

天弘中证500指数增强型证券投资基金
(原天弘量化驱动股票型证券投资基金转型)

2019年第3季度报告

2019年09月30日

基金管理人:天弘基金管理有限公司

基金托管人:招商证券股份有限公司

报告送出日期:2019年10月25日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告中财务资料未经审计。

2019年08月12日天弘量化驱动股票型证券投资基金正式更名为“天弘中证500指数增强型证券投资基金”。原天弘量化驱动股票型证券投资基金本报告期自2019年07月01日起至2019年08月11日止，天弘中证500指数增强型证券投资基金本报告期自2019年08月12日起至2019年09月30日止。

§ 2 基金产品概况

转型后

基金简称	天弘中证500指数增强
基金主代码	001556
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2019年08月12日
报告期末基金份额总额	101,085,046.34份
投资目标	本基金为股票型指数增强基金，在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，力争获取高于标的指数的投资收益。
投资策略	本基金采用指数增强型投资策略，以中证500指数作为基金投资组合的标的指数，结合深入的宏观面、基本面研究及数量化投资技术，在指数化投资基础上优化调整投资组合，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，年跟踪误差不超过7.75%，以实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。
业绩比较基准	中证500指数收益率×95%+银行活期存款税后利率

	×5%	
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。	
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	
下属分级基金的基金简称	天弘中证500指数增强A	天弘中证500指数增强C
下属分级基金的交易代码	001556	001557
报告期末下属分级基金的份额总额	28,813,605.85份	72,271,440.49份

转型前

基金简称	天弘量化驱动股票	
基金主代码	001556	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年01月18日	
报告期末基金份额总额	53,550,746.13份	
投资目标	本基金采用量化投资策略构建投资组合，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。	
投资策略	本基金采用量化投资策略构建投资组合，利用数量化投资信息反应速度快、投资覆盖范围广、风险水平可控性强、投资纪律执行力高等优势，以自上而下的资产配置策略和自下而上的个股选择的组合构建方式，在控制整体风险的基础上追求组合收益的最大化。	
业绩比较基准	中证500指数收益率×85%+中证综合债券指数收益率×15%	
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于较高风险、较高收益预期的基金品种，其风险收益预期高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。	
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	
下属分级基金的基金简称	天弘量化驱动股票A	天弘量化驱动股票C
下属分级基金的交易代码	001556	001557
报告期末下属分级基金的份额总	14,408,757.35份	39,141,988.78份

额		
---	--	--

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标(转型后)

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2019年08月12日 - 2019年09月30日)	
	天弘中证500指数增强 A	天弘中证500指数增强 C
1. 本期已实现收益	462, 443. 74	891, 046. 60
2. 本期利润	498, 113. 10	2, 065, 310. 37
3. 加权平均基金份额本期利润	0. 0257	0. 0491
4. 期末基金资产净值	22, 492, 462. 76	55, 642, 184. 32
5. 期末基金份额净值	0. 7806	0. 7699

注：1、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。

2、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。

3、天弘量化驱动股票型证券投资基金自2019年08月12日转型为天弘中证500指数增强型证券投资基金。天弘中证500指数增强型证券投资基金基金合同于2019年08月12日生效。

3.1 主要财务指标(转型前)

单位：人民币元

主要财务指标	报告期(2019年07月01日 - 2019年08月11日)	
	天弘量化驱动股票A	天弘量化驱动股票C
1. 本期已实现收益	100, 008. 21	186, 916. 33
2. 本期利润	-517, 388. 60	-1, 473, 961. 62
3. 加权平均基金份额本期利润	-0. 0361	-0. 0428
4. 期末基金资产净值	10, 353, 687. 83	27, 751, 182. 55
5. 期末基金份额净值	0. 7186	0. 7090

注：1、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。

2、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。

3、天弘量化驱动股票型证券投资基金基金合同于2018年01月18日生效。

3.2 基金净值表现(转型后)

3.2.1 本报告期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

天弘中证500指数增强A净值表现

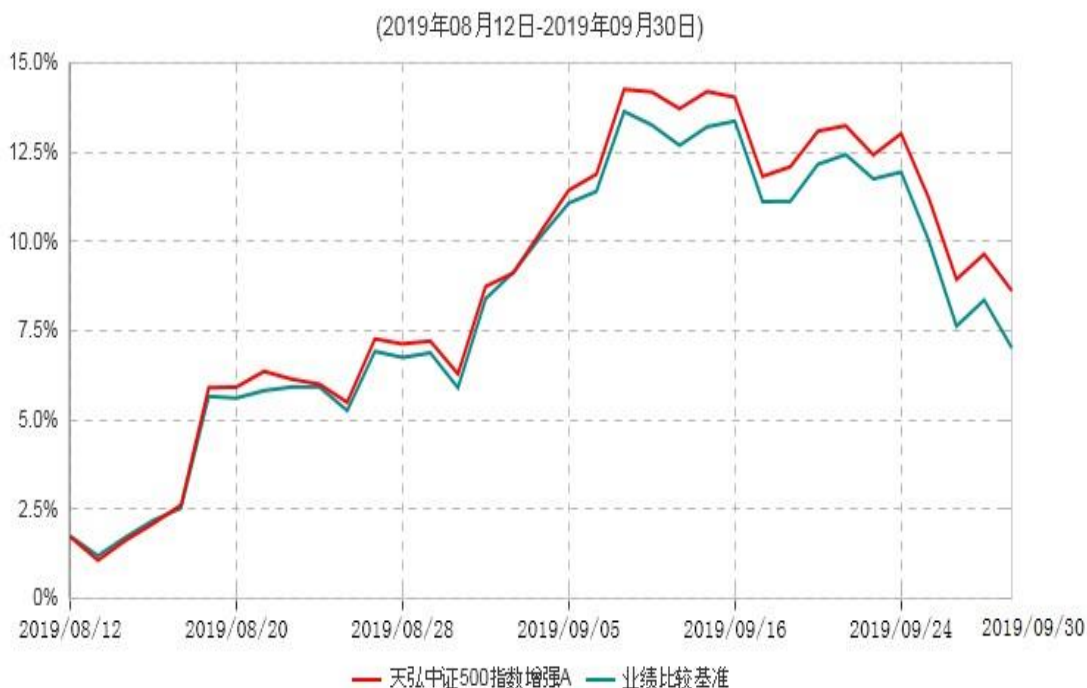
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月(2019年08月12日至2019年09月30日)	8.63%	1.12%	7.03%	1.13%	1.60%	-0.01%

天弘中证500指数增强C净值表现

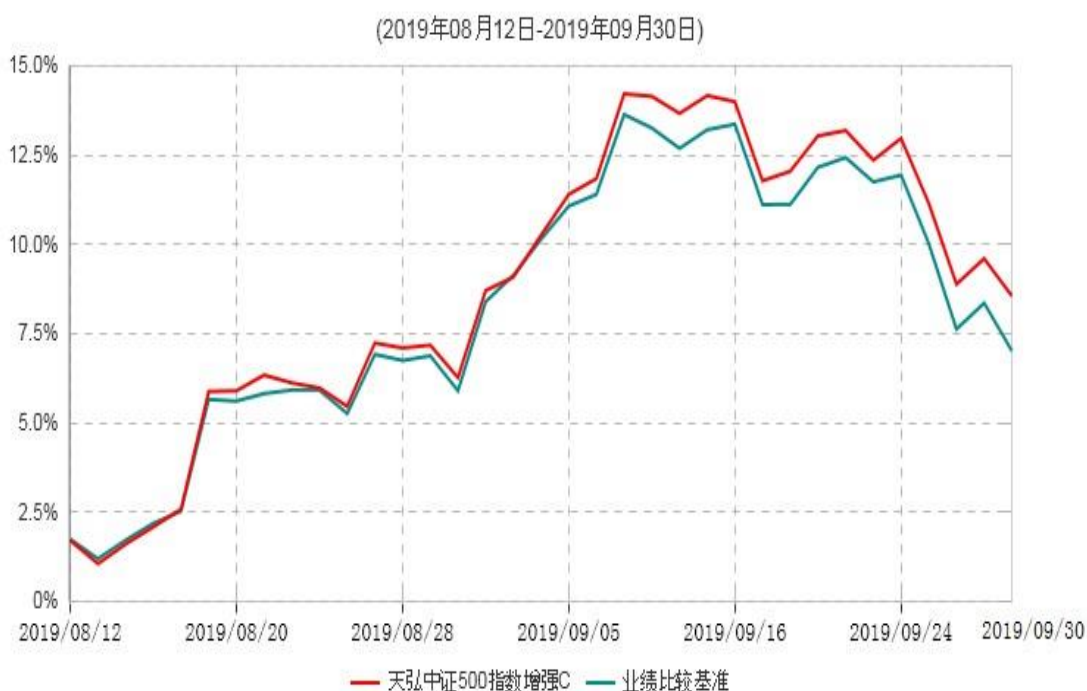
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月(2019年08月12日至2019年09月30日)	8.59%	1.12%	7.03%	1.13%	1.56%	-0.01%

3.2.2 自基金转型以来基金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

天弘中证500指数增强A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



天弘中证500指数增强C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



注：1、本基金于 2019 年 08 月 12 日由天弘量化驱动股票型证券投资基金转型而成，名称变更为“天弘中证 500 指数增强型证券投资基金”，自本基金转型起至披露时点不满一年。

2、按照本基金合同的约定，基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。本基金的建仓期为 2019 年 08 月 12 日至 2020 年 02 月 11 日，截止本报告期末本基金仍处于建仓期。

3.2 基金净值表现(转型前)

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

天弘量化驱动股票A净值表现

阶段	净值增长率①	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(2019年07月01日至2019年08月11日)	-4.80%	1.14%	-5.87%	1.02%	1.07%	0.12%

天弘量化驱动股票C净值表现

阶段	净值增长率①	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(2019年07月01日至2019年08月11日)	-4.83%	1.14%	-5.87%	1.02%	1.04%	0.12%

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

天弘量化驱动股票A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2015年06月30日-2019年08月11日)



天弘量化驱动股票C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2015年06月30日-2019年08月11日)



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

2、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 基金经理（或基金经理小组）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		
杨超	本基金基金经理；指数与数量投资部副总经理。	2019年08月	-	9年	男，金融数学与计算硕士学位。历任建信基金管理有限责任公司基金经理助理，泰达宏利基金管理有限公司基金经理。2019年1月加盟本公司。
张子法	本基金基金经理。	2018年01	2019年08	17年	男，软件工程硕士。历任华夏基金管理有限公司金

		月	月		融工程师量化研究员。2014年3月加盟本公司, 历任股票研究员、基金经理助理。
沙川	本基金基金经理。	2018年01月	2019年08月	9年	男, 数学硕士。历任中国中投证券有限责任公司量化分析师。2013年9月加盟本公司, 历任金融工程研究员。

- 注：1、基金经理任职日期为转型后基金合同生效日期。
 2、基金经理离任日期为本基金管理人对外披露的离任日期。
 3、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作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。

4.3 公平交易专项说明

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

在本报告期内，产品成功转型，明确了产品的业绩比较基准后以量化增强策略逐步开始运作。从市场结构看，在经济下行的中后期且没有明显企业盈利拐点的时点，叠加流动性边际上的宽松和对科技创新的渴求，市场给予科技类公司较高的估值，表现抢眼；同时也观察到以消费为代表的盈利模式可预期的行业依然受到市场偏好。中盘制造业公司相对受到市场冷落。本产品在运作期间恪守基金合同，通过构建基本面和统计风险模型，剥离市场系统性回报，在严格控制组合相对于业绩比较基准的行业，风格主动偏离的情况下，通过深入的基本面研究和逻辑延展，积极优化组合，持续朝向优质公司进行超配，同时结合市场运行的特定宏观和利率窗口，优化风险结构积极平衡组合在各项风险因子上的暴露，保护 Alpha 策略。力争为投资者提供相较于业绩比较基准持续且稳健的 Alpha 收益源。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2019年09月30日（2019年08月12日至2019年09月30日），天弘中证500指数增强A基金份额净值为0.7806元，天弘中证500指数增强C基金份额净值为0.7699元。报告期内份额净值增长率天弘中证500指数增强A为8.63%，天弘中证500指数增强C为8.59%，同期业绩比较基准增长率均为7.03%。

截至2019年08月11日（2019年07月01日至2019年08月11日），天弘量化驱动股票A基金份额净值为0.7186元，天弘量化驱动股票C基金份额净值为0.7090元。报告期内份额净值增长率天弘量化驱动股票A为-4.80%，天弘量化驱动股票C为-4.83%，同期业绩比较基准增长率均为-5.87%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

自2018年11月27日至2019年8月11日，本基金已连续60个工作日基金资产净值低于5000万元，基金管理人已按照基金合同约定向中国证监会报告并提出解决方案。本报告期内，本基金已成功转型为天弘中证500指数增强型证券投资基金，具体信息请参见基金管理人于2019年8月12日披露的《天弘基金管理有限公司关于天弘量化驱动股票型证券投资基金基金份额持有人大会决议生效的公告》。

§ 5 投资组合报告(转型后)

转型后：天弘中证 500 指数增强型证券投资基金

报告期（2019 年 8 月 12 日-2019 年 9 月 30 日）

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	73,797,234.34	79.50
	其中：股票	73,797,234.34	79.50
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	18,631,058.04	20.07
8	其他资产	404,017.01	0.44
9	合计	92,832,309.39	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 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	1,339,038.00	1.71
B	采矿业	2,960,537.00	3.79
C	制造业	36,520,247.08	46.74
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	1,199,227.00	1.53
E	建筑业	447,043.00	0.57
F	批发和零售业	4,361,761.10	5.58
G	交通运输、仓储和邮政业	1,864,265.00	2.39
H	住宿和餐饮业	182,885.00	0.23
I	信息传输、软件和信息技术	5,987,640.00	7.66

	术服务业		
J	金融业	2,754,743.00	3.53
K	房地产业	2,970,539.00	3.80
L	租赁和商务服务业	193,977.00	0.25
M	科学研究和技术服务业	113,850.00	0.15
N	水利、环境和公共设施管理业	431,832.00	0.55
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	1,073,820.00	1.37
Q	卫生和社会工作	46,569.00	0.06
R	文化、体育和娱乐业	1,306,863.00	1.67
S	综合	816,732.00	1.05
	合计	64,571,568.18	82.64

5.2.2 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	480,284.00	0.61
B	采矿业	156,738.00	0.20
C	制造业	4,968,985.40	6.36
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	920,272.00	1.18
E	建筑业	662,417.00	0.85
F	批发和零售业	167,440.00	0.21
G	交通运输、仓储和邮政业	1,126,216.00	1.44
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	533,513.56	0.68
J	金融业	117,331.32	0.15
K	房地产业	81,086.88	0.10
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	11,382.00	0.01

0	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	9,225,666.16	11.81

注：由于指数成份股调整，上表所列示股票中，深深房 A（证券代码:000029）被调出成份股后停牌，故以积极投资股票列示（下同）。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

5.3.1 报告期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

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	000513	丽珠集团	52,250	1,386,715.00	1.77
2	600909	华安证券	222,300	1,369,368.00	1.75
3	000878	云南铜业	134,200	1,347,368.00	1.72
4	002299	圣农发展	54,300	1,339,038.00	1.71
5	600216	浙江医药	116,500	1,333,925.00	1.71
6	000301	东方盛虹	253,300	1,301,962.00	1.67
7	002463	沪电股份	52,900	1,296,050.00	1.66
8	002028	思源电气	115,300	1,277,524.00	1.64
9	000401	冀东水泥	81,400	1,247,862.00	1.60
10	600779	水井坊	27,500	1,246,300.00	1.60

5.3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	期末公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	601919	中远海控	236,600	1,126,216.00	1.44
2	600868	梅雁吉祥	272,000	919,360.00	1.18
3	603160	汇顶科技	4,100	833,940.00	1.07
4	000157	中联重科	133,000	758,100.00	0.97
5	600846	同济科技	83,700	657,882.00	0.84

5.4 报告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。

5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 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。

5.10 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	30,126.59
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,445.42
5	应收申购款	371,445.00
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	404,017.01

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 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。

5.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票不存在流通受限情况。

5.11.6 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。

§ 5 投资组合报告（转型前）

转型前：天弘量化驱动股票型证券投资基金

报告期（2019年7月1日-2019年8月11日）

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	35,805,843.04	93.49
	其中：股票	35,805,843.04	93.49
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	2,397,752.08	6.26
8	其他资产	94,088.21	0.25
9	合计	38,297,683.33	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	1,004,266.00	2.64
B	采矿业	1,579,888.00	4.15
C	制造业	19,572,855.41	51.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	754,296.00	1.98
E	建筑业	746,157.00	1.96
F	批发和零售业	1,428,772.15	3.75
G	交通运输、仓储和邮政业	1,428,614.00	3.75
H	住宿和餐饮业	241,116.00	0.63
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,815,038.00	7.39
J	金融业	1,617,928.00	4.25
K	房地产业	1,963,106.48	5.15
L	租赁和商务服务业	652,455.00	1.71
M	科学研究和技术服务业	117,810.00	0.31
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	708,560.00	1.86
Q	卫生和社会工作	117,676.00	0.31
R	文化、体育和娱乐业	361,083.00	0.95
S	综合	696,222.00	1.83
	合计	35,805,843.04	93.97

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002195	二三四五	235,700	773,096.00	2.03
2	600699	均胜电子	53,600	752,008.00	1.97
3	002607	中公教育	52,100	708,560.00	1.86
4	600169	太原重工	288,100	677,035.00	1.78
5	601958	金钼股份	98,500	666,845.00	1.75

6	000301	东方盛虹	132,900	663,171.00	1.74
7	002051	中工国际	65,400	659,886.00	1.73
8	000031	大悦城	101,600	655,320.00	1.72
9	002414	高德红外	36,950	645,147.00	1.69
10	600312	平高电气	88,800	623,376.00	1.64

5.4 报告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。

5.5 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债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 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。

5.10 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	29,968.78

2	应收证券清算款	20,366.36
3	应收股利	-
4	应收利息	5,704.33
5	应收申购款	38,048.74
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	94,088.21

5.11.4 报告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。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

5.11.6 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。

§ 6 开放式基金份额变动(转型后)

单位：份

	天弘中证500指数增强A	天弘中证500指数增强C
基金合同生效日(2019年08月12日)基金份额总额	14,408,757.35	39,141,988.78
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	16,651,782.90	43,031,164.71
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	2,246,934.40	9,901,713.00
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列）	-	-
报告期期末基金份额总额	28,813,605.85	72,271,440.49

注：1、本报告期内，基金管理人根据法律法规及《基金合同》相关规定以通讯方式召开基金份额持有人大会，大会审议通过《关于天弘量化驱动股票型证券投资基金转型有关事项的议案》，自2019年08月12日起，天弘量化驱动股票型证券投资基金正式转型为天弘中证500指数增强型证券投资基金。

2、总申购份额含红利再投、转换转入份额；总赎回份额含转换转出份额。

§ 6 开放式基金份额变动(转型前)

单位：份

	天弘量化驱动股票A	天弘量化驱动股票C
报告期期初基金份额总额	14,404,514.20	26,600,882.03
报告期期间基金总申购份额	734,910.89	16,430,035.37
减：报告期期间基金总赎回份额	730,667.74	3,888,928.62
报告期期间基金拆分变动份额 (份额减少以“-”填列)	-	-
报告期期末基金份额总额	14,408,757.35	39,141,988.78

注：总申购份额含红利再投、转换转入份额；总赎回份额含转换转出份额。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况(转型后)

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

	天弘中证500指数增强 A	天弘中证500指数增强 C
基金合同生效日(2019年08月12日) 管理人持有的本基金份额	5,000,000.00	5,000,000.00
基金合同生效日起至报告期期末买 入/申购总份额	-	-
基金合同生效日起至报告期期末卖 出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份 额	5,000,000.00	5,000,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基 金总份额比例(%)	17.35	6.92

注：1、本报告期内，基金管理人根据法律法规及《基金合同》相关规定以通讯方式召开基金份额持有人大会，大会审议通过《关于天弘量化驱动股票型证券投资基金转型有关事项的议案》，自2019年08月12日起，天弘量化驱动股票型证券投资基金正式转型为天弘中证500指数增强型证券投资基金。

2、报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例，比例的分母分别采用A、C类各自级别的份额总额计算。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况(转型前)

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位：份

	天弘量化驱动股票A	天弘量化驱动股票C
报告期期初管理人持有的本基金份额	5,000,000.00	5,000,000.00
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	5,000,000.00	5,000,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例（%）	34.70	12.77

注：报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例，比例的分母分别采用A、C类各自级别的份额总额计算。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§ 8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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	20190701-20190717	10,000,000.00	-	-	10,000,000.00	9.89%
	2	20190701-20190911	13,294,336.61	-	-	13,294,336.61	13.15%
	3	20190927-20190930	-	27,688,868.39	-	27,688,868.39	27.39%
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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

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

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金募集的文件
- 2、天弘中证500指数增强型证券投资基金基金合同
- 3、天弘中证500指数增强型证券投资基金托管协议
- 4、天弘中证500指数增强型证券投资基金招募说明书
- 5、报告期内在指定报刊上披露的各项公告
- 6、中国证监会规定的其他文件

9.2 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

9.3 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
二〇一九年十月二十五日