

天弘沪深 300 指数型发起式证券投资基金

2018 年年度报告

2018 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:招商证券股份有限公司

送出日期:2019 年 03 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。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年03月25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。

本报告期自2018年01月01日起至2018年12月31日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	5
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
3.3 过去三年基金的利润分配情况	12
§4 管理人报告	12
4.1 基金管理人及基金经理情况	12
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	14
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	14
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	15
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	16
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	16
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	18
4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明	18
§5 托管人报告	18
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	18
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	18
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	18
§6 审计报告	19
6.1 审计报告基本信息	19
6.2 审计报告的基本内容	19
§7 年度财务报表	21
7.1 资产负债表	21
7.2 利润表	23
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	25
7.4 报表附注	26
§8 投资组合报告	57
8.1 期末基金资产组合情况	57
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	57
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	59
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	69
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	71
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	71
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	71
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	72
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	72
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	72

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	72
8.12 投资组合报告附注.....	73
§9 基金份额持有人信息.....	74
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	74
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	74
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.....	75
9.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	75
§10 开放式基金份额变动.....	75
§11 重大事件揭示.....	75
11.1 基金份额持有人大会决议.....	75
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.....	75
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	76
11.4 基金投资策略的改变.....	76
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	76
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况.....	76
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	76
11.8 其他重大事件.....	77
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	87
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.....	87
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	87
§13 备查文件目录.....	87
13.1 备查文件目录.....	87
13.2 存放地点.....	88
13.3 查阅方式.....	88

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	天弘沪深300指数型发起式证券投资基金	
基金简称	天弘沪深300	
基金主代码	000961	
基金运作方式	契约型开放式、发起式	
基金合同生效日	2015年01月20日	
基金管理人	天弘基金管理有限公司	
基金托管人	招商证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,324,705,334.52份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	天弘沪深300A	天弘沪深300C
下属分级基金的交易代码	000961	005918
报告期末下属分级基金的份额总额	2,106,917,311.22份	217,788,023.30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	沪深300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	招商证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	童建林
	联系电话	022-83310208
	电子邮箱	service@thfund.com.cn
客户服务电话	95046	95565
传真	022-83865569	0755-82960794
注册地址	天津自贸区（中心商务区）响螺湾旷世国际大厦A座1704-241号	深圳市福田区福田街道福华一路111号
办公地址	天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层	深圳市福田区福田街道福华一路111号
邮政编码	300203	518000
法定代表人	井贤栋	霍达

2.4 信息披露方式

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

注：自2019年起本基金选定的信息披露报纸已做出调整。

2.5 其他相关资料

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

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2018年		2017年		2016年	
	天弘沪深300A	天弘沪深300C	天弘沪深300A	天弘沪深300C	天弘沪深300A	天弘沪深300C
本期已实现收益	-19,491,799.12	-2,031,004.91	63,559,420.17	-	-57,323,022.26	-
本期利润	-412,518,867.80	-14,409,622.12	170,298,972.85	-	-12,856,198.70	-
加权平均基金份额本期利润	-0.2733	-0.1816	0.2092	-	-0.0167	-
本期加权平均净值利润率	-26.05%	-20.83%	19.48%	-	-1.77%	-
本期基金份额净值增长率	-22.61%	-19.00%	21.92%	-	-9.71%	-
3.1.2 期末数据和指标	2018年末		2017年末		2016年末	
期末可供分配利润	-184,899,946.36	-41,373,004.16	15,616,559.90	-	-52,231,999.36	-
期末可供分配基金份额利润	-0.0878	-0.1900	0.0163	-	-0.0659	-
期末基金资产净值	1,922,017,364.86	176,415,019.14	1,130,712,253.23	-	766,407,886.89	-
期末基金份额净值	0.9122	0.8100	1.1787	-	0.9668	-
3.1.3 累计期末指标	2018年末		2017年末		2016年末	
基金份额累计净值增长率	-8.78%	-19.00%	17.87%	-	-3.32%	-

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、本基金自2018年04月24日起增设C类基金份额(即天弘沪深300C),原基金份额转为A类基金份额(即天弘沪深300A)。C类基金份额的首次确认日为2018年04月25日,增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

天弘沪深300A

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-11.53%	1.53%	-11.83%	1.56%	0.30%	-0.03%
过去六个月	-12.52%	1.41%	-13.52%	1.42%	1.00%	-0.01%
过去一年	-22.61%	1.26%	-24.12%	1.27%	1.51%	-0.01%
过去三年	-14.81%	1.13%	-18.19%	1.12%	3.38%	0.01%
自基金合同生效起至今(2015年01月20日-2018年12月31日)	-8.78%	1.53%	-9.18%	1.51%	0.40%	0.02%

天弘沪深300C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
----	----------	-------------	------------	--------------	-----	-----

				④		
过去三 个月	-11.57%	1.53%	-11.83%	1.56%	0.26%	-0.03%
过去六 个月	-12.60%	1.41%	-13.52%	1.42%	0.92%	-0.01%
自基金 份额首 次确认 日起至 今（201 8年04月 25日-20 18年12 月31日）	-19.00%	1.33%	-20.63%	1.34%	1.63%	-0.01%

注：天弘沪深 300 基金业绩比较基准：沪深 300 指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%。

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

天弘沪深300A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2015年01月20日-2018年12月31日)



天弘沪深300C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2018年04月25日-2018年12月31日)

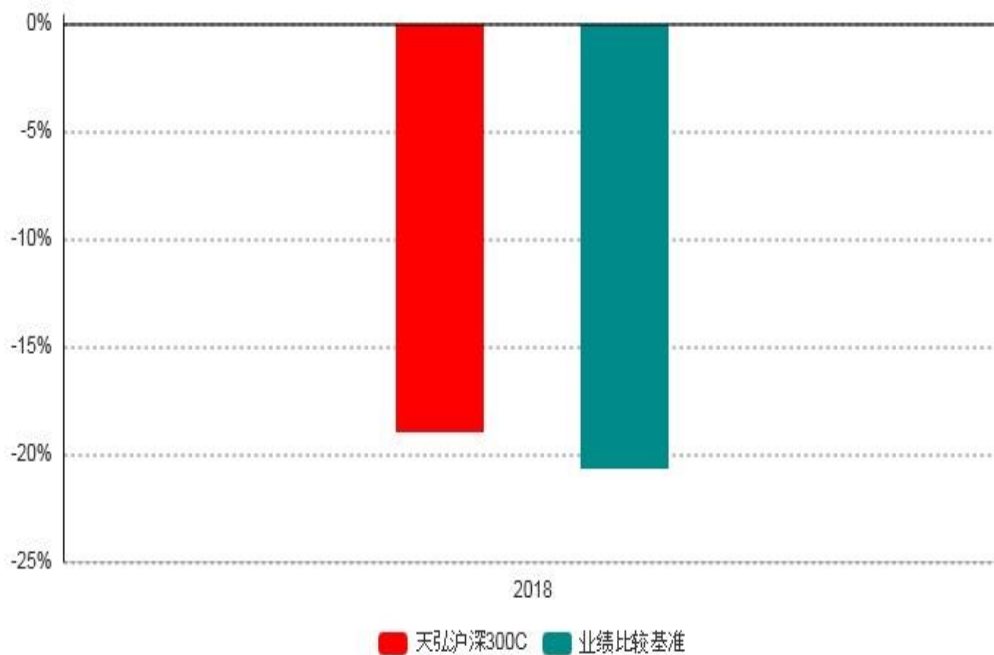
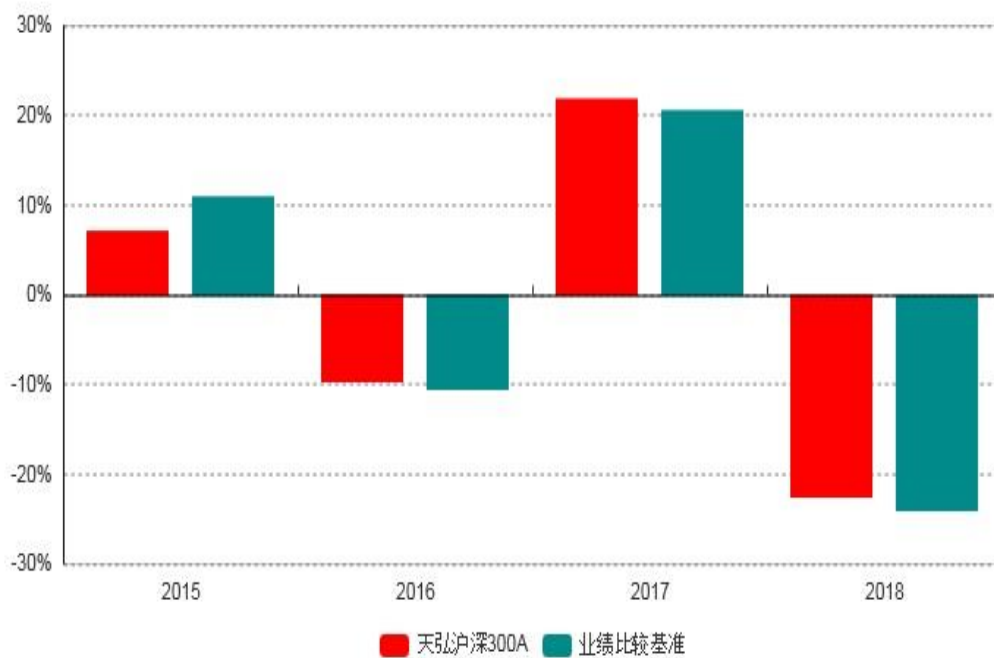


注：1、本基金合同于 2015 年 01 月 20 日生效。

2、本基金自 2018 年 04 月 24 日起增设 C 类基金份额（即天弘沪深 300C），原基金份额转为 A 类基金份额（即天弘沪深 300A）。C 类基金份额的首次确认日为 2018 年 04 月 25 日，增设当期的相关数据和指标按实际存续期计算。

3、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 01 月 20 日生效。基金合同生效当年 2015 年的净值增长率按照基金合同生效后当年的实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。本基金于 2018 年 04 月 24 日起增加天弘沪深 300C 类基金份额，并于 2018 年 04 月 24 日起办理该类份

额的申购和赎回业务。天弘沪深 300C 类 2018 年的净值增长率按照天弘沪深 300C 类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

本基金过去三年未进行利润分配，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、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12月31日，本基金管理人共管理45只基金：天弘精选混合型证券投资基金、天弘永利债券型证券投资基金、天弘永定价值成长混合型证券投资基金、天弘周期策略混合型证券投资基金、天弘文化新兴产业股票型证券投资基金、天弘添利债券型证券投资基金（LOF）、天弘丰利债券型证券投资基金（LOF）、天弘现金管家货币市场基金、天弘债券型发起式证券投资基金、天弘安康颐养混合型证券投资基金（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”）、天弘中证证券保险指数型发起式证券投资基金、天弘中证银行指数型发起式证券投资基金、天弘创业板指数型发起式证券投资基金、天弘上证50指数型发起式证券投资基金、天弘中证800指数型发起式证券投资基金、天弘中证电子指数型发起式证券投资基金、天弘中证计算机主题指数型发起式证券投资基金（原“天弘中证计算机指数型发起式证券投资基金”）、天弘中证食品饮料指数型发起式证券投资基金、天弘弘运宝货币市场基金、天弘裕利灵活配置混合型证券投资基金、天弘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、天弘信利债券型证券投资基金、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（助理）期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张子法	本基金基金经理。	2017年04月	-	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 公平交易制度和控制方法

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

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

4.3.2 公平交易制度的执行情况

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

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

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

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

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

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

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

4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

报告期内,本基金秉承合规第一、风控第一的原则,坚持既定的指数化投资策略,力争投资回报与所跟踪指数保持一致,努力为投资者提供一个良好的指数投资工具。

出于基金充分投资、减少交易成本、降低跟踪误差的需要,基于谨慎原则报告期内本基金运用股指期货工具对基金投资组合进行管理,以应对大额申购时巨额资金在途等特殊情形。根据风险管理的原则,本基金在报告期内运用股指期货工具旨在提高投资效率,控制基金投资组合风险水平,力求更好地实现本基金的投资目标。

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、成分股停牌等情况可能对指数跟踪效果带来影响时,本基金坚持既定的指数化投资策略,对指数基金采取被动复制与组合优化相结合的方式跟踪指数。报告期内,本基金整体运行平稳。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2018年12月31日,天弘沪深300A基金份额净值为0.9122元,天弘沪深300C基金份额净值为0.8100元。报告期内份额净值增长率天弘沪深300A为-22.61%,同期业绩比较基准增长率为-24.12%;天弘沪深300C为-19.00%,同期业绩比较基准增长率为-20.63%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

最新数据显示，PMI仍处于荣枯线以下，房地产投资趋势性向下，基建投资面临地方政府债务制约反弹乏力，外部需求面临中美贸易争端以及全球经济增长放缓的拖累，汽车销量下滑，社会消费品零售总额增速较低，2019年国内经济增长仍然面临较大的下行压力，稳增长也面临着一定的考验。但另一方面，宏观经济政策已经发生较大的转变，货币政策保持宽松，财政减税降费将继续推进，力促金融支持实体经济尤其是支持小微企业、民营企业的配套政策措施加速出台，政策底已清晰进入右侧。展望2019年，我们预期货币政策保持宽松，持续降准仍然值得期待，加大专项债供给力保基建平稳，另外，制造业投资企稳回升的趋势将延续，中国经济结构调整正在取得积极进展，虽然实际GDP增速保持平稳，但经济结构将更加优化，减税降费刺激消费，国资国企、财税金融、土地、市场准入、社会管理等领域的改革持续推进，都将是中国经济增长新的支点。过去一年A股市场经历了中美贸易战冲击、国内经济下行压力，金融市场风险暴露，随着风险的逐步释放，目前A股整体的估值水平可能已经到达底部区域，配置价值逐步显现。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人的监察稽核工作一切从合规运作、防范和控制风险、保障基金份额持有人利益出发，由独立的内控合规部门按照规定的权限和程序，认真履行职责，对公司、基金运作及员工行为的合法性、合规性进行定期和不定期监督和检查。发现问题及时提出建议并督促相关部门改进完善，及时与有关人员沟通，并定期制作监察稽核报告报公司董事会。公司经理层面成立了风险管理委员会，根据公司总体风险控制目标，分配各业务和各环节风险控制目标和要求；落实公司重大风险管理的决定或决议；听取并讨论会议成员的报告；对会议成员提出的或发现的已经存在的风险点，在充分讨论、协调基础上形成具体的风险控制措施；对潜在风险点分析讨论，拟定应对措施；对发生的风险事件和重大差错，分析原因、总结经验教训、风险定级、划分责任，向总经理办公会报告。同时，本基金管理人根据全面性原则、独立性原则、相互制约原则、定性和定量相结合原则、重要性原则建立了一套比较完整的内部控制体系，该内部控制体系由一系列业务管理制度及相应的业务处理、控制程序组成，具体包括控制环境、风险评估、控制活动、信息和沟通、监控等要素。本基金管理人已通过了ISAE3402（《国际鉴证业务准则第3402号》）认证，获得无保留意见的控制设计适当性报告。本报告期，本基金管理人全面开展基金运作监察稽核工作，确保基金投资、营销及后台运作等各环节的合法合规。通过定期检查、不定期抽查等工作方法，完善内部控制，基金运作没有出现违规行为。本报告期内，本基金管理人有关本基金的监察稽核主要工作如下：

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

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

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

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

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

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

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

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

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

员会由公司分管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。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.9 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内本基金管理人无应说明预警信息。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

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

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2019)第20610号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	天弘沪深300指数型发起式证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	<p>(一)我们审计的内容</p> <p>我们审计了天弘沪深300指数型发起式证券投资基金(以下简称“天弘沪深300指数型发起式基金”)的财务报表,包括2018年12月31日的资产负债表,2018年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p> <p>(二)我们的意见</p> <p>我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了天弘沪深300指数型发起式基金2018年12月31日的财务状况以及2018年度的经营成果和基金净值变动情况。</p>
形成审计意见的基础	<p>我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。</p> <p>按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于天弘沪深300指数型发起式基金,并履行了职业道德方面的其他责任。</p>

强调事项	无
其他事项	无
其他信息	无
管理层和治理层对财务报表的责任	<p>天弘沪深300指数型发起式基金的基金管理人天弘基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。</p> <p>在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估天弘沪深300指数型发起式基金的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算天弘沪深300指数型发起式基金、终止运营或别无其他现实的选择。</p> <p>基金管理人治理层负责监督天弘沪深300指数型发起式基金的财务报告过程。</p>
注册会计师对财务报表审计的责任	<p>我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证,但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致,如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策,则通常认为错报是重大的。</p> <p>在按照审计准则执行审计工作的过程中,我们运用职业判断,并保持职业怀疑。同时,我们也执行以下工作:</p> <p>(一) 识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险;设计和实施审计程序以应对这些风险,并获取充分、适当的审计证据,作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上,</p>

	<p>未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。</p> <p>(二) 了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。</p> <p>(三) 评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。</p> <p>(四) 对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能对天弘沪深300指数型发起式基金持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致天弘沪深300指数型发起式基金不能持续经营。</p> <p>(五) 评价财务报表的总体列报、结构和内容(包括披露)，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。</p> <p>我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。</p>
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	薛竞 周祎
会计师事务所的地址	中国上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
审计报告日期	2019-03-26

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：天弘沪深300指数型发起式证券投资基金

报告截止日：2018年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
资产：			
银行存款	7.4.7.1	145,198,036.89	84,806,838.77
结算备付金		8,954,858.82	10,179,952.16
存出保证金		946,488.52	2,100,646.98
交易性金融资产	7.4.7.2	1,961,501,503.44	1,054,998,149.67
其中：股票投资		1,961,501,503.44	1,054,998,149.67
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		-	30,422.02
应收利息	7.4.7.5	71,406.87	43,366.36
应收股利		-	-
应收申购款		13,857,154.64	20,488,919.65
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		2,130,529,449.18	1,172,648,295.61
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年12月31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	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-

应付证券清算款		21,606,036.31	258,363.15
应付赎回款		8,535,203.13	40,421,388.65
应付管理人报酬		839,054.00	473,440.29
应付托管费		167,810.79	94,688.07
应付销售服务费		22,154.29	-
应付交易费用	7.4.7.7	427,238.58	223,991.63
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	499,568.08	464,170.59
负债合计		32,097,065.18	41,936,042.38
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	2,324,705,334.52	959,301,012.48
未分配利润	7.4.7.10	-226,272,950.52	171,411,240.75
所有者权益合计		2,098,432,384.00	1,130,712,253.23
负债和所有者权益总计		2,130,529,449.18	1,172,648,295.61

注：报告截止日2018年12月31日，天弘沪深300指数型发起式证券投资基金A类基金份额净值0.9122元，天弘沪深300指数型发起式证券投资基金C类基金份额净值0.8100元；基金份额总额2,324,705,334.52份，其中天弘沪深300指数型发起式证券投资基金A类基金份额2,106,917,311.22份，天弘沪深300指数型发起式证券投资基金C类基金份额217,788,023.30份。

7.2 利润表

会计主体：天弘沪深300指数型发起式证券投资基金

本报告期：2018年01月01日至2018年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2018年01月01日至2018年12月31日	上年度可比期间2017年01月01日至2017年12月31日
一、收入		-413,851,755.80	178,602,468.90

1. 利息收入		1,994,028.16	750,314.72
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,994,028.16	750,314.72
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）		-11,455,945.43	71,112,601.50
其中：股票投资收益	7.4.7.12	-42,620,077.68	55,146,269.01
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	7.4.7.13. 2	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-2,549,295.92	1,504,160.00
股利收益	7.4.7.15	33,713,428.17	14,462,172.49
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-405,405,685.89	106,739,552.68
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	1,015,847.36	-
减：二、费用		13,076,734.12	8,303,496.05
1. 管理人报酬	7.4.10.2. 1	8,123,689.02	4,350,757.71
2. 托管费	7.4.10.2. 2	1,624,737.76	870,151.47
3. 销售服务费	7.4.10.2. 3	96,834.21	-
4. 交易费用	7.4.7.18	2,503,780.50	2,517,556.57

5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		2,745.07	-
7. 其他费用	7.4.7.19	724,947.56	565,030.30
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-426,928,489.92	170,298,972.85
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-426,928,489.92	170,298,972.85

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：天弘沪深300指数型发起式证券投资基金

本报告期：2018年01月01日至2018年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018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）	959,301,012.48	171,411,240.75	1,130,712,253.23
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	-426,928,489.92	-426,928,489.92
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）	1,365,404,322.04	29,244,298.65	1,394,648,620.69
其中：1. 基金申购款	4,694,942,433.15	263,740,799.48	4,958,683,232.63
2. 基金赎回款	-3,329,538,111.11	-234,496,500.83	-3,564,034,611.94
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)	2,324,705,334.52	-226,272,950.52	2,098,432,384.00
项 目	上年度可比期间 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)	792,733,443.39	-26,325,556.50	766,407,886.89
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	170,298,972.85	170,298,972.85
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)	166,567,569.09	27,437,824.40	194,005,393.49
其中：1. 基金申购款	2,968,603,604.61	241,284,670.36	3,209,888,274.97
2. 基金赎回款	-2,802,036,035.52	-213,846,845.96	-3,015,882,881.48
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)	959,301,012.48	171,411,240.75	1,130,712,253.23

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

薄贺龙

肖慧敏

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

天弘沪深300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[2014]1358号《关于准予天弘沪深300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《天弘沪深300指数型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式、发起式，存续期限不定，首次募集期间为2015年1月19日，首次设立募集不包括认购资金利息共募集10,000,000.00元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第006号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《天弘沪深300指数型发起式证券投资基金基金合同》于2015年1月20日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为10,000,000.00份基金份额。本基金的基金管理人为天弘基金管理有限公司，基金托管人为招商证券股份有限公司。

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

根据《天弘沪深300指数型发起式证券投资基金基金合同》、《天弘沪深300指数型发起式证券投资基金招募说明书》和《关于天弘沪深300指数型发起式证券投资基金增设C类基金份额并相应修订基金合同部分条款的公告》的有关规定，本基金根据所收取认购/申购费用、赎回费用、销售服务费用方式的差异，将基金份额分为不同的类别。其中，在投资人认购/申购、赎回基金时收取认购/申购费用、赎回费用，并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为天弘沪深300指数型发起式证券投资基金A类基金份额（以下简称“A类基金”）；在投资人申购时不收取申购费、赎回时收取赎回费用，且从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额，称为天弘沪深300指数型发起式证券投资基金C类基金份额（以下简称“C类基金”）。本基金A类和C类基金份额分别设置代码，由于基金费用的不同，本基金A类基金份额和C类基金份额将分别计算并公布基金份额净值和基金份额累计净值。投资人可自行选择认购/申购的基金份额类别，本基金不同基金份额类别之间不得互相转换。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘沪深300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，以沪深300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%，投资于沪深300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：沪深300指数收益率 \times 95%+银行活期存款利率(税后) \times 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审计报告日批准报出。

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》、《天弘沪深300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。

本财务报表以本基金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2018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2018年12月31日的财务状况以及2018年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

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

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

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

(2) 金融负债的分类

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

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

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

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

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

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

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

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资 and 衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，

那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

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

7.4.4.7 实收基金

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

7.4.4.8 损益平准金

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

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

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

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

7.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

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

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资、债券投资和资产支持证券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、财税[2016]140号《关于明确金融房地产开发教育辅助服务等增值税政策的通知》、财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

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

对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务，以2018年1月1日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货，可以选择按照实际买入价计算销售额，或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。

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

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

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

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

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
活期存款	145,198,036.89	84,806,838.77
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	145,198,036.89	84,806,838.77

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末2018年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	2,268,206,426.55	1,961,501,503.44	-306,704,923.11
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	2,268,206,426.55	1,961,501,503.44	-306,704,923.11
项目	上年度末2017年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	956,320,466.89	1,054,998,149.67	98,677,682.78
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	956,320,466.89	1,054,998,149.67	98,677,682.78

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末2018年12月31日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	-	-	-	-
股指期货	-	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	-	-	-	-
项目	上年度末2017年12月31日			
	合同/名义金额	公允价值		备注
		资产	负债	
利率衍生工具	-	-	-	-
货币衍生工具	-	-	-	-
权益衍生工具	9,666,680.00	-	-	-
股指期货	9,666,680.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	9,666,680.00	-	-	-

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
应收活期存款利息	70,246.81	42,297.82

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	691.46	796.18
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	468.60	272.36
合计	71,406.87	43,366.36

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
交易所市场应付交易费用	427,238.58	223,991.63
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	427,238.58	223,991.63

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	3,235.81	20,220.97
预提费用	400,000.00	391,000.00
其他应付	96,332.27	52,949.62
合计	499,568.08	464,170.59

7.4.7.9 实收基金

7.4.7.9.1 天弘沪深300A

金额单位：人民币元

项目 (天弘沪深300A)	本期2018年01月01日至2018年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	959,301,012.48	959,301,012.48
本期申购	4,171,953,658.46	4,171,953,658.46
本期赎回(以“-”号填列)	-3,024,337,359.72	-3,024,337,359.72
本期末	2,106,917,311.22	2,106,917,311.22

7.4.7.9.2 天弘沪深300C

金额单位：人民币元

项目 (天弘沪深300C)	本期2018年01月01日至2018年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	-	-
本期申购	522,988,774.69	522,988,774.69
本期赎回(以“-”号填列)	-305,200,751.39	-305,200,751.39
本期末	217,788,023.30	217,788,023.30

注：1、申购含转换转入份额；赎回含转换转出份额。

2、根据天弘基金管理有限公司2018年4月24日发布的《关于天弘沪深300指数型发起式证券投资基金增设C类基金份额并相应修订基金合同部分条款的公告》，本基金自2018年4月24日起增设C类基金份额，原基金份额转为A类基金份额。

7.4.7.10 未分配利润

7.4.7.10.1 天弘沪深300A

单位：人民币元

项目 (天弘沪深300A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	15,616,559.90	155,794,680.85	171,411,240.75
本期利润	-19,491,799.12	-393,027,068.68	-412,518,867.80
本期基金份额交易产生的变动数	29,105,286.85	27,102,393.84	56,207,680.69

其中：基金申购款	110,397,881.93	218,617,946.10	329,015,828.03
基金赎回款	-81,292,595.08	-191,515,552.26	-272,808,147.34
本期已分配利润	-	-	-
本期末	25,230,047.63	-210,129,993.99	-184,899,946.36

7.4.7.10.2 天弘沪深300C

单位：人民币元

项目 (天弘沪深300C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-	-	-
本期利润	-2,031,004.91	-12,378,617.21	-14,409,622.12
本期基金份额交易产生的变动数	-216,515.75	-26,746,866.29	-26,963,382.04
其中：基金申购款	1,727,717.41	-67,002,745.96	-65,275,028.55
基金赎回款	-1,944,233.16	40,255,879.67	38,311,646.51
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,247,520.66	-39,125,483.50	-41,373,004.16

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2018年01月01日至2018年12月31日	上年度可比期间2017年01月01日至2017年12月31日
活期存款利息收入	1,954,420.52	718,764.48
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	26,914.08	15,278.79
其他	12,693.56	16,271.45
合计	1,994,028.16	750,314.72

7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2018年01月01日至2018年 12月31日	2017年01月01日至2017年 12月31日
卖出股票成交总额	876,938,619.88	954,136,966.02
减：卖出股票成本总额	919,558,697.56	898,990,697.01
买卖股票差价收入	-42,620,077.68	55,146,269.01

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期及上年度可比期间未取得债券投资收益。

7.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间未取得资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 衍生工具收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2018年01月01日至2018年 12月31日	上年度可比期间收益金额 2017年01月01日至2017年 12月31日
期货投资	-2,549,295.92	1,504,160.00

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年 12月31日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年 12月31日
股票投资产生的股利收益	33,713,428.17	14,462,172.49
基金投资产生的股利收益	-	-
合计	33,713,428.17	14,462,172.49

7.4.7.16 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日至2018年12	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12
------	---------------------------	--------------------------------

	月31日	月31日
1. 交易性金融资产	-405,382,605.89	106,716,472.68
——股票投资	-405,382,605.89	106,716,472.68
——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	-23,080.00	23,080.00
——权证投资	-	-
——期货投资	-23,080.00	23,080.00
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	-405,405,685.89	106,739,552.68

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年 12月31日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年 12月31日
基金赎回费收入	935,435.61	-
基金转换费收入	80,411.75	-
合计	1,015,847.36	-

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，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。

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年 12月31日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年 12月31日
交易所市场交易费用	2,503,780.50	2,517,556.57
银行间市场交易费用	-	-
合计	2,503,780.50	2,517,556.57

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年 12月31日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年 12月31日
审计费用	100,000.00	91,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
指数使用费	324,947.56	174,030.30
合计	724,947.56	565,030.30

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

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。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
天弘基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、基金注册登 记机构
招商证券股份有限公司	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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年01月01日至2018年12月31日		上年度可比期间 2017年01月01日至2017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
招商证券股份有限公司	-	-	1,672,256,214.61	80.83%

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未有通过关联方交易单元进行的权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2018年01月01日至2018年12月31日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
招商证券股份有限公司	-	-	-	-
关联方名称	上年度可比期间 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	占期末应付佣金总额的比例
招商证券股份有限公司	1,193,189.12	87.46%	52,927.17	23.63%

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

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

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018年12月31日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	8,123,689.02	4,350,757.71
其中：支付销售机构的客户维护费	2,631,731.00	1,175,836.13

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2018年01月01日至2018 年12月31日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017 年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	1,624,737.76	870,151.47

注：支付基金托管人招商证券股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 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。

7.4.10.2.3 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日至2018年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	天弘沪深300A	天弘沪深300C	合计
天弘基金 管理有限 公司	-	19,824.29	19,824.29
合计	-	19,824.29	19,824.29
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日至2017年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	天弘沪深300A	天弘沪深300C	合计
天弘基金	-	-	-

管理有限 公司			
合计	-	-	-

注：1、支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值的约定年费率计提，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。C级基金份额约定的销售服务费年费率分别为0.25%。其计算公式为：

日销售服务费=前一日C类基金份额基金资产净值 X 约定年费率/ 当年天数。

2、根据天弘基金管理有限公司2018年7月3日发布的《天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金开展销售服务费率优惠活动的公告》，自2018年7月3日起至2018年12月31日止期间，本基金C类份额的销售服务费率优惠至0.20%。

3、本基金A类份额不收取销售服务费。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本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。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

天弘沪深300A

份额单位：份

项目	本期 2018年01月01日至2018年12 月31日	上年度可比期间 2017年01月01日至2017年12 月31日
报告期初持有的基金份额	19,190,331.77	19,190,331.77
报告期间申购/买入总 份额	-	-
报告期间因拆分变动份 额	-	-
减：报告期间赎回/卖出 总份额	10,000,000.00	-
报告期末持有的基金份 额	9,190,331.77	19,190,331.77

报告期末持有的基金份额 额占基金总份额比例	0.44%	2.00%
--------------------------	-------	-------

天弘沪深300C

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间
	2018年01月01日至2018年12月31日	2017年01月01日至2017年12月31日
报告期初持有的基金份额	-	-
报告期间申购/买入总份额	11,369,391.79	-
报告期间因拆分变动份额	-	-
减：报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	11,369,391.79	-
报告期末持有的基金份额 额占基金总份额比例	5.22%	-

注：1、期间申购/买入总份额含转换入份额，期间赎回/卖出总份额含转换出份额。
2、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。
3、报告期末持有的本基金份额占基金总份额比例，比例的分母分别采用 A、C类各自级别的份额总额计算。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告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。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期		上年度可比期间	
	2018年01月01日至2018年12月31日		2017年01月01日至2017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
招商证券	145,198,036.89	1,954,420.52	84,806,838.77	718,764.48

股份有限 公司				
------------	--	--	--	--

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

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期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。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

于2018年12月31日，本基金持有597,000股招商证券的A股普通股，成本总额为人民币8,984,296.21元，估值总额为人民币7,999,800.00元，占基金资产净值的比例为0.38%(2017年12月31日：0.31%)。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期内无利润分配事项。

7.4.12 期末（2018年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

金额单位：人民币元

7.4.12.1.1 受限证券类别：股票										
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
601860	紫金银行	2018-12-20	2019-01-03	新股未上市	3.14	3.14	15,970	50,145.80	50,145.80	-

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。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股	股	停	停	期	复	复	数量	期末成本	期末估值	备
---	---	---	---	---	---	---	----	------	------	---

票 代 码	票 名 称	牌 日 期	牌 原 因	末 估 值 单 价	牌 日 期	牌 开 盘 单 价	(股)	总 额	总 额	注
600 030	中 信 证 券	201 8-1 2-2 5	重 要 事 项 未 公 告	16. 01	201 9-0 1-1 0	17. 15	1, 580, 4 55	27, 302, 45 8. 41	25, 303, 08 4. 55	-
600 485	信 威 集 团	201 6-1 2-2 6	重 大 资 产 重 组	10. 64	-	-	144, 102	2, 201, 33 0. 33	1, 533, 24 5. 28	-
000 540	中 天 金 融	201 7-0 8-2 1	重 大 资 产 重 组	3. 8 0	201 9-0 1-0 2	4. 3 8	284, 100	1, 306, 09 9. 25	1, 079, 58 0. 00	-

注：本基金截至2018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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2018年12月31日，本基金未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2018年12月31日，本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为指数型基金，采用指数复制投资策略，标的指数为沪深300指数，按照个股在标的指数中的基准权重构建股票组合，并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应地调整，以复制和跟踪标的指数。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取将以上风险控制在限定的范围之内，使本基金在风险和收益之间取得最佳的平衡以实现与跟踪指数相同的风险收益目标。

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

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

7.4.13.2 信用风险

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

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管人招商证券股份有限公司开立于具有基金托管人资格的交通银行股份有限公司的托管账户，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12月31日，本基金无债券投资(2017年12月31日：同)。

7.4.13.3 流动性风险

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

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。此外，基金管理人经与基金托管人协商，在确保投资者得到公平对待的前提下，可依照法律法规及基金合同的约定，综合运用各类流动性风险管理工具，对赎回申请等进行适度调整，作为特定情形下基金管理人流动性风险管理的辅助措施。

于2018年12月31日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.3.1 报告期内本基金组合资产的流动性风险分析

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

本基金投资于一家公司发行的证券市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家上市公司发行的证券不得超过该证券的10%。本基金与由本基金的基金管理人管理的其他开放式基金共同持有一家上市公司发行的可流通股票不得超过该上市公司可流通股票的15%，本基金与由本基金的基金管理人管理的全部投资组合持有一家上市公司发行的可流通股票，不得超过该上市公司可流

通股票的30%(完全按照有关指数构成比例进行证券投资的开放式基金及中国证监会认定的特殊投资组合不受上述比例限制)。

本基金所持部分证券在证券交易所上市,其余亦可在银行间同业市场交易,部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况参见附注7.4.12。此外,本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求,其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。本基金主动投资于流动性受限资产的市值合计不得超过基金资产净值的15%。于2018年12月31日,本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为1.33%。

本基金的基金管理人每日对基金组合资产中7个工作日可变现资产的可变现价值进行审慎评估与测算,确保每日确认的净赎回申请不得超过7个工作日可变现资产的可变现价值。于2018年12月31日,本基金组合资产中7个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

同时,本基金的基金管理人通过合理分散逆回购交易的到期日与交易对手的集中度;按照穿透原则对交易对手的财务状况、偿付能力及杠杆水平等进行必要的尽职调查与严格的准入管理,以及对不同的交易对手实施交易额度管理并进行动态调整等措施严格管理本基金从事逆回购交易的流动性风险和交易对手风险。此外,本基金的基金管理人建立了交易对手管理制度,要求根据质押品的资质确定质押率水平;持续监测质押品的风险状况与价值变动以确保质押品按公允价值计算足额;并在与私募类证券资管产品及中国证监会认定的其他主体为交易对手开展逆回购交易时,可接受质押品的资质要求与基金合同约定的投资范围保持一致。

7.4.13.4 市场风险

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

7.4.13.4.1 利率风险

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

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

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

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2018年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	145,198,036.89	-	-	-	145,198,036.89
结算备付金	8,954,858.82	-	-	-	8,954,858.82
存出保证金	946,488.52	-	-	-	946,488.52
交易性金融资产	-	-	-	1,961,501,503.44	1,961,501,503.44
应收利息	-	-	-	71,406.87	71,406.87
应收申购款	-	-	-	13,857,154.64	13,857,154.64
资产总计	155,099,384.23	-	-	1,975,430,064.95	2,130,529,449.18
负债					
应付证券清算款	-	-	-	21,606,036.31	21,606,036.31
应付赎回款	-	-	-	8,535,203.13	8,535,203.13
应付管理人报酬	-	-	-	839,054.00	839,054.00
应付托管费	-	-	-	167,810.79	167,810.79
应付销售服务费	-	-	-	22,154.29	22,154.29
应付交易费用	-	-	-	427,238.58	427,238.58
其他负债	-	-	-	499,568.08	499,568.08
负债总计	-	-	-	32,097,065.18	32,097,065.18
利率敏感度缺口	155,099,384.23	-	-	1,943,332,999.77	2,098,432,384.00
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	84,806,838.77	-	-	-	84,806,838.77
结算备付金	10,179,952.16	-	-	-	10,179,952.16
存出保证金	2,100,646.98	-	-	-	2,100,646.98
交易性金融资产	-	-	-	1,054,998,149.67	1,054,998,149.67
应收证券清算款	-	-	-	30,422.02	30,422.02
应收利息	-	-	-	43,366.36	43,366.36
应收申购款	-	-	-	20,488,919.65	20,488,919.65
资产总计	97,087,437.91	-	-	1,075,560,857.70	1,172,648,295.61
负债					
应付证券清算款	-	-	-	258,363.15	258,363.15
应付赎回款	-	-	-	40,421,388.65	40,421,388.65
应付管理人报酬	-	-	-	473,440.29	473,440.29
应付托管费	-	-	-	94,688.07	94,688.07
应付交易费用	-	-	-	223,991.63	223,991.63
其他负债	-	-	-	464,170.59	464,170.59
负债总计	-	-	-	41,936,042.38	41,936,042.38
利率敏感度缺口	97,087,437.91	-	-	1,033,624,815.32	1,130,712,253.23

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2018年12月31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)。

7.4.13.4.2 外汇风险

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

7.4.13.4.3 其他价格风险

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

本基金采用完全复制法进行指数化投资，股票资产跟踪的标的指数为沪深300指数，通过指数化分散投资降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括 VaR(Value at Risk) 指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2018年12月31日		上年度末 2017年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产—股票投资	1,961,501,503.44	93.47	1,054,998,149.67	93.30
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—债券投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产	-	-	-	-

一权证投资				
其他	-	-	-	-
合计	1,961,501,503.44	93.47	1,054,998,149.67	93.30

注：其他包含股指期货投资，于2018年12月31日，持仓数量为0手，合约市值为0.00(附注7.4.7.3)。在当日无负债结算制度下，结算准备金已包括所持股指期货投资产生的持仓损益，则其他中包含的股指期货与相关的期货暂收款(结算所得的持仓损益)之间按抵销后的净额为0。

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注7.4.1)以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位：人民币元)	
		本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
	业绩比较基准(附注7.4.1)上升5%	113,114,303.11	57,833,241.65
	业绩比较基准(附注7.4.1)下降5%	-113,114,303.11	-57,833,241.65

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2018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1,933,535,447.81元，属于第二层次的余额为26,432,810.35元，属于第三层次的余额为1,533,245.28元(2017年12月31日：第一层次1,034,003,507.79元，第二层次20,293,062.76元，第三层次701,579.12元)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金以导致各层次之间转换的事项发生日为确认各层次之间转换的时点。

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

(iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

于本期末，本基金持有公允价值归属于第三层次的金融工具余额为1,533,245.28元(2017年12月31日：701,579.12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	701,579.12	701,579.12
购买	-	-
出售	701,579.12	701,579.12
转入第三层级	1,320,147.36	1,320,147.36
转出第三层级	-	-
当期利得或损失总额	213,097.92	213,097.92
——计入损益的利得或损失	213,097.92	213,097.92
2018年12月31日	1,533,245.28	1,533,245.28
2018年12月31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(从转入第三 层级起算)——公允价值变动损益	213,097.92	213,097.92

计入损益的利得或损失分别计入利润表中的公允价值变动损益、投资收益等项目。

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：

	2018年12月 31日公允价 值	估值技 术	不可观察输 入值名称	范围/加权平均 值	与公允价 值之间的 关系
交易性金融资产 ——信威集团	1,533,245.28	市场法	市盈率	19.45	正相关

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2018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(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。

§ 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	1,961,501,503.44	92.07
	其中：股票	1,961,501,503.44	92.07
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	154,152,895.71	7.24
8	其他各项资产	14,875,050.03	0.70
9	合计	2,130,529,449.18	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）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	3,747,275.00	0.18
B	采矿业	72,191,099.86	3.44
C	制造业	766,035,663.90	36.51

D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	60,166,360.44	2.87
E	建筑业	76,997,083.80	3.67
F	批发和零售业	32,687,205.07	1.56
G	交通运输、仓储和邮政业	62,526,047.07	2.98
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	68,433,150.62	3.26
J	金融业	673,650,052.16	32.10
K	房地产业	93,771,668.54	4.47
L	租赁和商务服务业	24,383,065.30	1.16
M	科学研究和技术服务业	1,631,948.00	0.08
N	水利、环境和公共设施管理业	4,628,317.60	0.22
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	11,065,566.50	0.53
R	文化、体育和娱乐业	6,857,989.00	0.33
S	综合	-	-
	合计	1,958,772,492.86	93.34

8.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	1,599,284.78	0.08
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-

G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
J	金融业	50,145.80	0.00
K	房地产业	1,079,580.00	0.05
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,729,010.58	0.13

注：由于指数成份股调整，上表所列示股票中，新威集团（证券代码：600485）、中天金融（证券代码：000540）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所有股票投资明细

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	2,261,603	126,875,928.30	6.05
2	600519	贵州茅台	104,778	61,820,067.78	2.95
3	600036	招商银行	2,153,572	54,270,014.40	2.59
4	601166	兴业银行	2,602,700	38,884,338.00	1.85
5	000651	格力电器	1,004,976	35,867,593.44	1.71
6	000333	美的集团	967,712	35,669,864.32	1.70

7	601328	交通银行	5,734,436	33,202,384.44	1.58
8	600016	民生银行	5,182,135	29,693,633.55	1.42
9	600887	伊利股份	1,268,329	29,019,367.52	1.38
10	601288	农业银行	7,995,400	28,783,440.00	1.37
11	600030	中信证券	1,580,455	25,303,084.55	1.21
12	601668	中国建筑	4,380,720	24,970,104.00	1.19
13	600276	恒瑞医药	460,979	24,316,642.25	1.16
14	000002	万科A	1,015,638	24,192,497.16	1.15
15	600000	浦发银行	2,450,782	24,017,663.60	1.14
16	601398	工商银行	4,502,878	23,820,224.62	1.14
17	600900	长江电力	1,377,042	21,867,426.96	1.04
18	000858	五粮液	404,967	20,604,720.96	0.98
19	002415	海康威视	770,342	19,844,009.92	0.95
20	600104	上汽集团	732,930	19,547,243.10	0.93
21	601601	中国太保	656,085	18,652,496.55	0.89
22	601766	中国中车	2,030,077	18,311,294.54	0.87
23	600048	保利地产	1,489,483	17,561,004.57	0.84
24	601169	北京银行	3,088,936	17,328,930.96	0.83
25	000001	平安银行	1,791,920	16,808,209.60	0.80
26	601988	中国银行	4,399,200	15,881,112.00	0.76
27	600837	海通证券	1,689,063	14,863,754.40	0.71
28	601211	国泰君安	941,099	14,417,636.68	0.69
29	600028	中国石化	2,594,093	13,100,169.65	0.62
30	000725	京东方A	4,946,600	13,009,558.00	0.62
31	601229	上海银行	1,140,758	12,765,082.02	0.61
32	601818	光大银行	3,323,787	12,298,011.90	0.59
33	601888	中国国旅	203,600	12,256,720.00	0.58
34	600585	海螺水泥	417,800	12,233,184.00	0.58
35	601857	中国石油	1,689,502	12,181,309.42	0.58
36	600019	宝钢股份	1,858,532	12,080,458.00	0.58
37	002304	洋河股份	125,858	11,921,269.76	0.57

38	603288	海天味业	169,264	11,645,363.20	0.55
39	601688	华泰证券	681,660	11,042,892.00	0.53
40	601390	中国中铁	1,555,300	10,871,547.00	0.52
41	600690	青岛海尔	763,371	10,572,688.35	0.50
42	601186	中国铁建	959,900	10,434,113.00	0.50
43	601006	大秦铁路	1,241,096	10,214,220.08	0.49
44	600009	上海机场	200,872	10,196,262.72	0.49
45	600050	中国联通	1,942,700	10,043,759.00	0.48
46	600015	华夏银行	1,338,406	9,890,820.34	0.47
47	000063	中兴通讯	496,620	9,728,785.80	0.46
48	002594	比亚迪	189,285	9,653,535.00	0.46
49	600309	万华化学	342,351	9,582,404.49	0.46
50	600340	华夏幸福	376,047	9,570,396.15	0.46
51	600031	三一重工	1,139,300	9,501,762.00	0.45
52	300059	东方财富	754,909	9,134,398.90	0.44
53	601939	建设银行	1,402,962	8,936,867.94	0.43
54	002142	宁波银行	543,465	8,815,002.30	0.42
55	600919	江苏银行	1,445,600	8,630,232.00	0.41
56	001979	招商蛇口	494,940	8,587,209.00	0.41
57	601899	紫金矿业	2,525,834	8,436,285.56	0.40
58	601989	中国重工	1,909,492	8,115,341.00	0.39
59	002027	分众传媒	1,532,260	8,029,042.40	0.38
60	000538	云南白药	108,405	8,017,633.80	0.38
61	601009	南京银行	1,239,320	8,006,007.20	0.38
62	600999	招商证券	597,000	7,999,800.00	0.38
63	000776	广发证券	617,528	7,830,255.04	0.37
64	000338	潍柴动力	1,010,844	7,783,498.80	0.37
65	002024	苏宁易购	777,300	7,656,405.00	0.36
66	002230	科大讯飞	305,695	7,532,324.80	0.36
67	601088	中国神华	413,505	7,426,549.80	0.35
68	601336	新华保险	174,037	7,351,322.88	0.35

69	002475	立讯精密	515,222	7,244,021.32	0.35
70	601012	隆基股份	407,140	7,100,521.60	0.34
71	600406	国电南瑞	382,700	7,091,431.00	0.34
72	601628	中国人寿	347,423	7,083,954.97	0.34
73	600886	国投电力	849,728	6,840,310.40	0.33
74	600011	华能国际	918,000	6,774,840.00	0.32
75	600660	福耀玻璃	291,978	6,651,258.84	0.32
76	600795	国电电力	2,459,944	6,297,456.64	0.30
77	601933	永辉超市	798,925	6,287,539.75	0.30
78	000568	泸州老窖	152,775	6,211,831.50	0.30
79	601225	陕西煤业	834,200	6,206,448.00	0.30
80	601669	中国电建	1,276,556	6,204,062.16	0.30
81	600741	华域汽车	328,900	6,051,760.00	0.29
82	600958	东方证券	747,200	5,955,184.00	0.28
83	002044	美年健康	390,540	5,838,573.00	0.28
84	600703	三安光电	510,590	5,774,772.90	0.28
85	000166	申万宏源	1,410,827	5,742,065.89	0.27
86	600518	康美药业	622,500	5,733,225.00	0.27
87	600010	包钢股份	3,802,060	5,627,048.80	0.27
88	603993	洛阳钼业	1,474,100	5,542,616.00	0.26
89	000100	TCL 集团	2,262,189	5,542,363.05	0.26
90	601800	中国交建	489,814	5,515,305.64	0.26
91	600436	片仔癀	62,800	5,441,620.00	0.26
92	000069	华侨城 A	855,888	5,434,888.80	0.26
93	002008	大族激光	178,167	5,409,150.12	0.26
94	600570	恒生电子	103,738	5,392,301.24	0.26
95	600271	航天信息	232,582	5,323,801.98	0.25
96	600089	特变电工	775,055	5,262,623.45	0.25
97	600352	浙江龙盛	543,004	5,239,988.60	0.25
98	300015	爱尔眼科	198,745	5,226,993.50	0.25
99	601985	中国核电	974,300	5,134,561.00	0.24

100	000661	长春高新	28,500	4,987,500.00	0.24
101	300142	沃森生物	256,400	4,897,240.00	0.23
102	600196	复星医药	209,585	4,877,042.95	0.23
103	601600	中国铝业	1,371,900	4,870,245.00	0.23
104	000895	双汇发展	206,364	4,868,126.76	0.23
105	002202	金风科技	485,154	4,846,688.46	0.23
106	600029	南方航空	718,107	4,768,230.48	0.23
107	601111	中国国航	623,400	4,762,776.00	0.23
108	600487	亨通光电	277,960	4,739,218.00	0.23
109	600547	山东黄金	155,107	4,691,986.75	0.22
110	600606	绿地控股	761,700	4,653,987.00	0.22
111	300003	乐普医疗	222,900	4,638,549.00	0.22
112	601618	中国中冶	1,489,900	4,633,589.00	0.22
113	601901	方正证券	858,810	4,560,281.10	0.22
114	601377	兴业证券	978,243	4,539,047.52	0.22
115	600383	金地集团	471,267	4,533,588.54	0.22
116	600221	海航控股	2,399,900	4,511,812.00	0.22
117	601155	新城控股	188,576	4,467,365.44	0.21
118	600637	东方明珠	429,832	4,401,479.68	0.21
119	601877	正泰电器	179,302	4,346,280.48	0.21
120	002236	大华股份	375,600	4,304,376.00	0.21
121	002736	国信证券	513,229	4,295,726.73	0.20
122	600588	用友网络	199,803	4,255,803.90	0.20
123	600176	中国巨石	438,620	4,241,455.40	0.20
124	600100	同方股份	432,800	4,211,144.00	0.20
125	300124	汇川技术	208,462	4,198,424.68	0.20
126	600332	白云山	117,184	4,190,499.84	0.20
127	002466	天齐锂业	142,810	4,187,189.20	0.20
128	600522	中天科技	512,000	4,172,800.00	0.20
129	600498	烽火通信	146,300	4,165,161.00	0.20
130	000783	长江证券	807,285	4,157,517.75	0.20

131	600867	通化东宝	297,310	4,132,609.00	0.20
132	601607	上海医药	240,856	4,094,552.00	0.20
133	600893	航发动力	187,838	4,079,841.36	0.19
134	000963	华东医药	152,329	4,030,625.34	0.19
135	600023	浙能电力	851,600	4,028,068.00	0.19
136	600111	北方稀土	455,052	3,990,806.04	0.19
137	600705	中航资本	936,252	3,969,708.48	0.19
138	600115	东方航空	818,699	3,888,820.25	0.19
139	300122	智飞生物	100,000	3,876,000.00	0.18
140	000768	中航飞机	288,611	3,821,209.64	0.18
141	002311	海大集团	164,600	3,813,782.00	0.18
142	002007	华兰生物	116,240	3,812,672.00	0.18
143	000423	东阿阿胶	95,334	3,770,459.70	0.18
144	600177	雅戈尔	523,456	3,763,648.64	0.18
145	002714	牧原股份	130,340	3,747,275.00	0.18
146	600516	方大炭素	223,800	3,739,698.00	0.18
147	002422	科伦药业	180,000	3,717,000.00	0.18
148	300408	三环集团	217,600	3,681,792.00	0.18
149	600068	葛洲坝	576,700	3,644,744.00	0.17
150	002456	欧菲科技	396,487	3,643,715.53	0.17
151	601727	上海电气	735,700	3,634,358.00	0.17
152	600535	天士力	189,236	3,633,331.20	0.17
153	600109	国金证券	505,024	3,615,971.84	0.17
154	000413	东旭光电	800,400	3,601,800.00	0.17
155	002460	赣锋锂业	162,750	3,593,520.00	0.17
156	601788	光大证券	407,500	3,573,775.00	0.17
157	300136	信维通信	162,633	3,514,499.13	0.17
158	600018	上港集团	676,972	3,506,714.96	0.17
159	601998	中信银行	639,837	3,487,111.65	0.17
160	002450	康得新	442,936	3,384,031.04	0.16
161	601555	东吴证券	500,733	3,354,911.10	0.16

162	600438	通威股份	404,700	3,350,916.00	0.16
163	000157	中联重科	937,810	3,338,603.60	0.16
164	002352	顺丰控股	101,601	3,327,432.75	0.16
165	600482	中国动力	148,270	3,301,972.90	0.16
166	600066	宇通客车	276,902	3,281,288.70	0.16
167	300144	宋城演艺	151,500	3,234,525.00	0.15
168	600027	华电国际	679,900	3,229,525.00	0.15
169	601919	中远海控	796,742	3,218,837.68	0.15
170	000876	新希望	439,300	3,198,104.00	0.15
171	600674	川投能源	367,032	3,182,167.44	0.15
172	600398	海澜之家	374,800	3,178,304.00	0.15
173	600926	杭州银行	428,096	3,167,910.40	0.15
174	000425	徐工机械	980,500	3,167,015.00	0.15
175	600219	南山铝业	1,496,020	3,156,602.20	0.15
176	600085	同仁堂	114,301	3,143,277.50	0.15
177	603799	华友钴业	104,180	3,136,859.80	0.15
178	600489	中金黄金	359,902	3,087,959.16	0.15
179	300070	碧水源	394,632	3,078,129.60	0.15
180	601997	贵阳银行	288,000	3,075,840.00	0.15
181	300024	机器人	227,944	3,013,419.68	0.14
182	000728	国元证券	421,650	2,943,117.00	0.14
183	002146	荣盛发展	363,012	2,885,945.40	0.14
184	601138	工业富联	246,700	2,859,253.00	0.14
185	600362	江西铜业	216,524	2,849,455.84	0.14
186	002050	三花智控	222,100	2,818,449.00	0.13
187	600170	上海建工	928,890	2,814,536.70	0.13
188	002673	西部证券	365,104	2,800,347.68	0.13
189	002241	歌尔股份	405,902	2,792,605.76	0.13
190	002179	中航光电	82,700	2,785,336.00	0.13
191	000703	恒逸石化	240,985	2,776,147.20	0.13
192	601018	宁波港	824,400	2,753,496.00	0.13

193	601198	东兴证券	287,400	2,747,544.00	0.13
194	002065	东华软件	389,900	2,709,805.00	0.13
195	002001	新 和 成	179,000	2,686,790.00	0.13
196	002081	金 螳 螂	330,853	2,679,909.30	0.13
197	000625	长安汽车	406,600	2,679,494.00	0.13
198	600739	辽宁成大	254,900	2,666,254.00	0.13
199	002493	荣盛石化	262,200	2,645,598.00	0.13
200	600208	新湖中宝	896,600	2,600,140.00	0.12
201	000630	铜陵有色	1,317,400	2,595,278.00	0.12
202	000709	河钢股份	885,848	2,515,808.32	0.12
203	600153	建发股份	355,100	2,503,455.00	0.12
204	002558	巨人网络	126,483	2,449,975.71	0.12
205	300296	利亚德	318,200	2,446,958.00	0.12
206	601992	金隅集团	696,100	2,436,350.00	0.12
207	002271	东方雨虹	187,800	2,432,010.00	0.12
208	600760	中航沈飞	87,600	2,427,396.00	0.12
209	000786	北新建材	176,200	2,424,512.00	0.12
210	300072	三聚环保	245,190	2,412,669.60	0.11
211	300017	网宿科技	304,347	2,383,037.01	0.11
212	000503	国新健康	149,925	2,380,809.00	0.11
213	002797	第一创业	438,600	2,377,212.00	0.11
214	603858	步长制药	92,183	2,330,386.24	0.11
215	600038	中直股份	61,614	2,301,899.04	0.11
216	002624	完美世界	82,300	2,292,055.00	0.11
217	600688	上海石化	458,200	2,286,418.00	0.11
218	600566	济川药业	67,800	2,273,334.00	0.11
219	002572	索菲亚	135,200	2,264,600.00	0.11
220	600583	海油工程	460,942	2,258,615.80	0.11
221	601333	广深铁路	707,500	2,235,700.00	0.11
222	600977	中国电影	155,700	2,229,624.00	0.11
223	601117	中国化学	411,700	2,206,712.00	0.11

224	002252	上海莱士	273,841	2,193,466.41	0.10
225	600004	白云机场	215,800	2,168,790.00	0.10
226	000961	中南建设	384,800	2,158,728.00	0.10
227	600118	中国卫星	123,521	2,139,383.72	0.10
228	600549	厦门钨业	176,793	2,135,659.44	0.10
229	002085	万丰奥威	273,600	2,120,400.00	0.10
230	600346	恒力股份	158,300	2,097,475.00	0.10
231	603833	欧派家居	26,300	2,096,636.00	0.10
232	600297	广汇汽车	513,973	2,086,730.38	0.10
233	600369	西南证券	588,700	2,048,676.00	0.10
234	000792	盐湖股份	290,650	2,028,737.00	0.10
235	601878	浙商证券	278,100	2,019,006.00	0.10
236	002508	老板电器	99,300	2,004,867.00	0.10
237	600816	安信信托	456,594	1,995,315.78	0.10
238	601238	广汽集团	193,120	1,987,204.80	0.09
239	600415	小商品城	567,610	1,980,958.90	0.09
240	002602	世纪华通	95,720	1,976,618.00	0.09
241	000898	鞍钢股份	384,995	1,975,024.35	0.09
242	002310	东方园林	280,300	1,950,888.00	0.09
243	000839	中信国安	572,350	1,928,819.50	0.09
244	600809	山西汾酒	53,500	1,875,175.00	0.09
245	603986	兆易创新	29,700	1,850,904.00	0.09
246	601216	君正集团	704,000	1,844,480.00	0.09
247	601881	中国银河	269,100	1,835,262.00	0.09
248	601021	春秋航空	57,415	1,826,371.15	0.09
249	002294	信立泰	87,200	1,821,608.00	0.09
250	000983	西山煤电	328,600	1,804,014.00	0.09
251	002032	苏泊尔	34,000	1,785,000.00	0.09
252	600909	华安证券	377,700	1,782,744.00	0.08
253	601898	中煤能源	381,600	1,774,440.00	0.08
254	000671	阳光城	338,200	1,755,258.00	0.08

255	600157	永泰能源	1,295,948	1,736,570.32	0.08
256	002153	石基信息	66,828	1,734,854.88	0.08
257	000627	天茂集团	309,100	1,734,051.00	0.08
258	601360	三六零	85,000	1,731,450.00	0.08
259	300033	同花顺	44,910	1,715,562.00	0.08
260	600998	九州通	117,500	1,715,500.00	0.08
261	600704	物产中大	359,420	1,646,143.60	0.08
262	603259	药明康德	21,800	1,631,948.00	0.08
263	601991	大唐发电	517,100	1,628,865.00	0.08
264	600188	兖州煤业	184,930	1,623,685.40	0.08
265	000402	金融街	249,536	1,607,011.84	0.08
266	600061	国投资本	176,300	1,584,937.00	0.08
267	002601	龙蟠佰利	126,900	1,560,870.00	0.07
268	000826	启迪桑德	149,200	1,550,188.00	0.07
269	601228	广州港	387,500	1,534,500.00	0.07
270	603160	汇顶科技	19,109	1,503,878.30	0.07
271	600372	中航电子	110,097	1,429,059.06	0.07
272	601633	长城汽车	251,629	1,409,122.40	0.07
273	000408	藏格控股	124,800	1,400,256.00	0.07
274	300251	光线传媒	183,400	1,393,840.00	0.07
275	000415	渤海租赁	386,700	1,392,120.00	0.07
276	002411	延安必康	63,600	1,340,688.00	0.06
277	000938	紫光股份	42,398	1,325,361.48	0.06
278	600339	中油工程	349,400	1,268,322.00	0.06
279	002555	三七互娱	132,975	1,255,284.00	0.06
280	000959	首钢股份	330,500	1,232,765.00	0.06
281	600025	华能水电	375,600	1,183,140.00	0.06
282	601611	中国核建	164,100	1,071,573.00	0.05
283	300433	蓝思科技	164,396	1,070,217.96	0.05
284	601808	中海油服	123,200	1,052,128.00	0.05
285	002468	申通快递	63,600	1,046,220.00	0.05

286	002773	康弘药业	27,800	947,146.00	0.05
287	001965	招商公路	116,100	932,283.00	0.04
288	002625	光启技术	89,590	886,941.00	0.04
289	002120	韵达股份	28,600	866,580.00	0.04
290	002925	盈趣科技	19,400	851,272.00	0.04
291	601066	中信建投	93,500	814,385.00	0.04
292	600233	圆通速递	76,700	767,000.00	0.04
293	600390	五矿资本	109,000	758,640.00	0.04
294	601828	美凯龙	65,600	724,224.00	0.03
295	603260	合盛硅业	15,500	678,900.00	0.03
296	601838	成都银行	82,700	665,735.00	0.03
297	601108	财通证券	82,400	594,928.00	0.03
298	603156	养元饮品	12,700	528,066.00	0.03
299	601212	白银有色	174,300	514,185.00	0.02
300	000553	沙隆达A	51,900	473,847.00	0.02

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值（元）	占基金资产净值比例（%）
1	600485	信威集团	144,102	1,533,245.28	0.07
2	000540	中天金融	284,100	1,079,580.00	0.05
3	603185	上机数控	1,345	66,039.50	0.00
4	601860	紫金银行	15,970	50,145.80	0.00

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	125,848,856.57	11.13
2	600519	贵州茅台	62,154,097.76	5.50

3	600036	招商银行	56,422,717.96	4.99
4	601166	兴业银行	38,428,595.31	3.40
5	000333	美的集团	38,174,973.67	3.38
6	000651	格力电器	38,055,998.95	3.37
7	600016	民生银行	34,205,934.83	3.03
8	601328	交通银行	31,593,658.70	2.79
9	600887	伊利股份	29,963,968.03	2.65
10	600276	恒瑞医药	28,119,839.89	2.49
11	601288	农业银行	27,518,360.59	2.43
12	600000	浦发银行	24,650,774.38	2.18
13	601398	工商银行	24,377,739.16	2.16
14	000002	万科A	23,936,261.66	2.12
15	000858	五粮液	23,873,565.43	2.11
16	600030	中信证券	23,686,168.03	2.09
17	601668	中国建筑	23,307,296.18	2.06
18	002415	海康威视	22,807,309.24	2.02
19	600104	上汽集团	19,857,667.11	1.76
20	601601	中国太保	19,782,531.96	1.75

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	44,414,826.16	3.93
2	600036	招商银行	21,982,612.23	1.94
3	600519	贵州茅台	21,882,114.40	1.94
4	600016	民生银行	17,606,574.66	1.56
5	601166	兴业银行	15,237,084.87	1.35
6	000651	格力电器	13,338,975.43	1.18

7	601328	交通银行	12,423,006.00	1.10
8	600276	恒瑞医药	12,292,771.61	1.09
9	000333	美的集团	11,999,006.17	1.06
10	600585	海螺水泥	11,644,951.20	1.03
11	601288	农业银行	10,664,437.00	0.94
12	600887	伊利股份	10,642,994.24	0.94
13	600000	浦发银行	9,812,729.18	0.87
14	601398	工商银行	9,656,846.00	0.85
15	600030	中信证券	8,863,730.60	0.78
16	601668	中国建筑	8,818,260.37	0.78
17	002024	苏宁易购	8,512,563.82	0.75
18	000002	万科 A	8,449,289.42	0.75
19	000858	五粮液	8,075,332.00	0.71
20	002415	海康威视	8,022,582.92	0.71

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

单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	2,231,444,657.22
卖出股票收入（成交）总额	876,938,619.88

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

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

8.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值	公允价值变动	风险说明
-	-	-	-	-	-
公允价值变动总额合计(元)					-
股指期货投资本期收益(元)					-2,528,180.00
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-23,080.00

8.10.2 本基金投资股指期货的投资政策

本指数基金的股指期货买入套保主要为应对基金组合申购的资金未到位造成基金组合的股票仓位过低的风险，股指期货在买入时总持仓量采用双限制策略，一是限制基金组合中总的股指期货持仓量不能超过向中金所申请并获批的套保总量；二是限制基金组合持有的股指期货合约价值加上基金组合中其他有价证券市值占基金净资产的比例不能超过法规规定的上限。并在股指期货的交易过程中严格遵守基金合同的约束和中金所的规定。根据本基金的基金合同、投资范围、投资目标、投资策略以及对市场走势研判的基础上，结合基金日常的申购赎回情况，制定套期保值交易的合理期限。套期保值的期限一般不超过股指期货当前的最远到期日合约，即次季合约。按照交易月份相近的原则，综合考虑并动态跟踪不同到期日的期货合约的流动性、价差状况和展期风险等因素，选择合适月份的期货合约进行开仓和展期交易来实现远期套保的目的。另外对于交割月的股指期货，通常情况下，最晚在合约交割日进行平仓，尽量避免进行交割。在未来的股指期货交易过程中，本基金将严格遵守《证券投资基金参与股指期货交易指引》，以及中国金融期货交易所颁布的《中国金融期货交易所交易规则》、《中国金融期货交易所套期保值与套利交易管理办法》等相关规定，以套期保值为主要目的参与股指期货，严格控制交易中的各种风险。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

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

8.12.2 基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

8.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	946,488.52
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	71,406.87
5	应收申购款	13,857,154.64
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	14,875,050.03

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限情况。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分公允价值	占基金净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	600485	信威集团	1,533,245.2	0.07	重大资产重

			8		组
2	000540	中天金融	1,079,580.00	0.05	重大资产重组
3	601860	紫金银行	50,145.80	0.00	新股未上市

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

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
天弘沪深300A	1,995,366	1,055.91	102,594,964.69	4.87%	2,004,322,346.53	95.13%
天弘沪深300C	61,339	3,550.56	26,900,036.62	12.35%	190,887,986.68	87.65%
合计	2,056,705	1,130.31	129,495,001.31	5.57%	2,195,210,333.21	94.43%

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	天弘沪深300A	3,150,923.11	0.15%
	天弘沪深300C	419,498.59	0.19%
	合计	3,570,421.70	0.15%

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	天弘沪深300A	>100
	天弘沪深300C	0~10
	合计	>100
本基金基金经理持有本开放式基金	天弘沪深300A	0~10
	天弘沪深300C	0
	合计	0~10

9.4 发起式基金发起资金持有份额情况

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01月20日至2018年01月20日。截至本报告期末，发起资金持有份额为0份。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

	天弘沪深300A	天弘沪深300C
基金合同生效日(2015年01月20日)基金份额总额	10,229,970.03	-
本报告期期初基金份额总额	959,301,012.48	-
本报告期基金总申购份额	4,171,953,658.46	522,988,774.69
减：本报告期基金总赎回份额	3,024,337,359.72	305,200,751.39
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	2,106,917,311.22	217,788,023.30

注：总申购份额含转换转入份额；总赎回份额含转换转出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

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

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略没有改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金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 100,000.00 元。截至本报告期末，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）已为本基金提供审计服务 4 年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人、托管人及其高级管理人员没有发生受稽查或处罚的情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额的比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
东方财富证券	2	645,711,932.69	20.80%	278,495.93	20.80%	-
光大证券	2	1,257,498,018.33	40.51%	542,362.61	40.51%	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
华泰	1	417,719,040.64	13.46%	180,164.08	13.46%	-

证券						
天风 证券	1	110,599,592.14	3.56%	47,701.91	3.56%	-
兴业 证券	1	672,542,586.75	21.67%	290,068.96	21.67%	-
招商 证券	2	-	-	-	-	-

注：1、基金专用交易单元的选择标准为：该证券经营机构财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定；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：4个，其中包括光大证券上海交易单元2个，海通证券上海交易单元1个，天风证券深圳交易单元1个。

4、本基金报告期内停止租用交易单元：无。

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	天弘沪深300指数型发起式证券投资基金2017年第4季度报告	中国证监会指定媒介	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	中国证监会指定媒介	2018-02-06
4	天弘基金管理有限公司关于增聘天弘沪深300指数型发	中国证监会指定媒介	2018-02-12

	起式证券投资基金基金经理的公告		
5	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	中国证监会指定媒介	2018-03-02
6	天弘沪深300指数型发起式证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会指定媒介	2018-03-05
7	天弘沪深300指数型发起式证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会指定媒介	2018-03-05
8	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金在网上交易系统开展申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2018-03-13
9	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	中国证监会指定媒介	2018-03-15
10	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	中国证监会指定媒介	2018-03-24
11	天弘沪深300指数型发起式证券投资基金2017年年度报告	中国证监会指定媒介	2018-03-29
12	天弘沪深300指数型发起式证券投资基金2017年年度报告摘要	中国证监会指定媒介	2018-03-29

13	天弘沪深300指数型发起式证券投资基金基金合同	中国证监会指定媒介	2018-03-30
14	天弘沪深300指数型发起式证券投资基金托管协议	中国证监会指定媒介	2018-03-30
15	天弘基金管理有限公司关于天弘沪深300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	中国证监会指定媒介	2018-03-30
16	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	中国证监会指定媒介	2018-03-31
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	中国证监会指定媒介	2018-03-31
18	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	中国证监会指定媒介	2018-03-31
19	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其费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2018-03-31
20	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

21	天弘沪深300指数型发起式证券投资基金2018年第1季度报告	中国证监会指定媒介	2018-04-23
22	关于天弘沪深300指数型发起式证券投资基金增设C类基金份额并相应修订基金合同部分条款的公告	中国证监会指定媒介	2018-04-24
23	天弘沪深300指数型发起式证券投资基金基金合同	中国证监会指定媒介	2018-04-24
24	天弘沪深300指数型发起式证券投资基金托管协议	中国证监会指定媒介	2018-04-24
25	天弘基金管理有限公司关于天弘沪深300指数型发起式证券投资基金之C类基金份额开放日常申购、赎回、定期定额投资及转换业务的公告	中国证监会指定媒介	2018-04-24
26	天弘基金管理有限公司关于增加长江证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投及转换业务的公告	中国证监会指定媒介	2018-04-26
27	天弘基金管理有限公司关于天弘沪深300C、天弘中证500C增加销售机构并开通申购、赎回、定投及转换业务的公告	中国证监会指定媒介	2018-05-09
28	天弘基金管理有限公司关于天弘沪深300C、天弘中证500C增加销售机构并开通申购、赎回、定投及转换业务的公告	中国证监会指定媒介	2018-05-12
29	天弘基金管理有限公司关于增加和耕传承基金销售有限	中国证监会指定媒介	2018-05-12

	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		
30	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
31	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
32	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	中国证监会指定媒介	2018-06-08
33	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会指定媒介	2018-06-26
34	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	中国证监会指定媒介	2018-06-29
35	天弘基金管理有限公司旗下基金2018年6月30日基金资产净值公告	中国证监会指定媒介	2018-06-30
36	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金开展销售服务费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2018-07-03
37	天弘沪深300指数型发起式证券投资基金2018年第2季度报告	中国证监会指定媒介	2018-07-19
38	天弘基金管理有限公司关于增加平安证券股份有限公司	中国证监会指定媒介	2018-07-21

	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		
39	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	2018-07-30
40	天弘基金管理有限公司关于增加大连网金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	中国证监会指定媒介	2018-07-31
41	天弘基金管理有限公司关于增加广东顺德农村商业银行股份有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投及转换业务的公告	中国证监会指定媒介	2018-08-22
42	天弘沪深300指数型发起式证券投资基金2018年半年度报告	中国证监会指定媒介	2018-08-27
43	天弘沪深300指数型发起式证券投资基金2018年半年度报告摘要	中国证监会指定媒介	2018-08-27
44	天弘基金管理有限公司关于增加中国银行股份有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投及转换业务的公告	中国证监会指定媒介	2018-08-29
45	天弘沪深300指数型发起式证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会指定媒介	2018-08-31
46	天弘沪深300指数型发起式	中国证监会指定媒介	2018-08-31

	证券投资基金招募说明书 (更新) 摘要		
47	天弘基金管理有限公司关于增加中山证券有限责任公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投及转换业务以及参加其费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2018-09-03
48	天弘基金管理有限公司关于参加中国银行股份有限公司申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2018-09-04
49	天弘基金管理有限公司关于增加广发证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投及转换业务以及参加其费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2018-09-05
50	天弘基金管理有限公司关于增加中国农业银行股份有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投及转换业务以及参加其费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2018-09-10
51	天弘基金管理有限公司关于旗下基金在网上直销交易系统的指定支付渠道开展申购补差费优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2018-09-11
52	天弘基金管理有限公司关于增加平安银行股份有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投及转换业务的公告	中国证监会指定媒介	2018-09-17
53	天弘基金管理有限公司关于增加大同证券有限责任公司	中国证监会指定媒介	2018-09-20

	为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投及转换业务的公告		
54	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	2018-09-28
55	天弘基金管理有限公司关于增加中天证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投及转换业务的公告	中国证监会指定媒介	2018-09-28
56	天弘基金管理有限公司关于在网上交易系统指定支付渠道开展交易费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2018-09-29
57	天弘基金管理有限公司关于增加万联证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回及定投业务以及参加其费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2018-10-11
58	天弘基金管理有限公司关于增加安信证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投及转换业务以及参加其费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2018-10-17
59	天弘基金管理有限公司关于增加长城证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投及转换业务的公告	中国证监会指定媒介	2018-10-22
60	天弘沪深300指数型发起式	中国证监会指定媒介	2018-10-24

	证券投资基金2018年第3季度报告		
61	天弘基金管理有限公司关于增加信达证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投及转换业务以及参加其费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2018-11-06
62	天弘基金管理有限公司关于增加民生证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投及转换业务以及参加其费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2018-11-16
63	天弘基金管理有限公司关于增加中信建投证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投及转换业务以及参加其费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2018-11-20
64	天弘基金管理有限公司关于增加阳光人寿保险股份有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投及转换业务以及参加其费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2018-11-21
65	天弘基金管理有限公司关于增加嘉兴银行股份有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投及转换业务的公告	中国证监会指定媒介	2018-11-26
66	天弘基金管理有限公司关于增加江西银行股份有限公司为旗下部分基金销售机构并	中国证监会指定媒介	2018-11-27

	开通申购、赎回、定投及转换业务的公告		
67	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	2018-11-30
68	天弘基金管理有限公司关于在网上交易系统指定支付渠道开展交易费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2018-11-30
69	天弘基金管理有限公司关于增加珠海华润银行股份有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投及转换业务的公告	中国证监会指定媒介	2018-12-03
70	天弘基金管理有限公司关于增加新时代证券股份有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购及赎回业务的公告	中国证监会指定媒介	2018-12-21
71	天弘基金管理有限公司关于增加天津农村商业银行股份有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回及定投业务的公告	中国证监会指定媒介	2018-12-26
72	天弘基金管理有限公司关于增加长沙银行股份有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投及转换业务以及参加其费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2018-12-26
73	天弘基金管理有限公司关于增加兴业银行股份有限公司为旗下部分基金销售机构并	中国证监会指定媒介	2018-12-28

	开通申购、赎回业务以及参加其费率优惠活动的公告		
74	天弘基金管理有限公司旗下基金2018年12月28日基金资产净值公告	中国证监会指定媒介	2018-12-28
75	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金参加中国农业银行股份有限公司申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2018-12-29
76	天弘基金管理有限公司旗下基金2018年12月31日基金资产净值公告	中国证监会指定媒介	2018-12-31

§ 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

本报告期内，本基金未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过本基金总份额20%的情况。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金增设C类基金份额并相应修订基金合同部分条款，具体信息请参见基金管理人于2018年4月24日在指定媒介披露的《关于天弘沪深300指数型发起式证券投资基金增设C类基金份额并相应修订基金合同部分条款的公告》及相应更新后的基金法律文件。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准天弘沪深300指数型发起式证券投资基金募集的文件
- 2、天弘沪深300指数型发起式证券投资基金基金合同
- 3、天弘沪深300指数型发起式证券投资基金托管协议
- 4、天弘沪深300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

13.2 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

13.3 查阅方式

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

公司网站：www.thfund.com.cn

天弘基金管理有限公司
二〇一九年三月二十七日