

天弘中证800指数型发起式证券投资基金2018年半年度报告

2018年06月30日

基金管理人：天弘基金管理有限公司

基金托管人：广发证券股份有限公司

送出日期：2018年08月27日

§ 1 重要提示及目录

1.1 重要提示

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

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

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

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

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2018年1月1日起至2018年6月30日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标和基金净值表现	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	7
§4 管理人报告	9
4.1 基金管理人及基金经理情况	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	13
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	13
§5 托管人报告	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）	14
6.1 资产负债表	14
6.2 利润表	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表	17
6.4 报表附注	19
§7 投资组合报告	43
7.1 期末基金资产组合情况	43
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	43
7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细	45
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	72
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	74
7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细	74
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	74
7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	74
7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细	75
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	75
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	75
7.12 本报告期投资基金情况	75
7.13 投资组合报告附注	75
§8 基金份额持有人信息	76
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	76
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况	77
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	77
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	77
§9 开放式基金份额变动	78

§10 重大事件揭示.....	78
10.1 基金份额持有人大会决议.....	78
10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动.....	78
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	78
10.4 基金投资策略的改变.....	78
10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件.....	78
10.6 基金改聘会计师事务所情况.....	79
10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况.....	79
10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	79
10.9 其他重大事件.....	79
§11 影响投资者决策的其他重要信息.....	82
11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%的情况.....	82
11.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	82
§12 备查文件目录.....	83
12.1 备查文件目录.....	83
12.2 存放地点.....	83
12.3 查阅方式.....	83

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	天弘中证800指数型发起式证券投资基金	
基金简称	天弘中证800	
基金主代码	001588	
基金运作方式	契约型开放式、发起式	
基金合同生效日	2015年07月16日	
基金管理人	天弘基金管理有限公司	
基金托管人	广发证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	154,132,928.64份	
基金合同存续期	不定期	
下属两级基金的基金简称	天弘中证800A	天弘中证800C
下属两级基金的交易代码	001588	001589
报告期末下属两级基金的份 额总额	143,490,500.14份	10,642,428.50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
注册地址		天津自贸区(中心商务区)响螺湾旷世国际大厦A座1704-241号	广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街2号618室
办公地址		天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层	广州市天河区天河北路183-187号大都会广场43楼
邮政编码		300203	510620
法定代表人		井贤栋	孙树明

2.4 信息披露方式

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	天弘基金管理有限公司	天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2018年01月01日-2018年06月30日）	
	天弘中证800A	天弘中证800C
本期已实现收益	1,218,350.10	106,754.88
本期利润	-15,570,259.02	-1,079,217.19
加权平均基金份额本期利润	-0.1087	-0.1030
本期基金加权平均净值利润率	-11.89%	-11.37%
本期基金份额净值增长率	-11.59%	-11.71%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年06月30日)	
期末可供分配利润	-24,713,944.73	-1,898,203.63
期末可供分配基金份额利润	-0.1722	-0.1784
期末基金资产净值	118,776,555.41	8,744,224.87
期末基金份额净值	0.8278	0.8216
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2018年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	-17.22%	-17.84%

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

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

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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
过去一个月	-6.65%	1.31%	-7.69%	1.32%	1.04%	-0.01%
过去三个月	-8.92%	1.09%	-10.64%	1.10%	1.72%	-0.01%
过去六个月	-11.59%	1.12%	-13.16%	1.11%	1.57%	0.01%
过去一年	-3.08%	0.91%	-6.81%	0.91%	3.73%	0.00%

自基金合同生效日起至今	-17.22%	1.38%	-15.78%	1.39%	-1.44%	-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标准差④	①-③	②-④
过去一个月	-6.68%	1.31%	-7.69%	1.32%	1.01%	-0.01%
过去三个月	-8.98%	1.09%	-10.64%	1.10%	1.66%	-0.01%
过去六个月	-11.71%	1.12%	-13.16%	1.11%	1.45%	0.01%
过去一年	-3.32%	0.91%	-6.81%	0.91%	3.49%	0.00%
自基金合同生效日起至今	-17.84%	1.38%	-15.78%	1.39%	-2.06%	-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《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。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

天弘基金管理有限公司（以下简称“公司”或“本基金管理人”）经中国证监会证监基金字[2004]164号文批准，于2004年11月8日正式成立。注册资本金为5.143亿元人民币，总部设在天津，在北京、上海、广州、天津、深圳、四川设有分公司。公司股权结构为：

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

截至2018年6月30日，本基金管理人共管理54只基金：天弘精选混合型证券投资

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

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张子法	本基金基金经理。	2017年04月	—	16年	男，软件工程硕士。历任华夏基金管理有限公司金融工程师量化研究员。

					2014年3月加盟本公司，历任股票研究员、基金经理助理。
陈瑶	本基金基金经理。	2018年02月	—	7年	女，金融学硕士。2011年7月加盟本公司，历任交易员、交易主管，从事交易管理，程序化交易策略、基差交易策略、融资融券交易策略等研究工作。

注：1、上述任职日期为本基金管理人对外披露的任职日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

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

本报告期内，本基金运作合法合规，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

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

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

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

报告期内本基金跟踪误差的来源主要是申购赎回与成分股停牌因素。本基金秉承合规第一、风控第一的原则，在运作过程中严格遵守基金合同，坚持既定的指数化投资策略，对指数基金采取被动复制与组合优化相结合的方式跟踪指数。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2018年6月30日，天弘中证800A基金份额净值为0.8278元，天弘中证800C基金份额净值为0.8216元。报告期内份额净值增长率天弘中证800A为-11.59%，天弘中证800C为-11.71%，同期业绩比较基准增长率均为-13.16%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2018年上半年，在去杠杆的背景下，信用环境收缩，基建和房地产投资下滑，但消费对经济的带动作用提升。目前我国投资、消费结构在持续优化，经济增长的动力结构在变化，预计下半年整体消费也将保持稳健走势。尽管下半年仍然存在贸易摩擦、信用风险、经济回落的压力，但我们也看到了地产销售筑底、货币环比改善和结构性投资数据的修复等正面因素，并且6月份信贷增加、财政支出加快都意味着政策已经做出微调，后续仍有政策调整的空间。2018年上半年GDP同比增长6.8%，其中2季度增长6.7%，略低于1季度的6.8%，今年政府工作报告明确的GDP预期增长目标是6.5%，全年完成

预期增长目标将是大概率事件。受国内外多重因素影响，今年上半年，股票市场回落，食品饮料和医药等消费板块受避险情绪影响相对抗跌，目前A股整体估值处于历史底部区域，破净及股票回购家数增加，显示股票市场的安全边际及配置价值逐步显现，当前A股往后看1-2年的中期价值底部已经出现，策略角度建议在当前位置上应当积极应对：大板块之间首选地产、金融，配合电子、计算机板块；消费板块有调整后再选择布局，周期全年仍然是预期对实际情况定价偏离后的等待型布局机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

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

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

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

报告期内，本基金管理人未与任何第三方签定与估值相关的定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内本基金管理人无应说明预警信息。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

本报告期内，天弘中证800指数型发起式证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对天弘基金管理有限公司编制和披露的天弘中证800指数型发起式证券投资基金2018年半年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：天弘中证800指数型发起式证券投资基金

报告截止日：2018年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018年06月30日	上年度末 2017年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	8,735,772.49	9,385,826.33
结算备付金		72,217.10	39,739.99
存出保证金		143,390.74	34,594.80
交易性金融资产	6.4.7.2	118,925,820.31	133,771,581.45
其中：股票投资		118,925,820.31	133,771,581.45
基金投资		—	—

债券投资		—	—
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
衍生金融资产	6.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	—	—
应收证券清算款		—	84,410.74
应收利息	6.4.7.5	1,832.33	6,540.50
应收股利		—	—
应收申购款		74,558.92	554,838.75
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.6	—	—
资产总计		127,953,591.89	143,877,532.56
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年06月30日	上年度末 2017年12月31日
负 债：			
短期借款		—	—
交易性金融负债		—	—
衍生金融负债		—	—
卖出回购金融资产款		—	—
应付证券清算款		—	—
应付赎回款		269,370.14	565,629.40
应付管理人报酬		54,472.68	68,825.37
应付托管费		10,894.52	13,765.10
应付销售服务费		1,752.96	1,955.27
应付交易费用	6.4.7.7	8,922.38	45,541.91
应交税费		—	—
应付利息		—	—
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	6.4.7.8	87,398.93	139,088.90
负债合计		432,811.61	834,805.95

所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	154,132,928.64	152,833,386.43
未分配利润	6.4.7.10	-26,612,148.36	-9,790,659.82
所有者权益合计		127,520,780.28	143,042,726.61
负债和所有者权益总计		127,953,591.89	143,877,532.56

注：报告截止日2018年6月30日，天弘中证800指数型发起式证券投资基金A类基金份额净值0.8278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0.8216元；基金份额总额154,132,928.64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143,490,500.14份，天弘中证800指数型发起式证券投资基金C类基金份额10,642,428.50份。

6.2 利润表

会计主体：天弘中证800指数型发起式证券投资基金

本报告期：2018年01月01日-2018年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2018年01月01日-2018 年06月30日	上年度可比期间2017 年01月01日-2017年06 月30日
一、收入		-15,899,140.72	6,062,592.02
1.利息收入		36,006.32	34,152.03
其中：存款利息收入	6.4.7 .11	36,006.32	34,152.03
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		2,032,424.99	890,733.29
其中：股票投资收益	6.4.7 .12	939,942.21	-432,442.86
基金投资收益		—	—
债券投资收益	6.4.7 .13	—	—

资产支持证券投资收益		—	—
贵金属投资收益	6.4.7 .14	—	—
衍生工具收益	6.4.7 .15	—	—
股利收益	6.4.7 .16	1,092,482.78	1,323,176.15
3.公允价值变动收益	6.4.7 .17	-17,974,581.19	5,136,027.37
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		—	—
5.其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7 .18	7,009.16	1,679.33
减：二、费用		750,335.49	427,808.19
1. 管理人报酬		347,777.12	209,631.04
2. 托管费		69,555.42	41,926.12
3. 销售服务费		11,734.99	10,972.15
4. 交易费用	6.4.7 .19	225,926.61	84,813.92
5. 利息支出		—	—
其中：卖出回购金融资产支出		—	—
6. 税金及附加		—	—
7. 其他费用	6.4.7 .20	95,341.35	80,464.96
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-16,649,476.21	5,634,783.83
减：所得税费用		—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-16,649,476.21	5,634,783.83

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：天弘中证800指数型发起式证券投资基金

本报告期：2018年01月01日-2018年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日-2018年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	152,833,386.43	-9,790,659.82	143,042,726.61
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	-16,649,476.21	-16,649,476.21
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)	1,299,542.21	-172,012.33	1,127,529.88
其中：1.基金申购款	28,816,008.27	-2,362,157.93	26,453,850.34
2.基金赎回款	-27,516,466.06	2,190,145.60	-25,326,320.46
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列)	—	—	—
五、期末所有者权益(基金净值)	154,132,928.64	-26,612,148.36	127,520,780.28
项目	上年度可比期间 2017年01月01日-2017年06月30日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	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)	—	5,634,783.83	5,634,783.83
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)	217,222,616.63	-36,626,264.30	180,596,352.33
其中：1.基金申购款	226,101,513.00	-38,251,329.14	187,850,183.86
2.基金赎回款	-8,878,896.37	1,625,064.84	-7,253,831.53
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)	230,218,416.08	-33,669,387.05	196,549,029.03

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

郭树强

韩海潮

薄贺龙

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

天弘中证800指数型发起式证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2015]1339号《关于准予天弘中证800指数型发起式证券投资基金注册的批复》注册,由天弘基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘中证800指数型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,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。收取申购费用的,而不是从本类别基金资产中计提销售服务费的,称为天弘中证800指数型发起式证券投资基金A类(以下简称"A类基金");不收取申购费用的,而是在本类别基金资产中计提销售服务费的,称为天弘中证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、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、银行存款、债券、债券回购、权证、股指期货、资产支持证券、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金投资于股票的资产比例不低于基金资产的90%，投资于中证800指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的80%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金和应收申购款等。本基金的业绩比较基准：中证800指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。

6.4.2 会计报表的编制基础

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

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2018年6月30日，本基金的基金资产净值为人民币127,520,780.28元，且本基金的基金合同将于未来1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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2018年度上半年财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2018年6月30日的财务状况以及2018年上半年的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

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

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

6.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

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

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

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

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

(c) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得，持股期限在1个月以内(含1个月)的，其股息红利所得全额计入应纳税所得额；持股期限在1个月以上至1年(含1年)的，暂减按50%计入应纳税所得额；持股期限超过1年的，暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股，解禁后取得的股息、红利收入，按照上述规定计算纳税，持股时间自解禁日起计算；解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

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

花税。

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

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018年06月30日
活期存款	8,735,772.49
定期存款	—
其中：存款期限1个月以内	—
存款期限1-3个月	—
存款期限3个月以上	—
其他存款	—
合计	8,735,772.49

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末2018年06月30日		
	成本	公允价值	估值增值
股票	132,244,930.06	118,925,820.31	-13,319,109.75
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	132,244,930.06	118,925,820.31	-13,319,109.75

注：截至2018年6月30日,股票投资余额中包含按照指数收益法估值的特殊事项停牌相关股票。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末:2018年06月30日
应收活期存款利息	1,735.33
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	32.50
应收债券利息	—
应收资产支持证券利息	—
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	—
应收黄金合约拆借孳息	—
其他	64.50
合计	1,832.33

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018年06月30日
交易所市场应付交易费用	8,922.38

银行间市场应付交易费用	—
合计	8,922.38

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年06月30日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	57.58
预提费用	79,341.35
指数使用费	8,000.00
合计	87,398.93

6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目 (天弘中证800A)	本期 2018年01月01日-2018年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	142,852,728.31	142,852,728.31
本期申购	4,096,646.73	4,096,646.73
本期赎回	-3,458,874.90	-3,458,874.90
期末数	143,490,500.14	143,490,500.14
项目 (天弘中证800C)	基金份额(份)	账面金额
上年度末	9,980,658.12	9,980,658.12
本期申购	24,719,361.54	24,719,361.54
本期赎回	-24,057,591.16	-24,057,591.16
期末数	10,642,428.50	10,642,428.50

注：申购含转换入份额；赎回含转换出份额。

6.4.7.10 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

(天弘中证800A)			
上年度末	9,173,576.93	-18,271,187.24	-9,097,610.31
本期利润	1,218,350.10	-16,788,609.12	-15,570,259.02
本期基金份额交易产生的变动数	29,223.62	-75,299.02	-46,075.40
其中：基金申购款	246,055.30	-582,057.25	-336,001.95
基金赎回款	-216,831.68	506,758.23	289,926.55
本期已分配利润	—	—	—
本期末	10,421,150.65	-35,135,095.38	-24,713,944.73

单位：人民币元

项目 (天弘中证800C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	583,000.23	-1,276,049.74	-693,049.51
本期利润	106,754.88	-1,185,972.07	-1,079,217.19
本期基金份额交易产生的变动数	8,449.14	-134,386.07	-125,936.93
其中：基金申购款	1,331,905.52	-3,358,061.50	-2,026,155.98
基金赎回款	-1,323,456.38	3,223,675.43	1,900,219.05
本期已分配利润	—	—	—
本期末	698,204.25	-2,596,407.88	-1,898,203.63

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日-2018年06月30日
活期存款利息收入	31,645.34
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	3,263.28
其他	1,097.70
合计	36,006.32

6.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日-2018年06月30日
卖出股票成交总额	137,551,177.66
减：卖出股票成本总额	136,611,235.45
买卖股票差价收入	939,942.21

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期未取得债券投资收益。

6.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

本基金本报告期未取得资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期未取得贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期未取得衍生工具投资收益。

6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日-2018年06月30日
股票投资产生的股利收益	1,092,482.78
基金投资产生的股利收益	—
合计	1,092,482.78

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
------	----

	2018年01月01日-2018年06月30日
1.交易性金融资产	-17,974,581.19
——股票投资	-17,974,581.19
——债券投资	—
——资产支持证券投资	—
——基金投资	—
——贵金属投资	—
——其他	—
2.衍生工具	—
——权证投资	—
3.其他	—
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	—
合计	-17,974,581.19

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2018年01月01日-2018年06月30日
基金赎回费收入	6,875.60
基金转换费收入	133.56
合计	7,009.16

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

2.本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费对持续持有期少于7日的投资者收取不低于1.5%的赎回费并全额计入基金财产。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2018年01月01日-2018年06月30日
交易所市场交易费用	225,926.61

银行间市场交易费用	—
合计	225,926.61

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2018年01月01日-2018年06月30日
审计费用	29,752.78
信息披露费	49,588.57
指数使用费	16,000.00
合计	95,341.35

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年01月01日-2018年06月30日		上年度可比期间 2017年01月01日-2017年06月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
广发证券股份有限公司	276,135,259.42	100.00%	206,138,378.34	100.00%

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年01月01日至2018年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券股份有限公司	63,871.17	100.00%	8,922.38	100.00%
关联方名称	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年6月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券股份有限公司	47,679.76	100.00%	47,154.09	100.00%

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

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日-2018 年06月30日	上年度可比期间 2017年01月01日-2017 年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	347,777.12	209,631.04
其中：支付销售机构的客户维护费	8,079.92	1,840.06

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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日-2018 年06月30日	上年度可比期间 2017年01月01日-2017 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	69,555.42	41,926.12

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

6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的 各关联方名称	本期 2018年01月01日-2018年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	天弘中证800A	天弘中证800C	合计
天弘基金管理有限公 司	—	5,625.56	5,625.56
广发证券股份有限公 司	—	35.37	35.37
合计	—	5,660.93	5,660.93

获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间2017年01月01日-2017年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	天弘中证800A	天弘中证800C	合计
天弘基金管理有限公司		9,861.12	9,861.12
广发证券股份有限公司		20.37	20.37
合计	—	9,881.49	9,881.49

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。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期及上年度可比期间未与关联方进行过银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目	本期 2018年01月01日-2018年06月 30日		上年度可比期间 2017年01月01日-2017年06月 30日	
	天弘中证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	5,000,000.00	5,000,000.00	5,000,000.00	5,000,000.00
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	5,000,000.00	5,000,000.00	5,000,000.00	5,000,000.00
占基金总份额比例	3.24%	3.24%	2.17%	2.17%

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。

6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年01月01日-2018年06月30日		上年度可比期间 2017年01月01日-2017年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
广发证券股份有限公司	8,735,772.49	31,645.34	13,072,714.03	31,175.38

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，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券交易。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本报告期本基金跟踪指数被动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；本基金上年度可比期间积极投资部分未发生关联交易。

6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期无利润分配事项。

6.4.12 期末（2018年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票									
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量	期末成本总额	期末估值总额
603693	江苏新能	2018-06-25	2018-07-03	新股尚未上市流通	9.00	9.00	5,384	48,456.00	48,456.00
603706	东方环宇	2018-06-29	2018-07-09	新股尚未上市流通	13.09	13.09	1,765	23,103.85	23,103.85
603105	芯能科技	2018-06-29	2018-07-09	新股尚未上市流通	4.83	4.83	3,410	16,470.30	16,470.30

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量	期末成本总额	期末估值总额
601390	中国中铁	2018-05-07	重大资产重组	7.47	-	-	47,200.00	408,617.48	352,584.00
002450	康得新	2018-06-04	重大资产重组	17.08	-	-	16,999.00	356,409.75	290,342.92
000540	中天金融	2017-08-21	重大资产重组	4.87	-	-	53,250.00	248,640.99	259,327.50
600221	海航控股	2018-01-10	重大资产重组	2.61	2018-07-20	2.91	95,400.00	314,498.41	248,994.00
002739	万达电影	2017-07-04	重大资产重组	38.03	-	-	6,300.00	344,676.88	239,589.00
300072	三聚环保	2018-06-19	拟披露重大事项	23.28	2018-07-10	24.00	7,222.00	258,332.00	168,128.16
601727	上海电气	2018-06-06	拟筹划重大资产重组	5.48	2018-08-07	5.71	29,300.00	172,564.51	160,564.00
002310	东方园林	2018-05-25	重大资产重组	15.03	-	-	10,600.00	197,379.58	159,318.00
000825	太钢不锈	2018-04-16	重大资产重组	6	-	-	19,700.00	117,038.46	118,200.00
000566	海南海药	2017-11-22	重大资产重组	12.89	2018-07-09	11.60	9,100.00	122,831.46	117,299.00
600022	山东钢铁	2018-03-27	重大资产重组	2.02	2018-08-16	1.83	54,200.00	122,274.00	109,484.00
600811	东方集团	2018-05-30	重要事项未公告	4.3	-	-	24,400.00	110,993.52	104,920.00
300266	兴源环境	2018-02-05	重大资产重组	19.99	2018-07-02	17.99	5,200.00	134,826.18	103,948.00
300146	汤臣倍健	2018-01-31	重大资产重组	15.41	2018-08-01	18.70	6,100.00	79,758.48	94,001.00
000415	渤海金控	2018-01-17	重大资产重组	5.84	2018-07-17	5.26	15,300.00	103,927.82	89,352.00
000939	*ST凯迪	2017-11-16	实行退市风险警示公告	4.99	2018-07-02	4.74	17,800.00	101,545.80	88,822.00
002408	齐翔腾达	2018-06-19	重大资产重组	12.28	-	-	7,041.00	86,181.94	86,463.48
002359	北讯集团	2018-05-21	拟披露重大事项	19.58	-	-	4,200.00	93,159.62	82,236.00
002602	世纪华通	2018-06-12	重大资产重组	32.5	-	-	2,501.00	83,982.57	81,282.50
002411	必康股份	2018-06-19	拟披露重大事项	28.34	-	-	2,600.00	68,662.14	73,684.00
002051	中工国际	2018-04-09	重大资产重组	15.27	-	-	4,768.00	83,044.99	72,807.36
600751	海航科技	2018-01-12	拟筹划重大资产重组	6.49	-	-	10,600.00	74,143.05	68,794.00

			组							
300324	旋极信息	2018-05-30	重大资产重组	9.49	-	-	6,924.00	73,151.24	65,708.76	
600158	中体产业	2018-03-27	拟筹划重大资产重组	11.64	2018-07-16	11.61	5,600.00	66,642.00	65,184.00	
002573	清新环境	2018-06-19	拟披露重大事项	11.55	-	-	5,100.00	77,922.77	58,905.00	
601118	海南橡胶	2018-05-24	拟筹划重大资产重组	6.62	-	-	8,800.00	51,192.90	58,256.00	
000008	神州高铁	2018-06-06	重大事项	4.96	2018-08-07	4.46	11,700.00	90,413.27	58,032.00	
300197	铁汉生态	2018-05-28	重大资产重组	5.37	-	-	10,800.00	75,928.12	57,996.00	
002426	胜利精密	2018-06-19	拟披露重大事项	3.6	2018-07-03	3.26	16,100.00	85,024.34	57,960.00	
002665	首航节能	2018-05-29	重大资产重组	5.8	-	-	9,900.00	64,807.98	57,420.00	
000723	美锦能源	2018-03-27	重大资产重组	5.43	2018-07-31	4.89	10,200.00	63,793.00	55,386.00	
600086	东方金钰	2018-01-19	重大资产重组	10.04	-	-	5,488.00	59,678.51	55,099.52	
002431	棕榈股份	2018-05-30	重大事项	6.71	-	-	8,200.00	61,390.72	55,022.00	
600122	宏图高科	2018-06-19	拟筹划重大资产重组	7.4	-	-	7,300.00	80,507.58	54,020.00	
600848	上海临港	2018-06-15	拟筹划重大资产重组	21.67	-	-	2,400.00	57,274.57	52,008.00	
002512	达华智能	2018-06-19	拟披露重大事项	9.7	-	-	5,201.00	80,842.91	50,449.70	
002477	雏鹰农牧	2018-06-14	重大事项	3.31	-	-	14,900.00	57,505.51	49,319.00	
002147	新光圆成	2018-01-18	重大资产重组	10.28	-	-	4,452.00	55,683.12	45,766.56	
002437	誉衡药业	2018-06-11	重大资产重组	6.2	2018-08-13	5.57	6,900.00	42,717.00	42,780.00	
000426	兴业矿业	2018-06-19	重大事项	7.21	-	-	5,800.00	60,264.75	41,818.00	
002699	美盛文化	2018-02-05	重大资产重组	18.76	2018-07-02	16.88	2,200.00	37,654.87	41,272.00	
600750	江中药业	2018-05-02	重大资产重组	17.75	2018-08-01	16.12	2,240.00	38,598.00	39,760.00	
002005	德豪润达	2018-01-02	重大资产重组	4.36	2018-07-02	3.92	8,800.00	45,015.76	38,368.00	
600759	洲际油气	2018-03-27	重大资产重组	3.94	-	-	9,700.00	34,397.00	38,218.00	
600335	国机汽车	2018-04-03	重大资产重组	10.43	-	-	3,500.00	33,119.00	36,505.00	
000587	金洲慈航	2018-06-15	重大事项	4.96	2018-07-02	4.46	6,700.00	47,056.94	33,232.00	

600687	刚泰控股	2018-06-11	重要事项未公告	9.09	-	-	3,600.00	39,960.52	32,724.00
002011	盾安环境	2018-05-02	重大资产重组	6.4	-	-	4,600.00	30,372.00	29,440.00
000669	金鸿控股	2018-05-18	重大资产重组	7.25	2018-08-06	6.53	3,640.00	30,991.10	26,390.00
600485	信威集团	2016-12-26	重大资产重组	10.64	-	-	900.00	22,317.22	9,576.00
000693	*ST华泽	2018-05-02	未及时披露定期报告	1.36	-	-	200.00	3,902.00	272.00

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

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

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

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

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

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为指数型基金，采用指数复制投资策略，标的指数为中证800指数，按照个股在标的指数中的基准权重构建股票组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应地调整，以复制和跟踪标的指数。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现与跟踪指数相同的风险收益目标。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以审计与风险控制委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、内控合规部、风险管理部、审计部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，董事会负责监督检查公司的合法合规运营、内部控制、风险管理，从而控制公司的整体运营风险。在董事会下设立审计与风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理委员会，主要负责根据公司总体风险控制目标，将交易、运营风险控制目标和要求分配到各部门；讨论、协调各部门之间的风险管理过程；听取各部门风险管理工作方面的汇报，确定未来一段时间各部门应重点关注的风险点，并调整

与改进相关的风险处理和控制策略；讨论向公司高级管理层提交的基金运作风险报告。在业务操作层面风险管理职责主要由内控合规部负责，对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理提供合规控制标准，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标；内控合规部对公司总经理负责，并由督察长分管。风险管理部通过投资交易系统的风控参数设置，保证各投资组合的投资比例合规；参与各投资组合新股申购、一级债申购、银行间交易等场外交易的风险识别与评估，保证各投资组合场外交易的事中合规控制；负责各投资组合投资绩效、风险的计量和控制。本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

6.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在具有基金托管资格的中国建设银行股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于2018年6月30日，本基金未持有债券（2017年12月31日：同）。

6.4.13.3 流动性风险

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

为防范无法支付赎回款而产生的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。此外，基金管理人经与基金托管人协商，在确保投资者得到公平对待的前提下，

可依照法律法规及基金合同的约定，综合运用各类流动性风险管理工具，对赎回申请等进行适度调整，作为特定情形下基金管理人流动性风险管理的辅助措施。

于2018年6月30日，本基金所承担的全部金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

本基金的基金管理人在基金运作过程中严格按照《公开募集证券投资基金运作管理办法》及《公开募集开放式证券投资基金流动性风险管理规定》(自2017年10月1日起施行)等法规的要求对本基金组合资产的流动性风险进行管理，通过独立的风险管理部门对本基金的组合持仓集中度指标、流通受限制的投资品种比例以及组合在短期内变现能力的综合指标等流动性指标进行持续的监测和分析。

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流通股票的30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受该比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注6.4.12。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算，确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。

同时，本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度；按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理，以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外，本基金的基金管理人建立了交易对手管理制度，要求根据质押品的资质确定质押率水平；持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额；并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时，可接受质押品的资质要求

与基金合同约定的投资范围保持一致。

综合上述各项流动性指标的监测结果及流动性风险管理措施的实施，本基金在本报告期内流动性情况良好。

6.4.13.4 市场风险

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

6.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2018年06月30 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	8,735,772.49	—	—	—	8,735,772.49
结算备付金	72,217.10	—	—	—	72,217.10
存出保证金	143,390.74	—	—	—	143,390.74
交易性金融资产	—	—	—	118,925,820.31	118,925,820.31
应收利息	—	—	—	1,832.33	1,832.33
应收申购款	—	—	—	74,558.92	74,558.92
资产总计	8,951,380.3	—	—	119,002,211	127,953,591

	3			.56	.89
负债					
应付赎回款	—	—	—	269,370.14	269,370.14
应付管理人报酬	—	—	—	54,472.68	54,472.68
应付托管费	—	—	—	10,894.52	10,894.52
应付销售服务费	—	—	—	1,752.96	1,752.96
应付交易费用	—	—	—	8,922.38	8,922.38
其他负债	—	—	—	87,398.93	87,398.93
负债总计	—	—	—	432,811.61	432,811.61
利率敏感度缺口	8,951,380.33	—	—	118,569,399.95	127,520,780.28
上年度末 2017年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	9,385,826.33	—	—	—	9,385,826.33
结算备付金	39,739.99	—	—	—	39,739.99
存出保证金	34,594.80	—	—	—	34,594.80
交易性金融资产	—	—	—	133,771,581.45	133,771,581.45
应收证券清算款	—	—	—	84,410.74	84,410.74
应收利息	—	—	—	6,540.50	6,540.50
应收申购款	—	—	—	554,838.75	554,838.75
资产总计	9,460,161.12	—	—	134,417,371.44	143,877,532.56
负债					
应付赎回款	—	—	—	565,629.40	565,629.40
应付管理人报	—	—	—	68,825.37	68,825.37

酬					
应付托管费	—	—	—	13,765.10	13,765.10
应付销售服务费	—	—	—	1,955.27	1,955.27
应付交易费用	—	—	—	45,541.91	45,541.91
其他负债	—	—	—	139,088.90	139,088.90
负债总计	—	—	—	834,805.95	834,805.95
利率敏感度缺口	9,460,161.12	—	—	133,582,565.49	143,042,726.61

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

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2018年6月30日，本基金未持有交易性债券投资(2017年12月31日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2017年12月31日：同)。

6.4.13.4.2 外汇风险

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

6.4.13.4.3 其他价格风险

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

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2018年06月30日		上年度末 2017年12月31日	
	公允价值	占基金资产净	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	118,925,820.31	93.26	133,771,581.45	93.52
交易性金融资产-债券投资	—	—	—	—
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	118,925,820.31	93.26	133,771,581.45	93.52

6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注6.4.1)以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币元)	
		本期末 2018年06月30日	上年度末 2017年12月31日
	业绩比较基准(附注6.4.1) 上升5%	6,877,681.63	7,844,221.61
	业绩比较基准(附注6.4.1) 下降5%	-6,877,681.63	-7,844,221.61

6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次: 相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次: 除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于2018年6月30日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为114,360,761.70元，属于第二层次的余额为4,555,210.61元，属于第三层次的余额为9,848.00元(2017年12月31日：第一层次的余额为127,707,854.09元，第二层次5,964,405.54元，第三层次99,321.82元)。

(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

于2018年6月30日，本基金持有公允价值归属于第三层次的金融工具余额为9,848.00元(2017年12月31日：第三层次99,321.82元)。

上述第三层次资产变动如下：

	交易性金融资产 权益工具投资	合计
2018年1月1日	99,321.82	99,321.82
购买	-	-
出售	110,244.68	110,244.68
转入第三层级	15,631.00	15,631.00
转出第三层级	-	-
当期利得或损失总额	5,139.86	5,139.86
计入损益的利得或损失	5,139.86	5,139.86
2018年06月30日	<u>9,848.00</u>	<u>9,848.00</u>
2018年6月30日仍持有的资产计入2018年度损益的未实现利得或损失的变动——公允价值变动损益	<u>-5,783.00</u>	<u>-5,783.00</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。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

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

(d)不以公允价值计量的金融工具

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

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 7 投资组合报告

7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	118,925,820.31	92.94
	其中：股票	118,925,820.31	92.94
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	8,807,989.59	6.88
8	其他资产	219,781.99	0.17
9	合计	127,953,591.89	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 报告期末（指数投资）按行业分类的股票投资组合

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	437,625.46	0.34
B	采矿业	3,806,694.72	2.99
C	制造业	54,938,878.00	43.08

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	3,206,823.04	2.51
E	建筑业	3,545,114.56	2.78
F	批发和零售业	3,347,338.10	2.62
G	交通运输、仓储和邮政业	3,812,337.69	2.99
H	住宿和餐饮业	163,141.00	0.13
I	信息传输、软件和信息技术服务业	5,900,851.56	4.63
J	金融业	28,944,599.10	22.70
K	房地产业	5,752,382.57	4.51
L	租赁和商务服务业	1,872,814.20	1.47
M	科学研究和技术服务业	50,076.00	0.04
N	水利、环境和公共设施管理业	577,983.76	0.45
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	20,221.00	0.02
Q	卫生和社会工作	540,060.30	0.42
R	文化、体育和娱乐业	1,304,126.00	1.02
S	综合	236,838.00	0.19
	合计	118,457,905.06	92.89

7.2.2 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	58,256.00	0.05
B	采矿业	272.00	—
C	制造业	115,403.26	0.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	186,771.85	0.15
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	—	—
J	金融业	—	—

K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	—	—
N	水利、环境和公共设施管理业	81,226.14	0.06
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	25,986.00	0.02
S	综合	—	—
	合计	467,915.25	0.37

注：由于指数成份股调整，上表所列示股票中，信威集团（证券代码：600485）、海南橡胶（证券代码：601118）、金鸿控股（证券代码：000669）、*ST凯迪（证券代码：000939）、德豪润达（证券代码：002005）被调出成份股后停牌，故以积极投资股票列示（下同）。

7.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	91,645	5,368,564.10	4.21
2	600519	贵州茅台	4,100	2,998,986.00	2.35
3	600036	招商银行	90,900	2,403,396.00	1.88
4	000333	美的集团	38,050	1,986,971.00	1.56
5	000651	格力电器	39,600	1,867,140.00	1.46
6	601166	兴业银行	104,100	1,499,040.00	1.18
7	600887	伊利股份	50,800	1,417,320.00	1.11
8	600276	恒瑞医药	18,706	1,417,166.56	1.11
9	600016	民生银行	197,300	1,381,100.00	1.08
10	601328	交通银行	229,500	1,317,330.00	1.03
11	000858	五粮液	15,997	1,215,772.00	0.95
12	002415	海康威视	31,175	1,157,527.75	0.91
13	601288	农业银行	319,100	1,097,704.00	0.86

14	600030	中信证券	65,700	1,088,649.00	0.85
15	600104	上汽集团	28,902	1,011,280.98	0.79
16	000002	万科A	40,101	986,484.60	0.77
17	601398	工商银行	180,300	959,196.00	0.75
18	601668	中国建筑	175,280	957,028.80	0.75
19	600000	浦发银行	98,100	937,836.00	0.74
20	600900	长江电力	54,400	878,016.00	0.69
21	601601	中国太保	25,900	824,915.00	0.65
22	601169	北京银行	123,500	744,705.00	0.58
23	600048	保利地产	58,600	714,920.00	0.56
24	000725	京东方A	198,000	700,920.00	0.55
25	002304	洋河股份	5,000	658,000.00	0.52
26	600309	万华化学	14,480	657,681.60	0.52
27	000001	平安银行	71,800	652,662.00	0.51
28	601988	中国银行	175,800	634,638.00	0.50
29	600837	海通证券	66,500	629,755.00	0.49
30	600690	青岛海尔	32,300	622,098.00	0.49
31	002027	分众传媒	60,360	577,645.20	0.45
32	600518	康美药业	25,200	576,576.00	0.45
33	600019	宝钢股份	73,292	570,944.68	0.45
34	600028	中国石化	87,600	568,524.00	0.45
35	600585	海螺水泥	16,901	565,845.48	0.44
36	601888	中国国旅	8,100	521,721.00	0.41
37	601229	上海银行	32,000	504,320.00	0.40
38	603288	海天味业	6,700	493,388.00	0.39
39	601818	光大银行	133,000	486,780.00	0.38
40	000538	云南白药	4,401	470,730.96	0.37
41	601766	中国中车	60,100	462,770.00	0.36
42	601211	国泰君安	31,000	456,940.00	0.36
43	600009	上海机场	8,001	443,895.48	0.35

44	002024	苏宁易购	30,800	433,664.00	0.34
45	300059	东方财富	31,900	420,442.00	0.33
46	601939	建设银行	63,200	413,960.00	0.32
47	601857	中国石油	53,300	410,943.00	0.32
48	601688	华泰证券	27,101	405,701.97	0.32
49	601006	大秦铁路	49,000	402,290.00	0.32
50	002008	大族激光	7,500	398,925.00	0.31
51	600015	华夏银行	53,500	398,575.00	0.31
52	001979	招商蛇口	20,900	398,145.00	0.31
53	600703	三安光电	20,700	397,854.00	0.31
54	000568	泸州老窖	6,400	389,504.00	0.31
55	002230	科大讯飞	12,000	384,840.00	0.30
56	601009	南京银行	48,900	377,997.00	0.30
57	600050	中国联通	76,600	376,872.00	0.30
58	600919	江苏银行	56,900	364,729.00	0.29
59	002594	比亚迪	7,500	357,600.00	0.28
60	600196	复星医药	8,600	355,954.00	0.28
61	002475	立讯精密	15,701	353,900.54	0.28
62	601390	中国中铁	47,200	352,584.00	0.28
63	000338	潍柴动力	39,900	349,125.00	0.27
64	002142	宁波银行	21,250	346,162.50	0.27
65	600031	三一重工	38,100	341,757.00	0.27
66	300003	乐普医疗	9,000	330,120.00	0.26
67	601186	中国铁建	37,900	326,698.00	0.26
68	000776	广发证券	24,500	325,115.00	0.25
69	601088	中国神华	16,300	325,022.00	0.25
70	002236	大华股份	14,350	323,592.50	0.25
71	601336	新华保险	7,301	313,066.88	0.25
72	601899	紫金矿业	86,500	312,265.00	0.24
73	601628	中国人寿	13,700	308,524.00	0.24

74	600741	华域汽车	13,000	308,360.00	0.24
75	601989	中国重工	75,300	304,212.00	0.24
76	000963	华东医药	6,206	299,439.50	0.23
77	600660	福耀玻璃	11,600	298,236.00	0.23
78	603799	华友钴业	3,000	292,410.00	0.23
79	002450	康得新	16,999	290,342.92	0.23
80	600867	通化东宝	11,900	285,243.00	0.22
81	002466	天齐锂业	5,723	283,803.57	0.22
82	000063	中兴通讯	21,700	282,751.00	0.22
83	600436	片仔癀	2,500	279,825.00	0.22
84	000661	长春高新	1,200	273,240.00	0.21
85	601225	陕西煤业	33,200	272,904.00	0.21
86	300124	汇川技术	8,300	272,406.00	0.21
87	600958	东方证券	29,500	269,335.00	0.21
88	601012	隆基股份	16,120	269,042.80	0.21
89	600999	招商证券	19,000	259,920.00	0.20
90	000540	中天金融	53,250	259,327.50	0.20
91	000100	TCL 集团	89,100	258,390.00	0.20
92	600795	国电电力	98,000	256,760.00	0.20
93	300015	爱尔眼科	7,950	256,705.50	0.20
94	002456	欧菲科技	15,850	255,660.50	0.20
95	600352	浙江龙盛	21,300	254,535.00	0.20
96	600340	华夏幸福	9,792	252,144.00	0.20
97	002460	赣锋锂业	6,501	250,808.58	0.20
98	600221	海航控股	95,400	248,994.00	0.20
99	600029	南方航空	29,300	247,585.00	0.19
100	600886	国投电力	33,600	244,272.00	0.19
101	600487	亨通光电	11,060	243,873.00	0.19
102	000166	申万宏源	55,520	242,622.40	0.19
103	601933	永辉超市	31,500	240,660.00	0.19

104	002044	美年健康	10,620	240,012.00	0.19
105	002739	万达电影	6,300	239,589.00	0.19
106	600406	国电南瑞	15,100	238,580.00	0.19
107	600271	航天信息	9,200	232,484.00	0.18
108	601155	新城控股	7,500	232,275.00	0.18
109	601607	上海医药	9,690	231,591.00	0.18
110	601901	方正证券	34,000	227,460.00	0.18
111	002202	金风科技	17,923	226,546.72	0.18
112	600011	华能国际	35,000	222,600.00	0.17
113	600516	方大炭素	9,000	219,420.00	0.17
114	601111	中国国航	24,600	218,694.00	0.17
115	600570	恒生电子	4,100	217,095.00	0.17
116	000895	双汇发展	8,200	216,562.00	0.17
117	601985	中国核电	38,300	216,395.00	0.17
118	300070	碧水源	15,532	216,360.76	0.17
119	600115	东方航空	32,500	215,150.00	0.17
120	600089	特变电工	30,662	212,487.66	0.17
121	600066	宇通客车	11,000	211,090.00	0.17
122	000423	东阿阿胶	3,900	209,859.00	0.16
123	601600	中国铝业	54,600	209,664.00	0.16
124	600111	北方稀土	17,900	203,702.00	0.16
125	601377	兴业证券	38,500	202,895.00	0.16
126	300408	三环集团	8,600	202,100.00	0.16
127	601669	中国电建	37,700	202,072.00	0.16
128	300136	信维通信	6,500	199,745.00	0.16
129	600535	天士力	7,660	197,781.20	0.16
130	600606	绿地控股	30,200	197,508.00	0.15
131	000069	华侨城A	27,000	195,210.00	0.15
132	600588	用友网络	7,890	193,383.90	0.15
133	000413	东旭光电	31,900	193,314.00	0.15

134	000503	国新健康	6,000	190,680.00	0.15
135	600383	金地集团	18,600	189,534.00	0.15
136	000768	中航飞机	12,100	189,244.00	0.15
137	600398	海澜之家	14,800	188,552.00	0.15
138	002736	国信证券	20,400	185,640.00	0.15
139	300122	智飞生物	4,000	182,960.00	0.14
140	600176	中国巨石	17,800	182,094.00	0.14
141	600332	白云山	4,700	178,835.00	0.14
142	600522	中天科技	20,100	177,081.00	0.14
143	601788	光大证券	16,100	176,778.00	0.14
144	600010	包钢股份	113,800	176,390.00	0.14
145	603019	中科曙光	3,800	174,306.00	0.14
146	600705	中航资本	37,300	174,191.00	0.14
147	002572	索菲亚	5,400	173,772.00	0.14
148	000783	长江证券	32,000	173,760.00	0.14
149	300072	三聚环保	7,222	168,128.16	0.13
150	600521	华海药业	6,280	167,613.20	0.13
151	300024	机器人	9,580	166,692.00	0.13
152	600426	华鲁恒升	9,400	165,346.00	0.13
153	600893	航发动力	7,400	165,168.00	0.13
154	002241	歌尔股份	16,202	165,098.38	0.13
155	600201	生物股份	9,647	164,867.23	0.13
156	600068	葛洲坝	22,800	164,388.00	0.13
157	600637	东方明珠	10,900	164,154.00	0.13
158	002410	广联达	5,900	163,607.00	0.13
159	600085	同仁堂	4,600	162,288.00	0.13
160	601727	上海电气	29,300	160,564.00	0.13
161	600177	雅戈尔	20,700	159,390.00	0.12
162	002310	东方园林	10,600	159,318.00	0.12
163	601877	正泰电器	7,100	158,472.00	0.12

164	600674	川投能源	18,100	157,832.00	0.12
165	600023	浙能电力	33,600	156,576.00	0.12
166	601998	中信银行	25,200	156,492.00	0.12
167	002049	紫光国微	3,500	154,420.00	0.12
168	601919	中远海控	31,300	153,996.00	0.12
169	603589	口子窖	2,500	153,625.00	0.12
170	600739	辽宁成大	10,100	153,318.00	0.12
171	000977	浪潮信息	6,400	152,640.00	0.12
172	000157	中联重科	36,800	151,248.00	0.12
173	002007	华兰生物	4,700	151,152.00	0.12
174	601198	东兴证券	11,400	148,656.00	0.12
175	600547	山东黄金	6,200	148,304.00	0.12
176	601618	中国中冶	44,500	148,185.00	0.12
177	300144	宋城演艺	6,300	148,050.00	0.12
178	600018	上港集团	24,700	147,212.00	0.12
179	002493	荣盛石化	14,200	146,544.00	0.11
180	600298	安琪酵母	4,100	146,288.00	0.11
181	000425	徐工机械	34,500	146,280.00	0.11
182	600256	广汇能源	35,530	145,317.70	0.11
183	000830	鲁西化工	8,500	145,180.00	0.11
184	000625	长安汽车	16,100	144,900.00	0.11
185	601800	中国交建	12,600	143,514.00	0.11
186	000703	恒逸石化	9,560	142,252.80	0.11
187	600804	鹏博士	11,800	141,600.00	0.11
188	000623	吉林敖东	7,843	141,017.14	0.11
189	601997	贵阳银行	11,400	140,904.00	0.11
190	603833	欧派家居	1,100	140,283.00	0.11
191	600809	山西汾酒	2,200	138,358.00	0.11
192	601233	桐昆股份	8,000	137,760.00	0.11
193	601018	宁波港	32,600	137,246.00	0.11

194	000786	北新建材	7,400	137,122.00	0.11
195	002065	东华软件	15,900	136,740.00	0.11
196	600362	江西铜业	8,600	136,310.00	0.11
197	600208	新湖中宝	35,600	135,992.00	0.11
198	601555	东吴证券	19,900	135,917.00	0.11
199	002050	三花智控	7,200	135,720.00	0.11
200	002179	中航光电	3,460	134,940.00	0.11
201	600926	杭州银行	12,100	134,189.00	0.11
202	600584	长电科技	7,900	133,826.00	0.10
203	002340	格林美	22,050	133,402.50	0.10
204	601099	太平洋	56,700	132,678.00	0.10
205	002081	金螳螂	13,100	132,310.00	0.10
206	000418	小天鹅A	1,900	131,765.00	0.10
207	600816	安信信托	18,160	131,478.40	0.10
208	000860	顺鑫农业	3,500	131,250.00	0.10
209	002294	信立泰	3,500	130,095.00	0.10
210	300017	网宿科技	12,100	129,591.00	0.10
211	002038	双鹭药业	3,400	129,166.00	0.10
212	600673	东阳光科	12,500	129,125.00	0.10
213	002714	牧原股份	2,901	128,978.46	0.10
214	600872	中炬高新	4,600	128,800.00	0.10
215	600100	同方股份	14,600	128,188.00	0.10
216	600600	青岛啤酒	2,900	127,107.00	0.10
217	600760	中航沈飞	3,500	126,140.00	0.10
218	600879	航天电子	17,900	125,837.00	0.10
219	002146	荣盛发展	14,400	125,712.00	0.10
220	600482	中国动力	7,200	125,640.00	0.10
221	000792	盐湖股份	11,500	124,430.00	0.10
222	600109	国金证券	17,500	124,425.00	0.10
223	603858	步长制药	2,900	124,091.00	0.10

224	002078	太阳纸业	12,800	124,032.00	0.10
225	600219	南山铝业	45,700	123,847.00	0.10
226	000728	国元证券	16,700	123,580.00	0.10
227	603993	洛阳钼业	19,500	122,655.00	0.10
228	002508	老板电器	3,970	121,561.40	0.10
229	002129	中环股份	15,200	119,016.00	0.09
230	002558	巨人网络	5,000	118,900.00	0.09
231	600297	广汇汽车	20,267	118,764.62	0.09
232	002589	瑞康医药	8,700	118,668.00	0.09
233	601333	广深铁路	27,900	118,575.00	0.09
234	000825	太钢不锈	19,700	118,200.00	0.09
235	000566	海南海药	9,100	117,299.00	0.09
236	002797	第一创业	17,300	117,121.00	0.09
237	300253	卫宁健康	9,400	116,466.00	0.09
238	000630	铜陵有色	52,300	115,583.00	0.09
239	600525	长园集团	10,900	115,213.00	0.09
240	600498	烽火通信	4,612	114,608.20	0.09
241	600642	申能股份	22,500	112,950.00	0.09
242	600004	白云机场	8,600	112,574.00	0.09
243	600170	上海建工	36,900	112,176.00	0.09
244	600885	宏发股份	3,740	111,900.80	0.09
245	600258	首旅酒店	4,100	111,397.00	0.09
246	600315	上海家化	2,800	110,964.00	0.09
247	600438	通威股份	16,000	110,400.00	0.09
248	000876	新希望	17,401	110,322.34	0.09
249	300383	光环新网	8,200	109,962.00	0.09
250	601117	中国化学	16,300	109,699.00	0.09
251	600022	山东钢铁	54,200	109,484.00	0.09
252	600392	盛和资源	6,700	108,741.00	0.09
253	002673	西部证券	14,400	108,720.00	0.09

254	000581	威孚高科	4,900	108,339.00	0.08
255	600325	华发股份	14,000	108,220.00	0.08
256	002268	卫士通	4,900	106,967.00	0.08
257	002465	海格通信	13,300	106,799.00	0.08
258	600549	厦门钨业	7,030	106,715.40	0.08
259	000839	中信国安	22,550	106,661.50	0.08
260	000060	中金岭南	21,900	106,434.00	0.08
261	600079	人福医药	8,002	105,786.44	0.08
262	000656	金科股份	22,000	105,600.00	0.08
263	000513	丽珠集团	2,401	105,523.95	0.08
264	600153	建发股份	11,700	105,183.00	0.08
265	600811	东方集团	24,400	104,920.00	0.08
266	300266	兴源环境	5,200	103,948.00	0.08
267	600884	杉杉股份	4,700	103,870.00	0.08
268	000709	河钢股份	35,200	103,840.00	0.08
269	000066	中国长城	14,537	103,358.07	0.08
270	000826	启迪桑德	5,900	103,132.00	0.08
271	002624	完美世界	3,300	102,333.00	0.08
272	002092	中泰化学	10,600	102,184.00	0.08
273	002085	万丰奥威	10,800	101,520.00	0.08
274	002176	江特电机	10,300	100,116.00	0.08
275	600038	中直股份	2,500	99,975.00	0.08
276	002439	启明星辰	4,700	99,734.00	0.08
277	000690	宝新能源	14,300	99,528.00	0.08
278	600977	中国电影	6,200	99,448.00	0.08
279	600260	凯乐科技	3,700	99,308.00	0.08
280	002352	顺丰控股	2,200	99,000.00	0.08
281	601168	西部矿业	15,700	98,596.00	0.08
282	002223	鱼跃医疗	5,050	98,424.50	0.08
283	601360	三六零	3,400	98,260.00	0.08

284	601633	长城汽车	10,000	98,200.00	0.08
285	000983	西山煤电	13,000	97,630.00	0.08
286	000039	中集集团	7,300	96,944.00	0.08
287	600489	中金黄金	14,200	96,844.00	0.08
288	600346	恒力股份	6,600	96,756.00	0.08
289	600415	小商品城	22,400	96,544.00	0.08
290	000961	中南建设	15,300	96,543.00	0.08
291	600188	兖州煤业	7,400	96,496.00	0.08
292	600663	陆家嘴	6,100	96,319.00	0.08
293	600528	中铁工业	9,400	96,068.00	0.08
294	603369	今世缘	4,200	95,886.00	0.08
295	600138	中青旅	4,800	95,664.00	0.08
296	000488	晨鸣纸业	7,403	95,646.76	0.08
297	600583	海油工程	18,100	95,206.00	0.07
298	300315	掌趣科技	22,700	94,886.00	0.07
299	002127	南极电商	10,100	94,839.00	0.07
300	002500	山西证券	14,000	94,360.00	0.07
301	600967	内蒙一机	7,400	94,276.00	0.07
302	600718	东软集团	7,200	94,032.00	0.07
303	300146	汤臣倍健	6,100	94,001.00	0.07
304	002195	二三四五	21,915	93,796.20	0.07
305	000636	风华高科	5,900	93,692.00	0.07
306	600118	中国卫星	4,900	93,590.00	0.07
307	601216	君正集团	27,700	93,349.00	0.07
308	002110	三钢闽光	5,800	92,974.00	0.07
309	000997	新大陆	5,900	92,925.00	0.07
310	300433	蓝思科技	4,400	92,312.00	0.07
311	600157	永泰能源	51,700	92,026.00	0.07
312	000999	华润三九	3,300	91,839.00	0.07
313	600820	隧道股份	15,501	91,610.91	0.07

314	300418	昆仑万维	4,800	90,624.00	0.07
315	002013	中航机电	11,962	90,552.34	0.07
316	300027	华谊兄弟	14,700	90,552.00	0.07
317	601992	金隅集团	27,500	90,200.00	0.07
318	002019	亿帆医药	5,101	90,032.65	0.07
319	300166	东方国信	6,080	89,558.40	0.07
320	000415	渤海金控	15,300	89,352.00	0.07
321	600369	西南证券	23,200	89,320.00	0.07
322	601228	广州港	15,300	88,893.00	0.07
323	002470	金正大	12,900	88,752.00	0.07
324	600062	华润双鹤	3,600	88,380.00	0.07
325	600643	爱建集团	9,400	88,360.00	0.07
326	600808	马钢股份	24,600	88,314.00	0.07
327	300088	长信科技	15,200	88,160.00	0.07
328	000887	中鼎股份	6,100	87,901.00	0.07
329	000009	中国宝安	17,800	87,220.00	0.07
330	600060	海信电器	6,500	87,035.00	0.07
331	601881	中国银河	10,700	86,991.00	0.07
332	000750	国海证券	24,300	86,751.00	0.07
333	600839	四川长虹	30,300	86,658.00	0.07
334	002408	齐翔腾达	7,041	86,463.48	0.07
335	002384	东山精密	3,600	86,400.00	0.07
336	002555	三七互娱	7,100	86,265.00	0.07
337	000627	天茂集团	12,200	85,644.00	0.07
338	600909	华安证券	14,900	85,228.00	0.07
339	000898	鞍钢股份	15,200	84,664.00	0.07
340	600008	首创股份	19,900	83,978.00	0.07
341	000778	新兴铸管	19,600	83,888.00	0.07
342	002183	怡亚通	12,600	83,790.00	0.07
343	000975	银泰资源	8,243	83,584.02	0.07

344	000681	视觉中国	2,900	83,230.00	0.07
345	600160	巨化股份	11,350	83,082.00	0.07
346	000960	锡业股份	6,900	82,869.00	0.06
347	000930	中粮生化	7,998	82,379.40	0.06
348	002359	北讯集团	4,200	82,236.00	0.06
349	600056	中国医药	4,500	82,215.00	0.06
350	600143	金发科技	15,600	81,432.00	0.06
351	002602	世纪华通	2,501	81,282.50	0.06
352	002640	跨境通	5,400	81,108.00	0.06
353	603816	顾家家居	1,100	80,861.00	0.06
354	601021	春秋航空	2,300	80,569.00	0.06
355	600388	龙净环保	6,300	80,514.00	0.06
356	300182	捷成股份	10,600	80,348.00	0.06
357	600572	康恩贝	11,200	80,304.00	0.06
358	600183	生益科技	8,765	80,287.40	0.06
359	002074	国轩高科	5,700	80,142.00	0.06
360	002221	东华能源	8,200	80,114.00	0.06
361	000729	燕京啤酒	11,900	80,087.00	0.06
362	600282	南钢股份	18,100	80,002.00	0.06
363	000671	阳光城	13,400	79,998.00	0.06
364	000596	古井贡酒	901	79,990.78	0.06
365	000732	泰禾集团	4,100	79,745.00	0.06
366	000402	金融街	9,900	79,695.00	0.06
367	600410	华胜天成	9,100	79,625.00	0.06
368	002373	千方科技	6,100	79,605.00	0.06
369	002371	北方华创	1,600	79,472.00	0.06
370	600380	健康元	6,700	79,462.00	0.06
371	600460	士兰微	6,500	79,300.00	0.06
372	600166	福田汽车	38,700	78,561.00	0.06
373	600655	豫园股份	8,300	78,435.00	0.06

374	002153	石基信息	2,700	78,300.00	0.06
375	002506	协鑫集成	16,700	78,156.00	0.06
376	000559	万向钱潮	11,400	77,520.00	0.06
377	600755	厦门国贸	10,500	76,545.00	0.06
378	601098	中南传媒	6,000	75,840.00	0.06
379	002407	多氟多	5,400	75,708.00	0.06
380	300274	阳光电源	8,440	75,706.80	0.06
381	600094	大名城	13,100	75,456.00	0.06
382	603077	和邦生物	43,500	75,255.00	0.06
383	600376	首开股份	10,697	75,199.91	0.06
384	000938	紫光股份	1,200	75,120.00	0.06
385	000686	东北证券	11,600	74,356.00	0.06
386	300251	光线传媒	7,300	74,314.00	0.06
387	600704	物产中大	14,200	74,266.00	0.06
388	002273	水晶光电	5,760	74,131.20	0.06
389	600682	南京新百	4,501	73,996.44	0.06
390	000528	柳 工	6,900	73,899.00	0.06
391	002028	思源电气	4,400	73,876.00	0.06
392	002411	必康股份	2,600	73,684.00	0.06
393	002174	游族网络	3,700	73,630.00	0.06
394	600895	张江高科	6,400	73,600.00	0.06
395	600266	北京城建	7,800	73,320.00	0.06
396	600409	三友化工	8,500	73,185.00	0.06
397	603899	晨光文具	2,300	72,887.00	0.06
398	002051	中工国际	4,768	72,807.36	0.06
399	601898	中煤能源	15,000	72,450.00	0.06
400	002385	大北农	17,500	72,275.00	0.06
401	000988	华工科技	5,000	72,250.00	0.06
402	600291	西水股份	5,400	72,144.00	0.06
403	002030	达安基因	4,640	71,548.80	0.06

404	600499	科达洁能	10,400	71,344.00	0.06
405	600267	海正药业	4,900	71,246.00	0.06
406	300010	立思辰	5,800	70,992.00	0.06
407	600418	江淮汽车	10,900	70,959.00	0.06
408	600348	阳泉煤业	9,900	70,785.00	0.06
409	600787	中储股份	9,100	70,434.00	0.06
410	600161	天坛生物	3,640	70,434.00	0.06
411	600511	国药股份	2,600	70,070.00	0.05
412	002670	国盛金控	6,505	70,058.85	0.05
413	300033	同花顺	1,800	69,966.00	0.05
414	002603	以岭药业	5,000	69,900.00	0.05
415	002491	通鼎互联	6,300	69,741.00	0.05
416	603885	吉祥航空	4,500	69,345.00	0.05
417	600729	重庆百货	2,100	69,195.00	0.05
418	000401	冀东水泥	7,800	69,186.00	0.05
419	600875	东方电气	9,300	68,913.00	0.05
420	600240	华业资本	9,400	68,902.00	0.05
421	600688	上海石化	12,100	68,849.00	0.05
422	600751	海航科技	10,600	68,794.00	0.05
423	002399	海普瑞	3,100	68,634.00	0.05
424	300287	飞利信	9,500	68,305.00	0.05
425	002281	光迅科技	3,200	67,840.00	0.05
426	600827	百联股份	6,600	67,320.00	0.05
427	002440	闰土股份	5,750	67,217.50	0.05
428	600978	宜华生活	9,800	66,934.00	0.05
429	000807	云铝股份	12,900	66,822.00	0.05
430	000878	云南铜业	7,000	66,780.00	0.05
431	002244	滨江集团	12,800	66,560.00	0.05
432	000970	中科三环	7,100	66,385.00	0.05
433	002601	龙蟠佰利	5,100	65,943.00	0.05

434	002563	森马服饰	4,600	65,780.00	0.05
435	300324	旋极信息	6,924	65,708.76	0.05
436	600959	江苏有线	12,824	65,402.40	0.05
437	600158	中体产业	5,600	65,184.00	0.05
438	000089	深圳机场	8,500	65,025.00	0.05
439	002353	杰瑞股份	4,000	65,000.00	0.05
440	601866	中远海发	26,100	64,989.00	0.05
441	600061	国投资本	7,000	64,960.00	0.05
442	000028	国药一致	1,300	64,870.00	0.05
443	000547	航天发展	8,297	64,799.57	0.05
444	000078	海王生物	13,400	64,454.00	0.05
445	600737	中粮糖业	8,500	64,090.00	0.05
446	002517	恺英网络	8,900	63,991.00	0.05
447	600649	城投控股	10,400	63,648.00	0.05
448	600125	铁龙物流	7,600	63,612.00	0.05
449	002299	圣农发展	4,100	63,509.00	0.05
450	600339	中油工程	14,100	63,309.00	0.05
451	600801	华新水泥	4,200	63,126.00	0.05
452	601966	玲珑轮胎	4,000	63,080.00	0.05
453	600270	外运发展	3,001	62,900.96	0.05
454	601872	招商轮船	17,400	62,814.00	0.05
455	300058	蓝色光标	11,000	62,700.00	0.05
456	300113	顺网科技	3,600	62,676.00	0.05
457	002583	海能达	7,500	62,625.00	0.05
458	600216	浙江医药	4,900	62,573.00	0.05
459	600179	安通控股	6,160	62,400.80	0.05
460	300133	华策影视	5,840	62,196.00	0.05
461	601991	大唐发电	20,400	61,812.00	0.05
462	000813	德展健康	7,500	61,800.00	0.05
463	002280	联络互动	10,800	61,776.00	0.05

464	002366	台海核电	4,300	61,318.00	0.05
465	002368	太极股份	2,100	61,047.00	0.05
466	600466	蓝光发展	9,820	60,884.00	0.05
467	600435	北方导航	7,400	60,384.00	0.05
468	601238	广汽集团	5,400	60,156.00	0.05
469	000553	沙隆达 A	3,800	60,078.00	0.05
470	600037	歌华有线	5,800	59,856.00	0.05
471	002004	华邦健康	11,768	59,781.44	0.05
472	000598	兴蓉环境	14,700	59,682.00	0.05
473	600575	皖江物流	16,000	59,360.00	0.05
474	600277	亿利洁能	11,300	59,212.00	0.05
475	002600	领益智造	11,400	59,166.00	0.05
476	601179	中国西电	17,300	59,166.00	0.05
477	600635	大众公用	15,900	59,148.00	0.05
478	600373	中文传媒	4,600	59,110.00	0.05
479	002573	清新环境	5,100	58,905.00	0.05
480	002152	广电运通	10,000	58,800.00	0.05
481	002358	森源电气	3,900	58,695.00	0.05
482	600500	中化国际	8,600	58,652.00	0.05
483	300055	万邦达	5,101	58,610.49	0.05
484	300115	长盈精密	4,500	58,365.00	0.05
485	601718	际华集团	14,500	58,290.00	0.05
486	603883	老百姓	700	58,212.00	0.05
487	000685	中山公用	7,300	58,181.00	0.05
488	600970	中材国际	8,700	58,116.00	0.05
489	000008	神州高铁	11,700	58,032.00	0.05
490	300197	铁汉生态	10,800	57,996.00	0.05
491	002426	胜利精密	16,100	57,960.00	0.05
492	601000	唐山港	24,578	57,758.30	0.05
493	002131	利欧股份	27,500	57,750.00	0.05

494	603658	安图生物	700	57,722.00	0.05
495	600372	中航电子	4,400	57,464.00	0.05
496	002665	首航节能	9,900	57,420.00	0.05
497	000979	中弘股份	56,800	57,368.00	0.04
498	002745	木林森	3,200	56,928.00	0.04
499	600648	外高桥	3,100	56,668.00	0.04
500	300199	翰宇药业	3,900	55,692.00	0.04
501	300026	红日药业	15,200	55,480.00	0.04
502	000723	美锦能源	10,200	55,386.00	0.04
503	600859	王府井	2,600	55,302.00	0.04
504	002191	劲嘉股份	7,400	55,278.00	0.04
505	600086	东方金钰	5,488	55,099.52	0.04
506	002431	棕榈股份	8,200	55,022.00	0.04
507	601678	滨化股份	8,900	55,002.00	0.04
508	002690	美亚光电	2,300	54,832.00	0.04
509	600563	法拉电子	1,100	54,439.00	0.04
510	600171	上海贝岭	4,700	54,426.00	0.04
511	600863	内蒙华电	23,900	54,253.00	0.04
512	600536	中国软件	2,500	54,075.00	0.04
513	600598	北大荒	5,900	54,044.00	0.04
514	600122	宏图高科	7,300	54,020.00	0.04
515	600307	酒钢宏兴	25,700	53,970.00	0.04
516	002709	天赐材料	1,400	53,956.00	0.04
517	600021	上海电力	8,000	53,920.00	0.04
518	000959	首钢股份	13,100	53,841.00	0.04
519	002285	世联行	8,460	53,044.20	0.04
520	002701	奥瑞金	9,700	52,962.00	0.04
521	601128	常熟银行	9,200	52,624.00	0.04
522	300159	新研股份	7,400	52,392.00	0.04
523	002672	东江环保	4,000	52,360.00	0.04

524	600064	南京高科	7,120	52,260.80	0.04
525	000031	中粮地产	9,000	52,020.00	0.04
526	600848	上海临港	2,400	52,008.00	0.04
527	600717	天津港	6,900	51,957.00	0.04
528	000848	承德露露	4,900	51,891.00	0.04
529	600823	世茂股份	12,400	51,832.00	0.04
530	600754	锦江股份	1,400	51,744.00	0.04
531	600503	华丽家族	13,200	51,612.00	0.04
532	601611	中国核建	6,500	51,350.00	0.04
533	000758	中色股份	11,400	51,300.00	0.04
534	002390	信邦制药	7,000	51,240.00	0.04
535	600664	哈药股份	12,841	50,978.77	0.04
536	600835	上海机电	2,700	50,922.00	0.04
537	000738	航发控制	3,800	50,654.00	0.04
538	002056	横店东磁	7,200	50,472.00	0.04
539	002512	达华智能	5,201	50,449.70	0.04
540	600597	光明乳业	5,100	50,337.00	0.04
541	601958	金钼股份	8,000	50,160.00	0.04
542	600645	中源协和	2,600	50,076.00	0.04
543	002831	裕同科技	1,000	50,000.00	0.04
544	600881	亚泰集团	13,400	49,982.00	0.04
545	600582	天地科技	13,600	49,912.00	0.04
546	002317	众生药业	4,700	49,679.00	0.04
547	600614	鹏起科技	8,700	49,677.00	0.04
548	002444	巨星科技	4,500	49,545.00	0.04
549	002180	纳思达	1,800	49,428.00	0.04
550	600120	浙江东方	3,640	49,322.00	0.04
551	002477	雏鹰农牧	14,900	49,319.00	0.04
552	601880	大连港	25,400	49,276.00	0.04
553	002266	浙富控股	13,100	49,125.00	0.04

554	002128	露天煤业	5,400	48,924.00	0.04
555	600039	四川路桥	14,900	48,872.00	0.04
556	600017	日照港	15,200	48,792.00	0.04
557	000027	深圳能源	9,800	48,412.00	0.04
558	002505	大康农业	22,600	48,364.00	0.04
559	300308	中际旭创	800	48,032.00	0.04
560	600026	中远海能	11,300	47,912.00	0.04
561	002155	湖南黄金	7,000	47,880.00	0.04
562	300001	特锐德	4,200	47,712.00	0.04
563	601808	中海油服	5,000	47,700.00	0.04
564	002250	联化科技	5,400	47,628.00	0.04
565	600594	益佰制药	5,300	47,488.00	0.04
566	002332	仙琚制药	5,400	47,250.00	0.04
567	603766	隆鑫通用	8,700	47,241.00	0.04
568	300002	神州泰岳	11,300	47,121.00	0.04
569	600623	华谊集团	4,700	46,906.00	0.04
570	002400	省广集团	14,400	46,512.00	0.04
571	002212	南洋股份	3,900	46,371.00	0.04
572	600025	华能水电	15,200	46,208.00	0.04
573	600936	广西广电	9,700	46,172.00	0.04
574	000926	福星股份	6,400	46,016.00	0.04
575	002242	九阳股份	2,600	45,994.00	0.04
576	601200	上海环境	2,900	45,907.00	0.04
577	000718	苏宁环球	12,500	45,875.00	0.04
578	002147	新光圆成	4,452	45,766.56	0.04
579	002233	塔牌集团	4,000	45,760.00	0.04
580	000006	深振业A	7,800	45,708.00	0.04
581	002839	张家港行	7,500	45,675.00	0.04
582	600329	中新药业	2,400	45,600.00	0.04
583	000012	南玻A	9,200	45,540.00	0.04

584	603160	汇顶科技	700	45,423.00	0.04
585	000156	华数传媒	4,700	45,308.00	0.04
586	000519	中兵红箭	5,800	45,066.00	0.04
587	600633	浙数文化	5,400	45,036.00	0.04
588	000667	美好置业	21,100	44,943.00	0.04
589	600908	无锡银行	7,600	44,764.00	0.04
590	600557	康缘药业	3,600	44,460.00	0.03
591	002916	深南电路	700	44,457.00	0.03
592	300257	开山股份	2,900	44,341.00	0.03
593	600098	广州发展	6,800	43,860.00	0.03
594	600478	科力远	8,500	43,350.00	0.03
595	300244	迪安诊断	2,280	43,342.80	0.03
596	002635	安洁科技	2,500	43,000.00	0.03
597	601717	郑煤机	7,400	42,994.00	0.03
598	002468	申通快递	2,501	42,892.15	0.03
599	600141	兴发集团	3,680	42,872.00	0.03
600	000563	陕国投 A	12,600	42,840.00	0.03
601	002354	天神娱乐	4,623	42,808.98	0.03
602	600195	中牧股份	2,200	42,790.00	0.03
603	002437	誉衡药业	6,900	42,780.00	0.03
604	600993	马应龙	2,500	42,525.00	0.03
605	603260	合盛硅业	600	42,342.00	0.03
606	002625	光启技术	3,610	42,273.10	0.03
607	002249	大洋电机	9,800	42,238.00	0.03
608	000727	华东科技	22,400	42,112.00	0.03
609	603515	欧普照明	900	42,066.00	0.03
610	600280	中央商场	4,800	41,856.00	0.03
611	000426	兴业矿业	5,800	41,818.00	0.03
612	000021	深科技	6,100	41,602.00	0.03
613	000612	焦作万方	7,900	41,475.00	0.03

614	300376	易事特	7,700	41,349.00	0.03
615	002002	鸿达兴业	8,956	41,287.16	0.03
616	002699	美盛文化	2,200	41,272.00	0.03
617	002434	万里扬	4,700	41,266.00	0.03
618	601828	美凯龙	2,700	41,256.00	0.03
619	600580	卧龙电气	5,399	41,140.38	0.03
620	002807	江阴银行	7,300	41,026.00	0.03
621	002254	泰和新材	3,600	40,968.00	0.03
622	000766	通化金马	3,400	40,392.00	0.03
623	002707	众信旅游	4,200	40,320.00	0.03
624	002022	科华生物	3,400	40,290.00	0.03
625	601311	骆驼股份	3,500	40,145.00	0.03
626	002064	华峰氨纶	9,700	40,061.00	0.03
627	002424	贵州百灵	3,500	39,760.00	0.03
628	600750	江中药业	2,240	39,760.00	0.03
629	300297	蓝盾股份	4,900	39,739.00	0.03
630	002544	杰赛科技	2,900	39,701.00	0.03
631	600416	湘电股份	5,500	39,545.00	0.03
632	601016	节能风电	13,700	39,319.00	0.03
633	000543	皖能电力	8,900	39,249.00	0.03
634	000501	鄂武商 A	3,190	39,205.10	0.03
635	000400	许继电气	5,000	39,050.00	0.03
636	600694	大商股份	1,200	39,012.00	0.03
637	002925	盈趣科技	700	38,766.00	0.03
638	600770	综艺股份	6,500	38,350.00	0.03
639	603444	吉比特	300	38,337.00	0.03
640	601928	凤凰传媒	6,300	38,304.00	0.03
641	001965	招商公路	4,700	38,258.00	0.03
642	002048	宁波华翔	3,100	38,223.00	0.03
643	600759	洲际油气	9,700	38,218.00	0.03

644	603000	人民网	4,600	38,180.00	0.03
645	002308	威创股份	4,600	38,180.00	0.03
646	600259	广晟有色	1,300	38,064.00	0.03
647	601801	皖新传媒	5,000	38,050.00	0.03
648	002277	友阿股份	8,204	37,820.44	0.03
649	600312	平高电气	6,700	37,788.00	0.03
650	000158	常山北明	5,500	37,785.00	0.03
651	600777	新潮能源	17,200	37,668.00	0.03
652	600545	卓郎智能	4,700	37,318.00	0.03
653	600108	亚盛集团	12,900	37,281.00	0.03
654	601108	财通证券	3,300	37,224.00	0.03
655	000090	天健集团	6,000	37,200.00	0.03
656	601608	中信重工	14,300	37,180.00	0.03
657	600233	圆通速递	2,800	36,960.00	0.03
658	000712	锦龙股份	3,700	36,926.00	0.03
659	603198	迎驾贡酒	2,000	36,740.00	0.03
660	002509	天广中茂	12,600	36,666.00	0.03
661	600611	大众交通	9,200	36,616.00	0.03
662	600335	国机汽车	3,500	36,505.00	0.03
663	002657	中科金财	2,300	36,432.00	0.03
664	000592	平潭发展	12,800	36,352.00	0.03
665	002463	沪电股份	9,700	36,278.00	0.03
666	000980	众泰汽车	5,100	36,261.00	0.03
667	000937	冀中能源	8,800	36,168.00	0.03
668	600317	营口港	16,000	36,160.00	0.03
669	002503	搜于特	10,318	36,113.00	0.03
670	600073	上海梅林	5,400	35,856.00	0.03
671	600422	昆药集团	4,600	35,650.00	0.03
672	002073	软控股份	6,200	35,650.00	0.03
673	600565	迪马股份	12,000	35,400.00	0.03

674	000062	深圳华强	1,800	35,280.00	0.03
675	600366	宁波韵升	5,780	35,258.00	0.03
676	600338	西藏珠峰	1,700	35,224.00	0.03
677	000877	天山股份	5,200	35,100.00	0.03
678	601689	拓普集团	1,800	34,992.00	0.03
679	603188	亚邦股份	3,400	34,680.00	0.03
680	600169	太原重工	14,800	34,632.00	0.03
681	600578	京能电力	11,100	34,632.00	0.03
682	002302	西部建设	3,200	34,464.00	0.03
683	600869	智慧能源	7,300	34,456.00	0.03
684	601001	大同煤业	6,900	34,224.00	0.03
685	600390	五矿资本	4,400	34,100.00	0.03
686	002815	崇达技术	2,100	33,810.00	0.03
687	000762	西藏矿业	3,500	33,705.00	0.03
688	600151	航天机电	8,300	33,698.00	0.03
689	600874	创业环保	3,600	33,624.00	0.03
690	600316	洪都航空	3,600	33,552.00	0.03
691	600765	中航重机	4,500	33,480.00	0.03
692	600395	盘江股份	5,500	33,385.00	0.03
693	300156	神雾环保	5,000	33,350.00	0.03
694	000587	金洲慈航	6,700	33,232.00	0.03
695	002428	云南锗业	4,300	33,196.00	0.03
696	002251	步步高	2,900	33,002.00	0.03
697	000600	建投能源	5,900	32,863.00	0.03
698	002489	浙江永强	9,000	32,760.00	0.03
699	600687	刚泰控股	3,600	32,724.00	0.03
700	002345	潮宏基	3,801	32,688.60	0.03
701	000572	海马汽车	9,500	32,585.00	0.03
702	002093	国脉科技	4,202	32,397.42	0.03
703	000829	天音控股	4,400	32,252.00	0.03

704	000541	佛山照明	5,380	32,226.20	0.03
705	002118	紫鑫药业	4,500	32,175.00	0.03
706	002841	视源股份	600	32,046.00	0.03
707	002681	奋达科技	3,700	32,042.00	0.03
708	603659	璞泰来	500	31,945.00	0.03
709	000969	安泰科技	5,100	31,875.00	0.02
710	600300	维维股份	9,700	31,622.00	0.02
711	000536	华映科技	11,400	31,350.00	0.02
712	300039	上海凯宝	5,400	31,320.00	0.02
713	300273	和佳股份	4,600	31,188.00	0.02
714	000552	靖远煤电	9,500	31,065.00	0.02
715	002608	江苏国信	4,500	31,050.00	0.02
716	600155	华创阳安	4,300	30,917.00	0.02
717	600187	国中水务	10,881	30,902.04	0.02
718	002482	广田集团	5,100	30,447.00	0.02
719	002276	万马股份	5,200	30,368.00	0.02
720	603568	伟明环保	1,200	30,360.00	0.02
721	603888	新华网	1,800	30,348.00	0.02
722	002642	荣之联	3,300	30,327.00	0.02
723	000061	农产品	5,600	30,240.00	0.02
724	603556	海兴电力	1,660	30,162.20	0.02
725	600971	恒源煤电	4,200	29,988.00	0.02
726	600058	五矿发展	3,600	29,916.00	0.02
727	002375	亚厦股份	5,600	29,904.00	0.02
728	600393	粤泰股份	8,200	29,684.00	0.02
729	603228	景旺电子	600	29,664.00	0.02
730	002011	盾安环境	4,600	29,440.00	0.02
731	000990	诚志股份	2,100	29,400.00	0.02
732	002818	富森美	1,100	29,018.00	0.02
733	601838	成都银行	3,300	28,875.00	0.02

734	600757	长江传媒	5,000	28,450.00	0.02
735	600773	西藏城投	4,100	28,372.00	0.02
736	601777	力帆股份	5,400	28,242.00	0.02
737	002414	高德红外	2,100	28,224.00	0.02
738	601212	白银有色	6,900	28,221.00	0.02
739	000049	德赛电池	1,000	28,220.00	0.02
740	001696	宗申动力	5,700	27,930.00	0.02
741	600640	号百控股	2,700	27,459.00	0.02
742	603328	依顿电子	2,500	27,125.00	0.02
743	600006	东风汽车	6,600	26,994.00	0.02
744	300134	大富科技	3,017	26,971.98	0.02
745	002920	德赛西威	900	26,910.00	0.02
746	600657	信达地产	6,300	26,775.00	0.02
747	002663	普邦股份	8,900	26,433.00	0.02
748	600639	浦东金桥	2,100	26,208.00	0.02
749	601878	浙商证券	3,100	26,040.00	0.02
750	601127	小康股份	1,500	25,935.00	0.02
751	002344	海宁皮城	5,300	25,758.00	0.02
752	002190	成飞集成	1,500	25,635.00	0.02
753	002261	拓维信息	5,500	25,300.00	0.02
754	600428	中远海特	7,100	25,205.00	0.02
755	600458	时代新材	3,400	25,024.00	0.02
756	002588	史丹利	4,800	24,864.00	0.02
757	300202	聚龙股份	2,300	23,989.00	0.02
758	300291	华录百纳	3,400	23,970.00	0.02
759	000806	银河生物	5,497	23,802.01	0.02
760	600748	上实发展	4,600	23,184.00	0.02
761	600350	山东高速	5,700	23,085.00	0.02
762	600651	飞乐音响	5,800	22,620.00	0.02
763	300032	金龙机电	4,001	22,445.61	0.02

764	300116	坚瑞沃能	8,100	22,356.00	0.02
765	600939	重庆建工	4,500	22,230.00	0.02
766	603056	德邦股份	800	21,912.00	0.02
767	600862	中航高科	3,500	21,525.00	0.02
768	002342	巨力索具	5,600	21,224.00	0.02
769	600184	光电股份	1,700	21,063.00	0.02
770	603355	莱克电气	700	21,035.00	0.02
771	002479	富春环保	3,700	20,905.00	0.02
772	600481	双良节能	6,800	20,808.00	0.02
773	300043	星辉娱乐	5,200	20,800.00	0.02
774	600517	置信电气	5,600	20,720.00	0.02
775	603377	东方时尚	1,460	20,221.00	0.02
776	600743	华远地产	7,800	20,046.00	0.02
777	603806	福斯特	910	20,029.10	0.02
778	002041	登海种业	2,900	19,778.00	0.02
779	600126	杭钢股份	3,300	19,701.00	0.02
780	600292	远达环保	3,300	19,371.00	0.02
781	603868	飞科电器	400	19,348.00	0.02
782	600996	贵广网络	2,600	19,292.00	0.02
783	600167	联美控股	1,900	19,000.00	0.01
784	600053	九鼎投资	1,100	18,887.00	0.01
785	603225	新凤鸣	940	18,771.80	0.01
786	601019	山东出版	2,300	18,423.00	0.01
787	002416	爱施德	3,100	18,197.00	0.01
788	601969	海南矿业	3,300	18,084.00	0.01
789	601020	华钰矿业	1,300	17,927.00	0.01
790	603169	兰石重装	3,500	17,535.00	0.01
791	000987	越秀金控	2,200	17,292.00	0.01
792	603877	太平鸟	500	16,665.00	0.01
793	600618	氯碱化工	1,900	16,169.00	0.01

794	000761	本钢板材	3,800	15,352.00	0.01
795	000025	特力A	400	12,868.00	0.01
796	601811	新华文轩	1,300	12,636.00	0.01
797	600917	重庆燃气	1,600	10,896.00	0.01
798	603025	大豪科技	561	10,849.74	0.01
799	603569	长久物流	700	9,996.00	0.01

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	000939	*ST凯迪	17,800	88,822.00	0.07
2	601330	绿色动力	4,971	81,226.14	0.06
3	601118	海南橡胶	8,800	58,256.00	0.05
4	603650	彤程新材	2,376	50,988.96	0.04
5	603693	江苏新能	5,384	48,456.00	0.04
6	002005	德豪润达	8,800	38,368.00	0.03
7	000669	金鸿控股	3,640	26,390.00	0.02
8	600880	博瑞传播	6,100	25,986.00	0.02
9	603706	东方环宇	1,765	23,103.85	0.02
10	603105	芯能科技	3,410	16,470.30	0.01
11	600485	信威集团	900	9,576.00	0.01
12	000693	*ST华泽	200	272.00	0.00

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	7,562,846.00	5.29
2	600036	招商银行	2,425,189.00	1.70

3	600519	贵州茅台	2,257,426.00	1.58
4	000333	美的集团	1,596,548.00	1.12
5	000651	格力电器	1,536,561.00	1.07
6	601166	兴业银行	1,473,881.00	1.03
7	601398	工商银行	1,387,356.00	0.97
8	600016	民生银行	1,337,282.37	0.93
9	600000	浦发银行	1,305,674.11	0.91
10	600887	伊利股份	1,224,249.00	0.86
11	601328	交通银行	1,187,756.00	0.83
12	600030	中信证券	1,011,142.00	0.71
13	000002	万科A	1,009,974.32	0.71
14	601288	农业银行	997,610.00	0.70
15	601169	北京银行	978,074.00	0.68
16	600837	海通证券	961,519.00	0.67
17	000001	平安银行	951,005.00	0.66
18	600276	恒瑞医药	918,359.00	0.64
19	601668	中国建筑	910,720.00	0.64
20	000858	五粮液	903,745.00	0.63

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	601318	中国平安	7,281,561.31	5.09
2	600519	贵州茅台	2,446,359.62	1.71
3	600036	招商银行	2,229,493.00	1.56
4	000333	美的集团	1,657,335.92	1.16
5	000651	格力电器	1,611,077.60	1.13
6	601166	兴业银行	1,437,635.00	1.01
7	600016	民生银行	1,308,259.00	0.91

8	601398	工商银行	1,295,278.00	0.91
9	600887	伊利股份	1,284,574.00	0.90
10	600000	浦发银行	1,272,901.92	0.89
11	601328	交通银行	1,137,459.00	0.80
12	000002	万科A	1,020,795.44	0.71
13	600837	海通证券	973,391.50	0.68
14	600276	恒瑞医药	971,346.00	0.68
15	002415	海康威视	969,717.00	0.68
16	600030	中信证券	958,974.00	0.67
17	601288	农业银行	947,159.00	0.66
18	000858	五粮液	938,911.11	0.66
19	601169	北京银行	915,432.52	0.64
20	000001	平安银行	891,958.80	0.62

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

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	139,740,055.50
卖出股票收入（成交）总额	137,551,177.66

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 本报告期投资基金情况

本基金本报告期末未持有基金。

7.13 投资组合报告附注

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

7.13.2 基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

7.13.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	143,390.74
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	1,832.33
5	应收申购款	74,558.92
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	219,781.99

7.13.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.13.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限情况。

7.13.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000939	*ST凯迪	88,822.00	0.07	实行退市风险警示公告
2	601118	海南橡胶	58,256.00	0.05	拟筹划重大资产重组
3	603693	江苏新能	48,456.00	0.04	新股未上市

7.13.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
天弘中证800A	1,384	103,678.11	139,305,289.74	97.08%	4,185,210.40	2.92%
天弘中证800C	1,226	8,680.61	5,000,000.00	46.98%	5,642,428.50	53.02%

合计	2,610	59,054.76	144,305,289.74	93.62%	9,827,638.90	6.38%
----	-------	-----------	----------------	--------	--------------	-------

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

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本开放式基金	天弘中证800A	458.95	0.00%
	天弘中证800C	—	—
	合计	458.95	0.00%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	6.49%	10,000,000.00	6.49%	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	6.49%	10,000,000.00	6.49%	
----	---------------	-------	---------------	-------	--

注：本基金成立后有10,000,000.00份为发起份额，发起份额承诺的持有期限为2015年07月16日至2018年07月16日。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	天弘中证800A	天弘中证800C
基金合同生效日(2015年07月16日) 基金份额总额	5,000,000.00	5,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	142,852,728.31	9,980,658.12
本报告期基金总申购份额	4,096,646.73	24,719,361.54
减：本报告期基金总赎回份额	3,458,874.90	24,057,591.16
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期末基金份额总额	143,490,500.14	10,642,428.50

注：总申购份额含转换转入份额；总赎回份额含转换转出份额。

§ 10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略没有改变。

10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本报告期内本基金未持有基金。

10.6 基金改聘会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生变化。

10.7 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况

本报告期内本基金管理人、托管人及其高级管理人员没有发生受稽查或处罚的情况。

10.8 基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占股票成交总额比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
广发证券	2	276,135,259.42	100.00%	63,871.17	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况稳定；经营行为规范，内控制度健全，最近两年未因重大违规行为受到监管机关的处罚；研究实力较强，能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、市场分析报告、行业研究报告、个股分析报告及全面的信息服务。

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

3、本基金报告期内新租用交易单元：无。

4、本基金报告期内停止租用交易单元：无。

10.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	天弘中证 800 指数型发起式证券投资基金 2017 年第 4 季度报告	中国证监会指定媒体	2018-01-19
2	天弘基金管理有限公司关于设立深圳分公司的公告	中国证监会指定媒介	2018-02-02
3	天弘基金管理有限公司关于在上海利得基金销售有限公司开通定投及转换业务以及参加其相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒体	2018-02-06

4	天弘基金管理有限公司关于增聘天弘中证 800 指数型发起式证券投资基金基金经理的公告	中国证监会指定媒体	2018-02-12
5	天弘中证 800 指数型发起式证券投资基金招募说明书(更新)摘要	中国证监会指定媒体	2018-03-01
6	天弘中证 800 指数型发起式证券投资基金招募说明书(更新)	中国证监会指定媒体	2018-03-01
7	天弘基金管理有限公司关于增加嘉实财富管理有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回及转换业务以及参加其相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒体	2018-03-02
8	天弘基金管理有限公司关于增加恒天明泽基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投及转换业务以及参加其相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒体	2018-03-15
9	天弘基金管理有限公司关于调整旗下部分公开募集开放式证券投资基金赎回费的公告	中国证监会指定媒体	2018-03-24
10	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	中国证监会指定媒体	2018-03-29
11	天弘中证 800 指数型发起式证券投资基金 2017 年年度报告	中国证监会指定媒体	2018-03-29
12	天弘基金管理有限公司关于天弘中证 800 指数型发起式证券投资基金修订基金合同部分条款的公告	中国证监会指定媒体	2018-03-30
13	天弘中证 800 指数型发起式证券投资基金托管协议	中国证监会指定媒体	2018-03-30
14	天弘中证 800 指数型发起式证券投资基金基金合同	中国证监会指定媒体	2018-03-30
15	天弘基金管理有限公司关于增加深圳盈信基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投及转换业务以及参加其相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒体	2018-03-31
16	天弘基金管理有限公司关于增加通华财富(上海)基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回及转换业务以及参加	中国证监会指定媒体	2018-03-31

	其费率优惠活动的公告		
17	天弘基金管理有限公司关于增加大泰金石基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投及转换业务以及参加其费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒体	2018-03-31
18	天弘基金管理有限公司关于增加北京展恒基金销售股份有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投及转换业务以及参加其费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒体	2018-03-31
19	天弘基金管理有限公司关于设立四川分公司的公告	中国证监会指定媒介	2018-04-03
20	天弘中证 800 指数型发起式证券投资基金 2018 年第 1 季度报告	中国证监会指定媒体	2018-04-23
21	天弘基金管理有限公司关于增加和耕传承基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回业务以及参加其费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒体	2018-05-12
22	天弘基金管理有限公司关于对旗下基金在网上交易系统的指定支付渠道开展申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2018-05-15
23	天弘基金管理有限公司关于在天弘爱理财 APP 开展“弘钱包”账户交易费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2018-05-24
24	天弘基金管理有限公司关于增加上海基煜基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投及转换业务以及参加其费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒体	2018-06-08
25	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会指定媒介	2018-06-26
26	天弘基金管理有限公司旗下基金 2018 年 6 月 29 日基金资产净值公告	中国证监会指定媒体	2018-06-29
27	天弘基金管理有限公司旗下基金 2018 年 6 月 30 日基金资产净值公	中国证监会指定媒体	2018-06-30

告		
---	--	--

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2018/01/01-2018/06/30	74,419,974.13	—	—	74,419,974.13	48.28%
机构	2	2018/01/01-2018/06/30	35,931,548.69	—	—	35,931,548.69	23.31%

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。

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层

12.3 查阅方式

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

公司网站：www.thfund.com.cn

天弘基金管理有限公司
二〇一八年八月二十七日