2017年12月31日	上年度可比期间 2016年01月01日至 2016年12月31日
一、收入		24,905,866.13	-1,012,073.11
1. 利息收入		82,718.69	5,800.82
其中：存款利息收入	7.4.7.11	82,718.69	5,800.82
债券利息收入		—	—
资产支持证券利息收入		—	—
买入返售金融资产收入		—	—
其他利息收入		—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）		18,804,929.92	-289,761.91
其中：股票投资收益	7.4.7.12	16,059,638.68	-445,783.66
基金投资收益		—	—
债券投资收益	7.4.7.13	—	—
资产支持证券投资收益		—	—
贵金属投资收益	7.4.7.14	—	—
衍生工具收益	7.4.7.15	—	—
股利收益	7.4.7.16	2,745,291.24	156,021.75
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	6,007,053.90	-729,139.50
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	11,163.62	1,027.48
<b>减: 二、费用</b>		1,320,823.40	239,828.43
1. 管理人报酬		679,993.77	47,731.58
2. 托管费		135,998.71	9,546.27
3. 销售服务费		23,484.56	9,984.30
4. 交易费用	7.4.7.19	316,171.93	5,206.28
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	165,174.43	167,360.00
<b>三、利润总额 (亏损总额以“-”号填列)</b>		23,585,042.73	-1,251,901.54
减: 所得税费用		—	—
<b>四、净利润 (净亏损以“-”号填列)</b>		23,585,042.73	-1,251,901.54

### 7.3 所有者权益 (基金净值) 变动表

会计主体: 天弘中证800指数型发起式证券投资基金

本报告期: 2017年01月01日至2017年12月31日

单位: 人民币元

项目	本期		
	2017年01月01日至2017年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益 (基金净值)	12,995,799.45	-2,677,906.58	10,317,892.87
二、本期经营活动产生的基金净值变动数 (本期利润)	—	23,585,042.73	23,585,042.73
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)	139,837,586.98	-30,697,795.97	109,139,791.01

其中：1. 基金申购款	332,948,878.73	-44,879,394.37	288,069,484.36
2. 基金赎回款	-193,111,291.75	14,181,598.40	-178,929,693.35
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）	152,833,386.43	-9,790,659.82	143,042,726.61
项 目	上年度可比期间2016年01月01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）	11,263,417.37	-1,029,205.25	10,234,212.12
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	-1,251,901.54	-1,251,901.54
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	1,732,382.08	-396,799.79	1,335,582.29
其中：1. 基金申购款	8,181,154.41	-1,814,342.46	6,366,811.95
2. 基金赎回款	-6,448,772.33	1,417,542.67	-5,031,229.66
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）	12,995,799.45	-2,677,906.58	10,317,892.87

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

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

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘中证800指数型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资对象是具有良好流动性的金融工具，以中证800指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于其他股票（非标的指数成份股及其备选成份股，含中小板、中证800及其他经中国证监会核准上市的股票）、银行存款、债券、债券回购、权证、股指期货、资产支持证券、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会的相关规定）。本基金投资于股票的资产比例不低于基金资产的90%，投资于中证800指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的80%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准：中证800指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。

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

出。

#### 7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称“企业会计准则”)、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《天弘中证800指数型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的相关规定,发起式基金的基金合同生效三年后,若基金资产净值低于人民币两亿元的,基金合同自动终止。于2017年12月31日,本基金的基金资产净值为人民币143,042,726.61元,且本基金的基金合同将于未来12个月内生效满三年,本基金的管理人预计基金资产净值届时将高于人民币两亿元,故本财务报表以持续经营为基础编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2017年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2017年12月31日的财务状况以及2017年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

#### 7.4.4 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相一致。

#### 7.4.5 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。

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

天弘创新资产管理有限公司（“天弘创新”）	基金管理人的全资子公司
----------------------	-------------

注：1、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2、本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

#### 7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.18.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 7.4.8.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年01月01日至2017年12月 31日		上年度可比期间 2016年01月01日至2016年12月 31日	
	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例	成交金额	占当期股票 成交总额的比 例
广发证券股份 有限公司	445,747,804.0 9	100.00%	7,135,129.51	100.00%

###### 7.4.8.1.2 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。

###### 7.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年01月01日至2017年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金 总量的比例	期末应付佣金 余额	占期末应付佣 金总量的比例
广发证券股份 有限公司	103,108.02	100.00%	45,541.91	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2016年01月01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 金总量的比例

广发证券股份 有限公司	1,650.97	100.00%	624.20	100.00%
----------------	----------	---------	--------	---------

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

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

#### 7.4.8.2 关联方报酬

##### 7.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日至2017年 12月31日	上年度可比期间 2016年01月01日至2016年 12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	679,993.77	47,731.58
其中：支付销售机构的客户维护费	6,291.30	1,465.45

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

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

##### 7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日至2017年 12月31日	上年度可比期间 2016年01月01日至2016年 12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	135,998.71	9,546.27

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

##### 7.4.8.2.3 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 2017年01月01日至2017年12月31日		
	天弘中证800A	天弘中证800C	合计
天弘基金管理有限公司	—	19,134.94	19,134.94
广发证券股份有限公司	—	27.40	27.40
合计	—	19,162.34	19,162.34
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间2016年01月01日至2016年12月31日		
	天弘中证800A	天弘中证800C	合计
天弘基金管理有限公司	—	9,705.32	9,705.32
广发证券股份有限公司	—	9.49	9.49
合计	—	9,714.81	9,714.81

注：基金支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值一定比例的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给天弘基金管理有限公司，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。本基金 A 类基金份额不收取销售服务费，C 类基金份额的销售服务费年费率为 0.25%。其计算公式为：日销售服务费 = 前一日基金资产净值 X 0.25% / 当年天数。

#### 7.4.8.3 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。

#### 7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：人民币元

项目	本期 2017年01月01日至2017年 12月31日		上年度可比期间 2016年01月01日至2016年 12月31日	
	天弘中证 800A	天弘中证 800C	天弘中证 800A	天弘中证 800C
期初持有的基金份额	5,000,000.	5,000,000.	5,000,000.	5,000,000.

	00	00	00	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	5,000,000.00	5,000,000.00	5,000,000.00	5,000,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	3.27%	3.27%	38.47%	38.47%

注：基金管理人投资本基金相关的费用按基金合同及更新的招募说明书的有关规定支付。

#### 7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末及上年度末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

#### 7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年01月01日至2017年12月 31日		上年度可比期间 2016年01月01日至2016年12月 31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
广发证券股份有限公司	9,385,826.33	78,572.35	748,453.38	5,707.13

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

#### 7.4.8.6 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证券交易。

#### 7.4.8.7 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指数投资部分的关联交易，严格履行了相关审批程序，且取得托管人同意。

#### 7.4.9 期末（2017年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.9.1 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

##### 7.4.9.1.1 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
002466	天齐锂业	2017-12-26	2018-01-03	配股未上市	11.06	53.21	942	10,418.52	50,123.82
300664	鹏鹞环保	2017-12-28	2018-01-05	新股中签	8.88	8.88	3,640	32,323.20	32,323.20
603080	新疆火炬	2017-12-25	2018-01-03	新股中签	13.60	13.60	1,187	16,143.20	16,143.20
002923	润都股份	2017-12-28	2018-01-05	新股中签	17.01	17.01	744	12,655.44	12,655.44

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘价	数量 (股)	期末成本总额	期末估值总额
600309	万华化学	2017-12-05	重大资产重组	37.94			15,580	388,739.76	591,105.20
601600	中国铝业	2017-09-12	重大资产重组	6.67	2018-02-26	7.28	81,300	415,839.24	542,271.00
002739	万达电影	2017-07-04	重大资产重组	45.93			6,300	344,676.88	289,359.00
000540	中天金融	2017-08-21	重大资产重组	7.35			35,500	248,640.99	260,925.00
600332	白云山	2017-10-31	重大资产重组	32.14	2018-01-08	30.15	6,300	176,165.41	202,482.00
300156	神雾环保	2017-07-17	重大资产重组	24.16	2018-01-17	21.74	8,200	268,684.87	198,112.00
600157	永泰能源	2017-11-21	重大资产重组	3.36			56,400	232,318.11	189,504.00

600150	中国船舶	2017-09-27	重大资产重组	24.67	2018-03-21	22.20	7,603	235,348.64	187,566.01
600666	奥德	2017-04-27	重大事项	19.25			9,600	167,135.00	184,800.00
002470	金正大	2017-10-25	重大事项	9.15	2018-02-09	8.24	17,400	129,610.28	159,210.00
002366	台海核电	2017-12-06	重大资产重组	26.45			6,000	149,751.71	158,700.00
000930	中粮生化	2017-10-24	重大资产重组	13.34			10,700	140,992.59	142,738.00
600525	长园集团	2017-12-25	重要事项未公告	15.79	2018-01-10	17.3	8,941	135,660.26	141,178.39
300383	光环新网	2017-11-07	拟披露重大事项	13.19	2018-03-19	14.51	9,900	122,296.84	130,581.00
000547	航天发展	2017-10-30	重大事项	10.83			11,201	172,300.52	121,306.83
000979	中弘股份	2017-09-07	重大资产重组	1.94	2018-02-14	1.75	62,160	119,046.04	120,590.40
000031	中粮地产	2017-07-24	重大资产重组	8.00			14,700	133,456.80	117,600.00
000566	海南医药	2017-11-22	重大资产重组	12.89			9,100	122,831.46	117,299.00
000592	平潭发展	2017-08-09	重大资产重组	5.75	2018-01-29	5.7	20,101	126,885.35	115,580.75
000006	深振业A	2017-09-11	重大资产重组	9.85	2018-03-08	8.87	11,700	105,994.16	115,245.00
002512	达华智能	2017-12-06	拟披露重大事项	18.07	2018-03-06	16.26	6,301	98,697.43	113,859.07
000401	冀东水泥	2017-11-21	重大资产重组	13.79	2018-01-15	15.17	7,600	165,614.30	104,804.00
002004	华邦健康	2017-12-14	重大事项	6.73	2018-03-14	7.30	15,300	129,379.45	102,969.00
300104	乐视网	2017-04-17	重大资产重组	3.91	2018-01-24	13.8	25,402	402,865.75	99,321.82
600664	哈药股份	2017-09-28	重大资产重组	5.81	2018-02-27	6.00	16,841	120,296.20	97,846.21
600645	中源协和	2017-10-09	重大资产重组	28.40	2018-01-19	25.56	3,400	81,451.04	96,560.00

600685	中船防务	2017-09-27	重大资产重组	26.66	2018-03-21	24.05	3,600	137,372.94	95,976.00
000806	银河生物	2017-07-18	重大资产重组	10.76	2018-01-18	10.01	8,900	105,450.19	95,764.00
000939	凯迪生态	2017-11-16	重大资产重组	4.99			17,800	101,545.80	88,822.00
300159	新研股份	2017-11-23	重大资产重组	10.40	2018-03-22	9.36	8,500	129,651.02	88,400.00
600614	鹏起科技	2017-12-26	重要事项未公告	10.16			8,500	100,719.30	86,360.00
002745	木林森	2017-12-28	重大事项	45.50	2018-01-05	46.50	1,800	83,735.50	81,900.00
600187	国中水务	2017-11-09	重大资产重组	4.68	2018-03-20	4.21	15,000	92,232.03	70,200.00
000926	福星股份	2017-12-26	重大事项	10.89	2018-01-10	11.98	6,203	75,402.21	67,550.67
002122	天马股份	2017-12-19	重大事项	8.49			7,602	77,203.60	64,540.98
300134	大富科技	2017-12-18	拟披露重大事项	16.45	2018-03-19	14.81	3,900	78,519.97	64,155.00
002358	森源电气	2017-12-07	重大资产重组	14.86	2018-03-07	15.05	4,300	80,412.63	63,898.00
000766	通化金马	2017-11-24	重大资产重组	13.60			4,400	74,744.56	59,840.00
300116	坚瑞沃能	2017-12-18	重大资产重组	7.62			7,800	76,009.90	59,436.00
300010	立思辰	2017-11-17	拟披露重大事项	11.17	2018-02-22	10.05	4,900	75,439.58	54,733.00
000156	华数传媒	2017-12-26	重大事项	11.40			4,700	66,473.81	53,580.00
300032	金龙机电	2017-11-27	拟披露重大事项	13.89			3,701	52,269.65	51,406.89
002345	潮宏基	2017-12-20	重大事项	10.75			4,701	53,092.52	50,535.75
002344	海宁皮城	2017-11-01	拟披露重大事项	7.93	2018-01-31	7.44	5,800	61,316.79	45,994.00
300730	科创信息	2017-12-25	重大事项	41.55	2018-01-02	45.71	821	6,863.56	34,112.55

600485	信威集团	2016-12-26	重大资产重组	14.59			900	22,317.22	13,131.00
002168	深圳惠程	2017-12-19	拟披露重大事项	13.76			600	7,064.93	8,256.00
000693	*ST华泽	2016-03-01	重大事项	12.50	2018-03-21	11.88	200	3,902.00	2,500.00

注：本基金截至2017年12月31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。

### 7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

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

#### 7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

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

### 7.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

#### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

###### (i) 各层次金融工具公允价值

于2017年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为127,707,854.09元，属于第二层次的余额为5,964,405.54元，属于第三层次的余额为99,321.82元(2016年12月31日：第一层次9,333,898.53元，第二层次382,128.86元，无属于第三层次的余额)。

###### (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期

间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

上述第三层次资产变动如下：

	交易性金融资产 权益工具投资	合计
2017年1月1日	-	-
购买	-	-
出售	-	-
转入第三层级	284,121.37	284,121.37
转出第三层级	-	-
当期利得或损失总额	-184,799.55	-184,799.55
计入损益的利得或损失	-184,799.55	-184,799.55
2017年12月31日	<u>99,321.82</u>	<u>99,321.82</u>
2017年12月31日仍持有的资产计入 2017年度损益的未实现利得或损失的变动 ——公允价值变动损益	<u>-293,457.93</u>	<u>-293,457.93</u>

计入损益的利得或损失是计入利润表中的公允价值变动收益等项目。

使用重要不可观察输入值的第三层次公允价值计量的相关信息如下：

交易性金融资产——	2017年12月 31日公允价值	估值技术	名称	不可观察输入值	
				范围/加 权平均值	与公允价 值之间的 关系
乐视网	99,321.82	可比公司 法	市销率	2.5倍	正相关

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2017年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2016年12月31日：同)。

(d) 不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 增值税

根据财政部、国家税务总局于2016年12月21日颁布的财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。

根据财政部、国家税务总局于2017年6月30日颁布的财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。

此外，财政部、国家税务总局于2017年12月25日颁布的财税[2017]90号《关于租入固定资产进行税额抵扣等增值税政策的通知》对资管产品管理人自2018年1月1日起运营资管产品提供的贷款服务、发生的部分金融商品转让业务的销售额确定做出规定。

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

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

## §8 投资组合报告

### 8.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	133,771,581.45	92.98
	其中：股票	133,771,581.45	92.98
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	9,425,566.32	6.55
8	其他各项资产	680,384.79	0.47
9	合计	143,877,532.56	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	851,208.78	0.60
B	采矿业	4,349,319.37	3.04
C	制造业	59,269,165.50	41.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,739,167.08	2.61
E	建筑业	4,529,604.09	3.17
F	批发和零售业	3,887,621.76	2.72
G	交通运输、仓储和邮政业	4,276,434.37	2.99
H	住宿和餐饮业	45,206.00	0.03
I	信息传输、软件和信息技术服务业	6,668,377.62	4.66
J	金融业	33,412,470.24	23.36
K	房地产业	6,930,072.58	4.84
L	租赁和商务服务业	1,738,359.83	1.22
M	科学研究和技术服务业	96,560.00	0.07
N	水利、环境和公共设施管理业	1,033,855.84	0.72
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	43,978.00	0.03
Q	卫生和社会工作	413,012.60	0.29
R	文化、体育和娱乐业	1,234,478.99	0.86
S	综合	270,682.50	0.19
	合计	132,789,575.15	92.83

### 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	2,500.00	—
C	制造业	779,647.59	0.55
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	16,143.20	0.01
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	17,957.94	0.01
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	133,434.37	0.09
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	32,323.20	0.02
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	982,006.30	0.69

注：由于指数成份股调整，上表所列示股票中，中国船舶(证券代码：600150)、奥瑞德(证券代码：600666)、\*ST华泽(证券代码：000693)、深圳惠程(证券代码：002168)、乐视网(证券代码：300104)、神雾环保(证券代码：300156)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前十名股票投资明细

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	601318	中国平安	89,645	6,273,357.10	4.39
2	600519	贵州茅台	4,200	2,929,458.00	2.05
3	600036	招商银行	85,200	2,472,504.00	1.73
4	000333	美的集团	37,550	2,081,396.50	1.46
5	601166	兴业银行	103,100	1,751,669.00	1.22
6	000651	格力电器	39,700	1,734,890.00	1.21
7	600016	民生银行	195,400	1,639,406.00	1.15
8	600887	伊利股份	50,300	1,619,157.00	1.13
9	601328	交通银行	227,400	1,412,154.00	0.99
10	000858	五粮液	15,700	1,254,116.00	0.88

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于本公司网站的年度报告正文。

### 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前五名股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	300156	神雾环保	8,200	198,112.00	0.14
2	600150	中国船舶	7,603	187,566.01	0.13
3	600666	奥瑞德	9,600	184,800.00	0.13
4	300104	乐视网	25,402	99,321.82	0.07
5	000726	鲁泰A	4,700	51,465.00	0.04

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于本公司网站的年度报告正文。

## 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	601318	中国平安	8,737,688.98	84.68
2	600519	贵州茅台	4,461,621.99	43.24
3	600036	招商银行	3,983,904.00	38.61
4	601166	兴业银行	3,722,423.00	36.08

5	600016	民生银行	3,564,348.00	34.55
6	000333	美的集团	3,535,051.00	34.26
7	000651	格力电器	3,355,999.00	32.53
8	601328	交通银行	3,056,066.88	29.62
9	000002	万科A	2,890,643.00	28.02
10	601668	中国建筑	2,672,836.00	25.90
11	600000	浦发银行	2,553,677.00	24.75
12	600887	伊利股份	2,475,414.00	23.99
13	600030	中信证券	2,386,520.34	23.13
14	601288	农业银行	2,372,778.00	23.00
15	600837	海通证券	2,078,033.00	20.14
16	601398	工商银行	2,003,694.00	19.42
17	601169	北京银行	1,977,680.14	19.17
18	000858	五粮液	1,977,524.00	19.17
19	000725	京东方A	1,842,866.00	17.86
20	601601	中国太保	1,786,899.00	17.32
21	601766	中国中车	1,784,727.00	17.30
22	000001	平安银行	1,752,246.00	16.98
23	002415	海康威视	1,748,068.00	16.94
24	600104	上汽集团	1,722,641.73	16.70
25	600900	长江电力	1,708,651.00	16.56
26	600276	恒瑞医药	1,569,866.20	15.21
27	601211	国泰君安	1,470,768.83	14.25
28	601988	中国银行	1,413,889.00	13.70
29	600048	保利地产	1,366,555.43	13.24
30	600050	中国联通	1,188,132.00	11.52
31	601390	中国中铁	1,167,997.00	11.32
32	601818	光大银行	1,157,026.11	11.21
33	600019	宝钢股份	1,140,122.00	11.05
34	600028	中国石化	1,122,807.00	10.88
35	601186	中国铁建	1,106,287.00	10.72

36	600518	康美药业	1,054,375.00	10.22
37	600015	华夏银行	1,047,251.00	10.15
38	002304	洋河股份	1,046,602.00	10.14
39	601688	华泰证券	1,038,711.00	10.07
40	601989	中国重工	936,498.00	9.08
41	000063	中兴通讯	929,395.00	9.01
42	000538	云南白药	869,606.00	8.43
43	001979	招商蛇口	853,138.00	8.27
44	002450	康得新	851,834.00	8.26
45	601006	大秦铁路	849,314.00	8.23
46	600703	三安光电	836,858.00	8.11
47	600585	海螺水泥	831,802.00	8.06
48	600958	东方证券	815,060.00	7.90
49	601628	中国人寿	786,359.00	7.62
50	002027	分众传媒	770,973.00	7.47
51	002024	苏宁云商	752,691.00	7.30
52	600340	华夏幸福	744,216.00	7.21
53	601857	中国石油	739,915.00	7.17
54	601336	新华保险	738,846.00	7.16
55	601939	建设银行	737,613.00	7.15
56	600690	青岛海尔	736,891.00	7.14
57	601009	南京银行	719,859.00	6.98
58	002594	比亚迪	716,396.00	6.94
59	600919	江苏银行	708,915.00	6.87
60	600089	特变电工	703,875.20	6.82
61	601899	紫金矿业	693,801.00	6.72
62	600795	国电电力	687,283.00	6.66
63	601088	中国神华	680,281.00	6.59
64	300070	碧水源	679,627.11	6.59
65	600999	招商证券	668,983.00	6.48
66	002230	科大讯飞	667,723.60	6.47

67	002142	宁波银行	651,679.00	6.32
68	601669	中国电建	649,406.00	6.29
69	000166	申万宏源	643,586.00	6.24
70	300072	三聚环保	638,061.22	6.18
71	600009	上海机场	637,618.00	6.18
72	000568	泸州老窖	626,394.90	6.07
73	601377	兴业证券	622,515.00	6.03
74	000423	东阿阿胶	616,361.44	5.97
75	002736	国信证券	614,719.68	5.96
76	600196	复星医药	613,696.00	5.95
77	601985	中国核电	612,271.00	5.93
78	600741	华域汽车	597,676.89	5.79
79	300059	东方财富	594,442.00	5.76
80	600660	福耀玻璃	590,178.00	5.72
81	000768	中航飞机	587,537.57	5.69
82	000783	长江证券	578,772.00	5.61
83	002241	歌尔股份	573,913.84	5.56
84	601901	方正证券	572,683.00	5.55
85	000413	东旭光电	564,665.00	5.47
86	600068	葛洲坝	564,343.00	5.47
87	600010	包钢股份	562,774.00	5.45
88	600893	航发动力	561,185.97	5.44
89	600029	南方航空	560,794.00	5.44
90	000338	潍柴动力	558,853.00	5.42
91	600886	国投电力	552,399.00	5.35
92	002456	欧菲科技	551,879.88	5.35
93	601888	中国国旅	545,751.00	5.29
94	300136	信维通信	536,143.00	5.20
95	601099	太平洋	527,771.00	5.12
96	600031	三一重工	525,203.00	5.09
97	000625	长安汽车	524,937.00	5.09

98	002008	大族激光	519,003.00	5.03
99	600221	海航控股	517,719.00	5.02
100	601788	光大证券	516,942.00	5.01
101	600066	宇通客车	512,294.80	4.97
102	002236	大华股份	509,406.00	4.94
103	600606	绿地控股	502,543.00	4.87
104	601618	中国中冶	500,206.00	4.85
105	002202	金风科技	499,661.60	4.84
106	601012	隆基股份	497,084.00	4.82
107	600111	北方稀土	496,274.00	4.81
108	002460	赣锋锂业	494,615.00	4.79
109	601607	上海医药	488,325.00	4.73
110	601555	东吴证券	487,767.00	4.73
111	000839	中信国安	487,620.00	4.73
112	600637	东方明珠	484,438.00	4.70
113	600705	中航资本	479,752.69	4.65
114	002673	西部证券	475,541.50	4.61
115	000100	TCL 集团	474,015.00	4.59
116	000069	华侨城 A	473,449.00	4.59
117	601933	永辉超市	473,203.00	4.59
118	000728	国元证券	473,105.40	4.59
119	601727	上海电气	471,658.00	4.57
120	600383	金地集团	469,284.00	4.55
121	600522	中天科技	468,934.00	4.54
122	600109	国金证券	464,035.00	4.50
123	600309	万华化学	460,079.00	4.46
124	601800	中国交建	457,058.00	4.43
125	600535	天士力	457,033.00	4.43
126	002252	上海莱士	454,608.00	4.41
127	000503	海虹控股	453,731.00	4.40
128	600570	恒生电子	452,434.00	4.38

129	002475	立讯精密	451,486.00	4.38
130	002466	天齐锂业	445,320.52	4.32
131	000963	华东医药	440,139.86	4.27
132	601600	中国铝业	437,795.00	4.24
133	600406	国电南瑞	436,524.00	4.23
134	000895	双汇发展	434,046.00	4.21
135	300124	汇川技术	432,113.96	4.19
136	600547	山东黄金	428,875.00	4.16
137	600271	航天信息	428,473.52	4.15
138	002074	国轩高科	425,294.00	4.12
139	600115	东方航空	414,504.00	4.02
140	601919	中远海控	412,183.00	3.99
141	600201	生物股份	410,150.00	3.98
142	000776	广发证券	409,112.00	3.97
143	600100	同方股份	408,393.00	3.96
144	000709	河钢股份	408,155.00	3.96
145	300024	机器人	407,845.00	3.95
146	600023	浙能电力	406,075.00	3.94
147	600352	浙江龙盛	401,351.00	3.89
148	601018	宁波港	395,957.00	3.84
149	600804	鹏博士	393,873.00	3.82
150	601225	陕西煤业	388,183.00	3.76
151	002310	东方园林	387,164.00	3.75
152	600739	辽宁成大	386,144.00	3.74
153	002508	老板电器	384,694.00	3.73
154	600177	雅戈尔	382,428.00	3.71
155	601992	金隅股份	381,139.00	3.69
156	600816	安信信托	380,668.00	3.69
157	600208	新湖中宝	380,543.00	3.69
158	000157	中联重科	374,805.00	3.63
159	000623	吉林敖东	374,409.00	3.63

160	600674	川投能源	372,831.00	3.61
161	300104	乐视网	372,326.00	3.61
162	000661	长春高新	370,960.00	3.60
163	002405	四维图新	364,786.00	3.54
164	600489	中金黄金	362,979.22	3.52
165	002146	荣盛发展	357,675.00	3.47
166	002044	美年健康	355,470.00	3.45
167	002572	索菲亚	355,198.00	3.44
168	600176	中国巨石	355,123.58	3.44
169	601111	中国国航	354,074.00	3.43
170	002065	东华软件	353,474.00	3.43
171	600018	上港集团	353,356.00	3.42
172	000656	金科股份	351,580.00	3.41
173	601998	中信银行	347,545.00	3.37
174	002007	华兰生物	346,716.00	3.36
175	600219	南山铝业	345,772.00	3.35
176	600820	隧道股份	345,161.00	3.35
177	000826	启迪桑德	344,427.00	3.34
178	600482	中国动力	343,931.00	3.33
179	000630	铜陵有色	343,871.00	3.33
180	000009	中国宝安	342,659.00	3.32
181	002465	海格通信	342,015.00	3.31
182	002081	金螳螂	341,444.00	3.31
183	600415	小商品城	340,873.00	3.30
184	601198	东兴证券	340,036.00	3.30
185	600487	亨通光电	339,927.00	3.29
186	600643	爱建集团	338,224.00	3.28
187	600079	人福医药	332,035.00	3.22
188	600118	中国卫星	330,697.88	3.21
189	002739	万达电影	330,641.00	3.20
190	000066	中国长城	329,590.00	3.19

191	600153	建发股份	329,406.78	3.19
192	600584	长电科技	329,125.00	3.19
193	603993	洛阳钼业	329,122.00	3.19
194	600011	华能国际	328,854.00	3.19
195	600436	片仔癀	326,352.00	3.16
196	002558	巨人网络	324,771.00	3.15
197	600525	长园集团	321,209.00	3.11
198	601333	广深铁路	320,205.00	3.10
199	600170	上海建工	319,522.00	3.10
200	600362	江西铜业	318,868.74	3.09
201	000750	国海证券	317,809.00	3.08
202	603799	华友钴业	317,689.00	3.08
203	000060	中金岭南	316,782.00	3.07
204	300003	乐普医疗	315,679.00	3.06
205	002271	东方雨虹	315,385.00	3.06
206	300015	爱尔眼科	314,655.00	3.05
207	600085	同仁堂	314,007.00	3.04
208	002092	中泰化学	312,425.00	3.03
209	600875	东方电气	310,451.00	3.01
210	300017	网宿科技	310,300.00	3.01
211	000425	徐工机械	307,198.00	2.98
212	002340	格林美	305,765.00	2.96
213	601155	新城控股	304,758.00	2.95
214	000793	华闻传媒	304,486.00	2.95
215	600663	陆家嘴	303,495.00	2.94
216	000792	盐湖股份	299,260.00	2.90
217	600008	首创股份	298,841.00	2.90
218	000876	新希望	298,567.00	2.89
219	000998	隆平高科	297,952.00	2.89
220	002500	山西证券	297,740.00	2.89
221	002797	第一创业	297,419.00	2.88

222	600649	城投控股	295,793.59	2.87
223	002422	科伦药业	295,767.00	2.87
224	600642	申能股份	293,683.00	2.85
225	600718	东软集团	293,053.31	2.84
226	600315	上海家化	292,831.69	2.84
227	002407	多氟多	291,194.00	2.82
228	600297	广汇汽车	289,963.00	2.81
229	600369	西南证券	288,326.00	2.79
230	000786	北新建材	287,933.00	2.79
231	600150	中国船舶	281,021.00	2.72
232	600583	海油工程	279,544.00	2.71
233	300315	掌趣科技	278,917.00	2.70
234	601168	西部矿业	278,474.00	2.70
235	300115	长盈精密	277,410.00	2.69
236	601997	贵阳银行	277,318.00	2.69
237	601633	长城汽车	277,316.00	2.69
238	002573	清新环境	275,268.00	2.67
239	600516	方大炭素	274,654.00	2.66
240	300027	华谊兄弟	274,481.15	2.66
241	600879	航天电子	273,031.00	2.65
242	000983	西山煤电	272,589.00	2.64
243	600061	国投资本	272,410.00	2.64
244	600498	烽火通信	272,140.00	2.64
245	600157	永泰能源	271,878.00	2.64
246	000686	东北证券	271,648.00	2.63
247	600266	北京城建	271,458.00	2.63
248	300156	神雾环保	271,066.00	2.63
249	601229	上海银行	270,457.00	2.62
250	300088	长信科技	268,033.00	2.60
251	600256	广汇能源	267,545.00	2.59
252	000402	金融街	266,088.00	2.58

253	300182	捷成股份	264,451.00	2.56
254	600867	通化东宝	263,780.00	2.56
255	600166	福田汽车	263,686.00	2.56
256	600521	华海药业	261,488.00	2.53
257	600959	江苏有线	261,314.90	2.53
258	000050	深天马A	261,139.00	2.53
259	600839	四川长虹	260,699.00	2.53
260	300033	同花顺	259,970.00	2.52
261	000540	中天金融	259,659.00	2.52
262	600435	北方导航	257,254.00	2.49
263	002085	万丰奥威	255,773.00	2.48
264	000997	新大陆	255,436.00	2.48
265	002183	怡亚通	254,826.00	2.47
266	000039	中集集团	252,956.00	2.45
267	600325	华发股份	252,548.00	2.45
268	300144	宋城演艺	251,390.50	2.44
269	000778	新兴铸管	250,923.00	2.43
270	600588	用友网络	250,736.00	2.43
271	002714	牧原股份	250,232.71	2.43
272	000977	浪潮信息	249,914.20	2.42
273	601000	唐山港	249,761.00	2.42
274	000581	威孚高科	248,799.00	2.41
275	603019	中科曙光	247,326.00	2.40
276	000415	渤海金控	244,530.00	2.37
277	600022	山东钢铁	244,327.00	2.37
278	601258	庞大集团	243,982.00	2.36
279	002179	中航光电	243,909.00	2.36
280	601718	际华集团	241,581.00	2.34
281	600388	龙净环保	239,879.00	2.32
282	600376	首开股份	238,218.00	2.31
283	002311	海大集团	237,488.00	2.30

284	000008	神州高铁	237,060.00	2.30
285	600426	华鲁恒升	236,841.60	2.30
286	002385	大北农	236,215.00	2.29
287	600060	海信电器	235,742.00	2.28
288	000559	万向钱潮	234,397.00	2.27
289	600688	上海石化	233,649.00	2.26
290	601117	中国化学	233,316.00	2.26
291	600056	中国医药	232,560.00	2.25
292	600895	张江高科	232,272.00	2.25
293	600614	鹏起科技	231,604.00	2.24
294	300266	兴源环境	231,030.00	2.24
295	000970	中科三环	228,537.00	2.21
296	002001	新 和 成	228,261.00	2.21
297	000418	小天鹅A	227,714.00	2.21
298	600682	南京新百	227,676.00	2.21
299	600291	西水股份	226,992.00	2.20
300	600600	青岛啤酒	226,587.00	2.20
301	603444	吉比特	226,384.00	2.19
302	002273	水晶光电	224,460.00	2.18
303	601866	中远海发	224,390.00	2.17
304	002352	顺丰控股	222,669.00	2.16
305	000690	宝新能源	222,657.00	2.16
306	002439	启明星辰	221,680.00	2.15
307	300055	万邦达	221,565.00	2.15
308	300296	利亚德	221,125.00	2.14
309	002410	广联达	220,802.00	2.14
310	002354	天神娱乐	219,992.00	2.13
311	002176	江特电机	219,281.00	2.13
312	600717	天津港	218,738.00	2.12
313	600827	百联股份	218,674.00	2.12
314	002050	三花智控	218,628.00	2.12

315	000878	云南铜业	218,437.60	2.12
316	603589	口子窖	217,539.00	2.11
317	000028	国药一致	217,426.00	2.11
318	000488	晨鸣纸业	217,364.00	2.11
319	600138	中青旅	217,175.00	2.10
320	600704	物产中大	215,621.27	2.09
321	002635	安洁科技	214,689.00	2.08
322	002602	世纪华通	214,672.00	2.08
323	000917	电广传媒	214,664.00	2.08
324	000959	首钢股份	214,655.00	2.08
325	002223	鱼跃医疗	214,654.00	2.08
326	002583	海能达	214,642.00	2.08
327	600332	白云山	213,984.00	2.07
328	600978	宜华生活	213,818.00	2.07
329	600038	中直股份	213,497.00	2.07
330	002411	必康股份	212,696.12	2.06
331	002294	信立泰	212,220.00	2.06
332	000627	天茂集团	211,791.00	2.05
333	600298	安琪酵母	211,696.00	2.05
334	002195	二三四五	210,734.00	2.04
335	600438	通威股份	210,602.00	2.04
336	600811	东方集团	210,584.00	2.04
337	600575	皖江物流	210,223.00	2.04
338	600240	华业资本	210,098.00	2.04
339	002038	双鹭药业	209,885.00	2.03
340	000999	华润三九	209,092.00	2.03
341	600528	中铁工业	208,348.00	2.02
342	600755	厦门国贸	207,624.00	2.01
343	600503	华丽家族	207,115.00	2.01
344	002013	中航机电	207,057.00	2.01
345	000401	冀东水泥	206,885.00	2.01

346	600500	中化国际	206,669.00	2.00
347	600418	江淮汽车	206,438.00	2.00

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	601318	中国平安	7,278,462.60	70.54
2	600519	贵州茅台	3,363,108.40	32.59
3	600036	招商银行	2,962,846.00	28.72
4	000333	美的集团	2,804,709.15	27.18
5	000002	万科A	2,617,123.40	25.36
6	000651	格力电器	2,575,758.86	24.96
7	601166	兴业银行	2,321,889.00	22.50
8	600016	民生银行	2,115,596.00	20.50
9	600887	伊利股份	1,916,228.04	18.57
10	601328	交通银行	1,805,933.00	17.50
11	000858	五粮液	1,658,021.00	16.07
12	600000	浦发银行	1,514,875.12	14.68
13	601288	农业银行	1,500,508.00	14.54
14	601668	中国建筑	1,500,115.00	14.54
15	600030	中信证券	1,478,957.00	14.33
16	601398	工商银行	1,340,131.00	12.99
17	601601	中国太保	1,334,904.00	12.94
18	000001	平安银行	1,307,879.77	12.68
19	000725	京东方A	1,287,051.00	12.47
20	002415	海康威视	1,262,141.00	12.23
21	601766	中国中车	1,252,088.00	12.14
22	600837	海通证券	1,170,878.00	11.35
23	600104	上汽集团	1,124,680.79	10.90

24	600276	恒瑞医药	1,121,968.00	10.87
25	601169	北京银行	1,113,543.05	10.79
26	600900	长江电力	1,104,690.00	10.71
27	601211	国泰君安	991,520.10	9.61
28	601988	中国银行	882,915.00	8.56
29	600048	保利地产	878,287.00	8.51
30	000063	中兴通讯	773,652.00	7.50
31	601390	中国中铁	751,035.00	7.28
32	600019	宝钢股份	740,190.31	7.17
33	002304	洋河股份	711,324.00	6.89
34	601818	光大银行	685,399.00	6.64
35	600028	中国石化	662,416.77	6.42
36	600518	康美药业	662,193.00	6.42
37	601688	华泰证券	651,991.79	6.32
38	002450	康得新	625,254.00	6.06
39	600015	华夏银行	612,948.24	5.94
40	600703	三安光电	603,436.00	5.85
41	601186	中国铁建	571,979.92	5.54
42	601336	新华保险	555,341.24	5.38
43	000538	云南白药	555,305.70	5.38
44	600690	青岛海尔	549,359.00	5.32
45	002230	科大讯飞	542,675.00	5.26
46	600585	海螺水泥	540,683.67	5.24
47	601989	中国重工	535,103.00	5.19
48	601006	大秦铁路	524,562.00	5.08
49	601628	中国人寿	514,539.00	4.99
50	600487	亨通光电	509,881.72	4.94
51	600050	中国联通	502,503.00	4.87
52	002024	苏宁云商	478,071.00	4.63
53	601939	建设银行	477,920.00	4.63
54	001979	招商蛇口	475,582.39	4.61

55	600958	东方证券	470,851.00	4.56
56	000568	泸州老窖	461,066.20	4.47
57	002142	宁波银行	447,952.00	4.34
58	002008	大族激光	433,008.00	4.20
59	600009	上海机场	426,858.00	4.14
60	600196	复星医药	424,054.00	4.11
61	601899	紫金矿业	421,395.00	4.08
62	601088	中国神华	416,988.00	4.04
63	600999	招商证券	414,966.00	4.02
64	601888	中国国旅	414,739.94	4.02
65	002456	欧菲科技	408,099.00	3.96
66	002460	赣锋锂业	400,218.38	3.88
67	601009	南京银行	399,844.00	3.88
68	600741	华域汽车	392,736.80	3.81
69	000338	潍柴动力	387,509.00	3.76
70	300136	信维通信	385,075.35	3.73
71	600660	福耀玻璃	375,620.00	3.64
72	600029	南方航空	373,150.00	3.62
73	600795	国电电力	369,062.00	3.58
74	600089	特变电工	365,653.94	3.54
75	600340	华夏幸福	365,442.00	3.54
76	601933	永辉超市	362,254.00	3.51
77	000423	东阿阿胶	359,766.00	3.49
78	601377	兴业证券	352,618.00	3.42
79	002241	歌尔股份	350,447.00	3.40
80	300070	碧水源	347,721.00	3.37
81	601012	隆基股份	346,936.00	3.36
82	000166	申万宏源	345,691.00	3.35
83	600010	包钢股份	345,287.00	3.35
84	601669	中国电建	343,454.00	3.33
85	601985	中国核电	342,765.00	3.32

86	002202	金风科技	338,734.00	3.28
87	300072	三聚环保	338,405.90	3.28
88	601857	中国石油	333,404.02	3.23
89	300059	东方财富	331,962.00	3.22
90	002594	比亚迪	327,705.00	3.18
91	002236	大华股份	327,552.00	3.17
92	002736	国信证券	321,872.40	3.12
93	600111	北方稀土	309,975.00	3.00
94	601901	方正证券	305,280.00	2.96
95	600886	国投电力	304,094.00	2.95
96	600066	宇通客车	302,753.00	2.93
97	002027	分众传媒	301,519.60	2.92
98	000793	华闻传媒	300,731.00	2.91
99	600522	中天科技	297,832.00	2.89
100	600893	航发动力	286,624.00	2.78
101	601788	光大证券	283,947.00	2.75
102	600031	三一重工	283,872.00	2.75
103	000069	华侨城A	283,728.00	2.75
104	000783	长江证券	282,464.00	2.74
105	601607	上海医药	282,099.20	2.73
106	603993	洛阳钼业	280,975.00	2.72
107	000503	海虹控股	280,673.00	2.72
108	000661	长春高新	280,314.83	2.72
109	000895	双汇发展	276,107.59	2.68
110	600516	方大炭素	275,565.00	2.67
111	300124	汇川技术	273,281.00	2.65
112	000625	长安汽车	271,116.00	2.63
113	002475	立讯精密	270,536.84	2.62
114	601099	太平洋	268,081.00	2.60
115	000963	华东医药	267,938.44	2.60
116	002074	国轩高科	267,621.00	2.59

117	601618	中国中冶	266,921.00	2.59
118	600383	金地集团	265,689.00	2.58
119	000768	中航飞机	265,338.00	2.57
120	600867	通化东宝	264,792.88	2.57
121	000839	中信国安	262,552.00	2.54
122	600705	中航资本	259,129.00	2.51
123	600352	浙江龙盛	258,987.00	2.51
124	600606	绿地控股	257,991.00	2.50
125	000100	TCL 集团	256,858.00	2.49
126	600201	生物股份	253,015.59	2.45
127	601919	中远海控	251,790.00	2.44
128	600068	葛洲坝	251,581.77	2.44
129	601555	东吴证券	250,869.00	2.43
130	600271	航天信息	248,213.00	2.41
131	600535	天士力	245,628.00	2.38
132	600637	东方明珠	245,044.00	2.37
133	600406	国电南瑞	244,497.00	2.37
134	002673	西部证券	244,055.00	2.37
135	000728	国元证券	243,551.00	2.36
136	300296	利亚德	242,868.00	2.35
137	603799	华友钴业	242,485.00	2.35
138	600816	安信信托	240,489.00	2.33
139	002044	美年健康	237,942.00	2.31
140	002508	老板电器	237,602.00	2.30
141	002085	万丰奥威	231,685.80	2.25
142	600176	中国巨石	231,635.00	2.24
143	600919	江苏银行	231,454.00	2.24
144	300024	机器人	229,774.00	2.23
145	600018	上港集团	229,216.00	2.22
146	601111	中国国航	228,231.61	2.21
147	002405	四维图新	225,170.00	2.18

148	600547	山东黄金	224,322.00	2.17
149	600208	新湖中宝	223,864.00	2.17
150	300699	光威复材	223,333.20	2.16
151	601727	上海电气	223,324.00	2.16
152	601155	新城控股	223,104.85	2.16
153	601018	宁波港	222,590.00	2.16
154	002252	上海莱士	220,841.00	2.14
155	600023	浙能电力	220,550.00	2.14
156	002081	金螳螂	219,682.00	2.13
157	600739	辽宁成大	219,162.50	2.12
158	600109	国金证券	218,931.00	2.12
159	600674	川投能源	218,877.00	2.12
160	002271	东方雨虹	217,869.00	2.11
161	002572	索菲亚	217,373.00	2.11
162	600570	恒生电子	216,028.00	2.09
163	600525	长园集团	215,669.34	2.09
164	601800	中国交建	215,664.88	2.09
165	000623	吉林敖东	213,532.22	2.07
166	002714	牧原股份	212,498.68	2.06
167	002422	科伦药业	208,672.00	2.02
168	600436	片仔癀	208,241.00	2.02
169	600584	长电科技	207,850.00	2.01
170	600153	建发股份	207,797.00	2.01
171	600221	海航控股	207,471.00	2.01

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

买入股票成本（成交）总额	275,520,733.94
卖出股票收入（成交）总额	173,531,872.46

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前十名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 本报告期投资基金情况**

本基金本报告期末未持有基金

**8.13 投资组合报告附注**

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

**8.13.2** 基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

**8.13.3 期末其他各项资产构成**

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	34,594.80
2	应收证券清算款	84,410.74

3	应收股利	—
4	应收利息	6,540.50
5	应收申购款	554,838.75
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	680,384.79

#### 8.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 8.13.5 期末股票中存在流通受限情况的说明

##### 8.13.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

##### 8.13.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的 公允价值	占基金资产 净值比例 (%)	流通受限情况 说明
1	300156	神雾环保	198,112.00	0.14	重大资产重组
2	600150	中国船舶	187,566.01	0.13	重大资产重组
3	600666	奥瑞德	184,800.00	0.13	重大事项
4	300104	乐视网	99,321.82	0.07	重大资产重组

#### 8.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## § 9 基金份额持有人信息

### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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

级别	(户)	基金份额	机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
天弘中证800A	1,369	104,348.23	139,305,369.90	97.52%	3,547,358.41	2.48%
天弘中证800C	714	13,978.51	5,000,000.00	50.10%	4,980,658.12	49.90%
合计	2,083	73,371.76	144,305,369.90	94.42%	8,528,016.53	5.58%

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

### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	天弘中证800A	2,496.84	0.00%
	天弘中证800C	—	—
	合计	2,496.84	0.00%

### 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	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和 研究部门负责人持有本开放式基金	天弘中证800A	0
	天弘中证800C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	天弘中证800A	0
	天弘中证800C	0
	合计	0

#### 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	6.54%	10,000,000.00	6.54%	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	6.54%	10,000,000.00	6.54%	

#### § 10 开放式基金份额变动

单位：份

	天弘中证800A	天弘中证800C
基金合同生效日(2015年07月16日)基金份额总额	5,000,000.00	5,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	7,120,937.77	5,874,861.68
本报告期基金总申购份额	284,481,860.70	48,467,018.03
减：本报告期基金总赎回份额	148,750,070.16	44,361,221.59
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	142,852,728.31	9,980,658.12

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决议。

##### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，经天弘基金管理有限公司第五届董事会2017年第1次会议通过以下事项：任命熊军先生为本公司副总经理，以上事宜已经依照相关规定履行备案程序。本报告期内，本基金的基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略没有改变。

### 11.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本报告期内本基金未持有基金。

### 11.6 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内应向普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）支付服务费3万元整。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)已为天弘中证800指数型发起式证券投资基金提供审计服务2年6个月。

### 11.7 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人、托管人及其高级管理人员没有发生受稽查或处罚的情况。

### 11.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.8.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占股票成交总额比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
广发证券	2	445,747,804.09	100.00%	103,108.02	100.00%	

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、本期新租用交易单元：无；

4、本基金报告期内停止租用交易单元：无。

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

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	2017/1/1-2017/4/13	10,000,000.00	—	—	10,000,000.00	6.54%
机构	2	2017/4/14-2017/12/19、2017/12/22-2017/12/31	—	146,219,974.13	71,800,000.00	74,419,974.13	48.69%
机构	3	2017/4/14-2017/12/07、2017/12/20-2017/12/31	—	47,908,731.58	11,977,182.89	35,931,548.69	23.51%
机构	4	2017/12/20-2017/12/21	—	23,953,766.92	—	23,953,766.92	15.67%

产品特有风险

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：

- （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；
- （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。

## 12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

天弘基金管理有限公司  
二〇一八年三月二十九日