

天弘中证 500 指数型发起式证券投资基金

2020 年中期报告

2020 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:国泰君安证券股份有限公司

送出日期:2020 年 08 月 31 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。本中期报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

基金托管人国泰君安证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2020年08月27日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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2020年01月01日起至2020年06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	10
4.1 基金管理人及基金经理情况	10
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	12
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	13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	14
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
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	15
§5 托管人报告	15
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	15
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	15
5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	15
§6 中期财务会计报告(未经审计)	15
6.1 资产负债表	15
6.2 利润表	17
6.3 所有者权益(基金净值)变动表	19
6.4 报表附注	20
§7 投资组合报告	46
7.1 期末基金资产组合情况	46
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	47
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	49
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	66
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	68
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	68
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	68
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	68
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	68
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	68
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	69
7.12 投资组合报告附注	69
§8 基金份额持有人信息	70
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	70
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	71

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	71
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	71
§9 开放式基金份额变动	72
§10 重大事件揭示	72
10.1 基金份额持有人大会决议	72
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	72
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	72
10.4 基金投资策略的改变	72
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	72
10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	72
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	73
10.8 其他重大事件	75
§11 影响投资者决策的其他重要信息	77
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	77
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	77
§12 备查文件目录	77
12.1 备查文件目录	77
12.2 存放地点	77
12.3 查阅方式	77

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	天弘中证500指数型发起式证券投资基金	
基金简称	天弘中证500	
基金主代码	000962	
基金运作方式	契约型开放式、发起式	
基金合同生效日	2015年01月20日	
基金管理人	天弘基金管理有限公司	
基金托管人	国泰君安证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	2,327,855,929.74份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	天弘中证500A	天弘中证500C
下属分级基金的交易代码	000962	005919
报告期末下属分级基金的份额总额	1,564,293,035.75份	763,562,893.99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500指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

名称	天弘基金管理有限公司	国泰君安证券股份有限公司	
信息披露负责人	姓名	童建林	王健
	联系电话	022-83310208	021-38676252
	电子邮箱	service@thfund.com.cn	wangj222@gtjas.com
客户服务电话	95046	021-38917599-5	
传真	022-83865569	021-38677819	
注册地址	天津自贸区(中心商务区)响螺湾旷世国际大厦A座1704-241号	中国(上海)自由贸易试验区商城路618号	
办公地址	天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层	上海市静安区新闻路669号博华广场19楼	
邮政编码	300203	200041	
法定代表人	胡晓明	贺青	

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	证券日报
登载基金中期报告正文的管理人互联网网址	www.thfund.com.cn
基金中期报告备置地点	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

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2020年01月01日-2020年06月30日)
---------------	------------------------------

	天弘中证500A	天弘中证500C
本期已实现收益	110,355,115.21	58,015,061.67
本期利润	196,819,214.38	102,460,738.26
加权平均基金份额本期利润	0.1139	0.1093
本期加权平均净值利润率	12.15%	11.43%
本期基金份额净值增长率	12.14%	12.01%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2020年06月30日)	
期末可供分配利润	-505,127,416.83	-6,545,507.91
期末可供分配基金份额利润	-0.3229	-0.0086
期末基金资产净值	1,592,235,047.30	793,068,744.25
期末基金份额净值	1.0179	1.0386
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2020年06月30日)	
基金份额累计净值增长率	1.79%	3.86%

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

天弘中证500A

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

过去一个月	8.90%	0.84%	8.04%	0.84%	0.86%	0.00%
过去三个月	16.81%	1.08%	15.47%	1.08%	1.34%	0.00%
过去六个月	12.14%	1.70%	10.84%	1.70%	1.30%	0.00%
过去一年	20.42%	1.38%	17.63%	1.39%	2.79%	-0.01%
过去三年	1.87%	1.38%	-3.82%	1.39%	5.69%	-0.01%
自基金合同 生效日起至 今	1.79%	1.77%	11.77%	1.74%	-9.98%	0.03%

天弘中证500C

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
过去一个月	8.88%	0.84%	8.04%	0.84%	0.84%	0.00%
过去三个月	16.75%	1.07%	15.47%	1.08%	1.28%	-0.01%
过去六个月	12.01%	1.70%	10.84%	1.70%	1.17%	0.00%
过去一年	20.17%	1.38%	17.63%	1.39%	2.54%	-0.01%
自基金份额 首次确认日 起至今	3.86%	1.48%	-1.13%	1.49%	4.99%	-0.01%

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

天弘中证500A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-2020年06月30日)



天弘中证500C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-2020年06月30日)



注：1、本基金合同于2015年01月20日生效。

2、本报告期内，本基金的各项投资比例达到基金合同约定的各项比例要求。

3、本基金自2018年04月24日起增设天弘中证500C基金份额。天弘中证500C基金份额的首次确认日为2018年04月25日。

§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
蚂蚁科技集团股份有限公司	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%

注：2020年7月22日，公司披露了《天弘基金管理有限公司关于股东名称变更的公告》。

截至2020年6月30日，本基金管理人共管理74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、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交易型开放式指数证券投资基金联接基金、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、天弘中证医药100指数型发起式证券投资基金、天弘中证500指数增强型证券投资基金、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、天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金联接基

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、天弘中证电子交易型开放式指数证券投资基金联接基金（原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交易型开放式指数证券投资基金联接基金（原天弘中证计算机主题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、天弘穗利一年定期开放债券型证券投资基金、天弘弘丰增强回报债券型证券投资基金、天弘港股通精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、天弘增强回报债券型证券投资基金、天弘安益债券型证券投资基金、天弘华享三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、天弘弘择短债债券型证券投资基金、天弘信益债券型证券投资基金、天弘养老目标日期2035三年持有期混合型发起式基金中基金（FOF）、天弘弘新混合型发起式证券投资基金、天弘创业板交易型开放式指数证券投资基金、天弘标普500发起式证券投资基金（QDII-FOF）、天弘优质成长企业精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、天弘鑫利三年定期开放债券型证券投资基金、天弘沪深300交易型开放式指数证券投资基金、天弘中证红利低波动100指数型发起式证券投资基金、天弘季季兴三个月定期开放债券型发起式证券投资基金、天弘中证全指证券公司指数型发起式证券投资基金、天弘沪深300指数增强型发起式证券投资基金、天弘越南市场股票型发起式证券投资基金（QDII）、天弘中证电子交易型开放式指数证券投资基金、天弘中证计算机主题交易型开放式指数证券投资基金、天弘增利短债债券型发起式证券投资基金、天弘恒享一年定期开放债券型发起式证券投资基金、天弘纯享一年定期开放债券型发起式证券投资基金、天弘中债1-3年国开行债券指数发起式证券投资基金、天弘永裕稳健养老目标一年持有期混合型基金中基金（FOF）、天弘兴享一年定期开放债券型发起式证券投资基金、天弘中证中美互联网指数型发起式证券投资基金（QDII）、天弘中债3-5年政策性金融债指数发起式证券投资基金、天弘成享一年定期开放债券型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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

张子法	本基金基金经理。	2017年04月	-	13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	-	9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。
杨超	本基金基金经理；指数与数量投资部副总经理和智能投资部副总经理。	2019年06月	-	10年	男，金融数学与计算硕士。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。

注：1、上述任职日期/离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

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

本基金本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的交易次数为19次，投资组合经理因投资组合的投资策略而发生同日反向交易，未导致不公平交易和利益输送。

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，在运作过程中严格遵守基金合同，对指数基金采取被动复制的方式跟踪指数，完全复制标的指数，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。

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不可用等特殊情形。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、打新、成分股调整。当由于申赎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2020年06月30日，天弘中证500A基金份额净值为1.0179元，天弘中证500C基金份额净值为1.0386元。报告期内份额净值增长率天弘中证500A为12.14%，同期业绩比较基准增长率为10.84%；天弘中证500C为12.01%，同期业绩比较基准增长率为10.84%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

上半年疫情对国内经济造成了巨大的冲击，包括疫情海外扩散以及原油价格下跌，引发对通缩和外需下滑的担忧，导致投资者对宏观经济较为悲观。今年1到2月份为了抗击疫情停工停产，我们用短时间的停工停产为抗击疫情争取了宝贵的时间，在疫情得到控制的情况下，三月份以来复工复产持续推进。近几个月的经济数据也出现了持续的环比改善。二季度，我国GDP同比增长3.2%，如期转正，并且幅度还是比较超预期的。出口方面，我们看到2020年6月出口同比增长了0.5%，进口同比增长了2.7%，这主要是由于欧美复工推动了进出口的好转，后续外需向上趋势确立。6月份的CPI是2.5%，下半年CPI受到去年猪价高基数的制约，基本上不会成为今年经济和货币政策的一个主要关注点。PPI的环比拐点已经出现了，6月PPI环比转正，PPI和周期品的价格有比较高的相关性，从趋势上看，我们预计PPI下半年同比数据会有一个确定性的回升。6月社融和信贷增速继续提升，居民贷款边际修复明显，企业中长期融资继续向好，社融和贷款增长趋势也表明了政策是鼓励金融资源去支持实体经济的。总体上看，我们看好宏观经济的持续修复。

利率方面，当前整体的利率还是处于比较低的一个水平，随着理财产品净值化的趋势推进，对于净值型理财产品，就存在去寻求预期收益率更高的配置需求。另外相比国外的利率水平，中美利差仍保持较高水平，对于外资而言，当经济活动趋于平稳，中国较高的利率水平将吸引更多的外资流入。因此我们看好宏观经济修复背景下A股的表现。

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订与估值相关的定价服务协议。

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

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

本报告期内，本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人复核了本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况（如有）、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整。

§ 6 中期财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体：天弘中证500指数型发起式证券投资基金

报告截止日：2020年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末	上年度末
-----	-----	-----	------

		2020年06月30日	2019年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	189,127,434.56	130,525,744.58
结算备付金		22,596,520.74	25,197,361.38
存出保证金		16,087,145.32	2,333,398.80
交易性金融资产	6.4.7.2	2,151,786,188.38	2,188,588,020.76
其中：股票投资		2,151,786,188.38	2,188,588,020.76
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		26,185,535.60	-
应收利息	6.4.7.5	102,070.78	73,104.26
应收股利		-	-
应收申购款		30,830,761.84	21,138,615.39
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		2,436,715,657.22	2,367,856,245.17
负债和所有者权益	附注号	本期末 2020年06月30日	上年度末 2019年12月31日
负债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	6.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		49,016,054.79	48,990,701.68
应付管理人报酬		1,006,671.76	1,019,193.02

应付托管费		201,334.36	203,838.63
应付销售服务费		138,245.54	129,151.25
应付交易费用	6.4.7.7	637,305.98	570,197.85
应交税费		162,603.13	106,995.74
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	249,650.11	330,237.20
负债合计		51,411,865.67	51,350,315.37
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	2,327,855,929.74	2,535,887,104.55
未分配利润	6.4.7.10	57,447,861.81	-219,381,174.75
所有者权益合计		2,385,303,791.55	2,316,505,929.80
负债和所有者权益总计		2,436,715,657.22	2,367,856,245.17

注：报告截止日2020年06月30日，天弘中证500指数型发起式证券投资基金A类基金份额净值1.0179元，天弘中证500指数型发起式证券投资基金C类基金份额净值1.0386元；基金份额总额2,327,855,929.74份，其中天弘中证500指数型发起式证券投资基金A类基金份额1,564,293,035.75份，天弘中证500指数型发起式证券投资基金C类基金份额763,562,893.99份。

6.2 利润表

会计主体：天弘中证500指数型发起式证券投资基金

本报告期：2020年01月01日至2020年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2020年01月01日至2020年06月30日	上年度可比期间2019年01月01日至2019年06月30日
一、收入		311,166,247.81	108,779,669.27
1. 利息收入		1,764,809.08	1,015,970.83
其中：存款利息收入	6.4.7.11	1,764,705.23	1,015,970.83
债券利息收入		103.85	-

资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		177,850,407.25	772,341.42
其中：股票投资收益	6.4.7.12	153,445,190.63	-13,535,765.75
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	118,267.51	-
资产支持证券投资 收益	6.4.7.13. 3	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	6.4.7.14	7,749,009.71	-2,020,478.19
股利收益	6.4.7.15	16,537,939.40	16,328,585.36
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	130,909,775.76	105,997,969.45
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.17	641,255.72	993,387.57
减：二、费用		11,886,295.17	6,969,347.17
1. 管理人报酬		6,251,320.70	3,671,869.11
2. 托管费		1,250,264.17	734,373.82
3. 销售服务费		889,748.48	398,594.19
4. 交易费用	6.4.7.18	3,108,449.91	1,913,716.55
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产 支出		-	-
6. 税金及附加		27,896.52	11,682.98
7. 其他费用	6.4.7.19	358,615.39	239,110.52

三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		299,279,952.64	101,810,322.10
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		299,279,952.64	101,810,322.10

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：天弘中证500指数型发起式证券投资基金

本报告期：2020年01月01日至2020年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2020年01月01日至2020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）	2,535,887,104.55	-219,381,174.75	2,316,505,929.80
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	299,279,952.64	299,279,952.64
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）	-208,031,174.81	-22,450,916.08	-230,482,090.89
其中：1. 基金申购款	3,771,394,727.60	-226,858,902.20	3,544,535,825.40
2. 基金赎回款	-3,979,425,902.41	204,407,986.12	-3,775,017,916.29
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）	2,327,855,929.74	57,447,861.81	2,385,303,791.55
项 目	上年度可比期间		

	2019年01月01日至2019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)	1,305,986,814.03	-368,563,943.26	937,422,870.77
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	101,810,322.10	101,810,322.10
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)	1,056,790,604.03	-83,757,277.53	973,033,326.50
其中: 1. 基金申购款	3,761,877,708.81	-396,230,957.34	3,365,646,751.47
2. 基金赎回款	-2,705,087,104.78	312,473,679.81	-2,392,613,424.97
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)	2,362,777,418.06	-350,510,898.69	2,012,266,519.37

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

薄贺龙

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500指数型发起式证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2014]1364号《关于准予天弘中证500指数型发起式证券投资基金注册的批复》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500指数型发起式证券投资基金基金合同》负责公开

募集。本基金为契约型开放式、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010号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《天弘中证500指数型发起式证券投资基金基金合同》于2015年1月20日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为10,000,000.00份基金份额。本基金的基金管理人为天弘基金管理有限公司，基金托管人为国泰君安证券股份有限公司。

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

根据天弘基金管理有限公司2018年4月24日发布的《关于天弘中证500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。A类基金份额在投资者认购/申购、赎回基金时收取认购/申购、赎回费用，而不计提销售服务费；C类基金份额在投资者申购基金份额时不收取申购费用、赎回时收取赎回费用，同时从本类别基金资产中计提销售服务费。

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

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<年度报告和中期报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称“中国基金业协会”)颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《天弘中证500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。

本财务报表以本基金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2020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2020年06月30日的财务状况以及2020年度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年度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[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、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、教育费附加和地方教育附加等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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
	2020年06月30日
活期存款	189,127,434.56
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	189,127,434.56

6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末2020年06月30日		
	成本	公允价值	公允价值变动

股票		1,932,373,213.26	2,151,786,188.38	219,412,975.12
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		1,932,373,213.26	2,151,786,188.38	219,412,975.12

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

单位：人民币元

项目	本期末2020年06月30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	110,482,200.00	-	-	-
股指期货	110,482,200.00	-	-	-
其他衍生工具	-	-	-	-
合计	110,482,200.00	-	-	-

注：衍生金融资产项下的权益衍生工具为股指期货投资，净额为0。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合约产生的持仓损益，则衍生金融资产项下的股指期货投资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。

于2020年06月30日，本基金持有的股指期货合约情况如下：

代码	名称	持仓量(买/卖) (单位: 手)	合约市值	公允价值变动
IC2007	IC2007	100	115,988,000.00	5,505,800.00
总额合计	-	-	-	5,505,800.00
减: 可抵销期货 暂收款	-	-	-	5,505,800.00
股指期货投资 净额	-	-	-	-

注: 买入持仓量以正数表示, 卖出持仓量以负数表示。

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 2020年06月30日
应收活期存款利息	95,667.98
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	5,948.90
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	-
应收出借证券利息	-
其他	453.90
合计	102,070.78

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 2020年06月30日
交易所市场应付交易费用	637,305.98
银行间市场应付交易费用	-
合计	637,305.98

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	12,875.98
应付证券出借违约金	-
预提费用	108,562.61
其他应付	128,211.52
合计	249,650.11

6.4.7.9 实收基金**6.4.7.9.1 天弘中证500A**

金额单位：人民币元

项目 (天弘中证500A)	本期2020年01月01日至2020年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	1,783,219,219.27	1,783,219,219.27
本期申购	1,841,415,349.79	1,841,415,349.79
本期赎回(以“-”号填列)	-2,060,341,533.31	-2,060,341,533.31
本期末	1,564,293,035.75	1,564,293,035.75

6.4.7.9.2 天弘中证500C

金额单位：人民币元

项目 (天弘中证500C)	本期2020年01月01日至2020年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	752,667,885.28	752,667,885.28
本期申购	1,929,979,377.81	1,929,979,377.81
本期赎回(以“-”号填列)	-1,919,084,369.10	-1,919,084,369.10
本期末	763,562,893.99	763,562,893.99

注：申购含转换转入份额；赎回含转换转出份额。

6.4.7.10 未分配利润

6.4.7.10.1 天弘中证500A

单位：人民币元

项目 (天弘中证500A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-693,787,838.75	529,227,733.68	-164,560,105.07
本期利润	110,355,115.21	86,464,099.17	196,819,214.38
本期基金份额交易产生的变动数	78,305,306.71	-82,622,404.47	-4,317,097.76
其中：基金申购款	-695,631,877.60	565,736,861.83	-129,895,015.77
基金赎回款	773,937,184.31	-648,359,266.30	125,577,918.01
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-505,127,416.83	533,069,428.38	27,942,011.55

6.4.7.10.2 天弘中证500C

单位：人民币元

项目 (天弘中证500C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-56,559,882.29	1,738,812.61	-54,821,069.68
本期利润	58,015,061.67	44,445,676.59	102,460,738.26
本期基金份额交易产	-8,000,687.29	-10,133,131.03	-18,133,818.32

生的变动数			
其中：基金申购款	-126,601,822.16	29,637,935.73	-96,963,886.43
基金赎回款	118,601,134.87	-39,771,066.76	78,830,068.11
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-6,545,507.91	36,051,358.17	29,505,850.26

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2020年01月01日至2020年06月30日
活期存款利息收入	1,657,095.39
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	98,983.59
其他	8,626.25
合计	1,764,705.23

6.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
卖出股票成交总额	1,569,310,983.24
减：卖出股票成本总额	1,415,865,792.61
买卖股票差价收入	153,445,190.63

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

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入	118,267.51
债券投资收益——赎回差价收入	-

债券投资收益——申购差价收入	-
合计	118,267.51

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额	908,372.00
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	789,996.34
减：应收利息总额	108.15
买卖债券差价收入	118,267.51

6.4.7.13.3 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 衍生工具收益

6.4.7.14.1 衍生工具收益——买卖权证差价收入

本基金本报告期未取得买卖权证差价收入。

6.4.7.14.2 衍生工具收益——其他投资收益

单位：人民币元

项目	本期收益金额 2020年01月01日至2020年06月30日
股指期货投资收益	7,749,009.71

6.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
----	-------------------------------

股票投资产生的股利收益	16,537,939.40
其中：证券出借权益补偿收入	-
基金投资产生的股利收益	-
合计	16,537,939.40

6.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
1. 交易性金融资产	125,732,055.76
——股票投资	125,732,055.76
——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	5,177,720.00
——权证投资	-
——股指期货	5,177,720.00
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	130,909,775.76

6.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
基金赎回费收入	591,711.31
基金转换费收入	49,544.41
合计	641,255.72

6.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
交易所市场交易费用	3,108,449.91
银行间市场交易费用	-
合计	3,108,449.91

6.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
审计费用	49,726.04
信息披露费	58,836.57
证券出借违约金	-
指数使用费	250,052.78
合计	358,615.39

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，天弘中证500指数型发起式证券投资基金已变更为天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金，详情可参见基金管理人披露在指定媒介的《关于天弘中证500指数型发起式证券投资基金变更为天弘中证500交易型开放式指数证券投资基金联接基金并相应修订基金合同的公告》。

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
国泰君安证券股份有限公司	基金托管人、基金销售机构

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

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行股票交易。

6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期及上年度可比期间无应支付关联方的佣金。

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 2020年01月01日至202 0年06月30日	上年度可比期间 2019年01月01日至201 9年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	6,251,320.70	3,671,869.11
其中：支付销售机构的客户维护费	2,276,458.76	1,242,979.33

注：1、支付基金管理人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×该日适用费率/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 2020年01月01日至2020 年06月30日	上年度可比期间 2019年01月01日至2019 年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,250,264.17	734,373.82

注：支付基金托管人国泰君安证券股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 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 × 该日适用费率 / 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 2020年01月01日至2020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500A	天弘中证500C	合计
天弘基金 管理有限 公司	-	9,495.04	9,495.04
合计	-	9,495.04	9,495.04
获得销售 服务费的 各关联方 名称	上年度可比期间 2019年01月01日至2019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500A	天弘中证500C	合计
天弘基金 管理有限 公司	-	23,364.93	23,364.93
合计	-	23,364.93	23,364.93

注：1、支付基金销售机构的销售服务费按前一日各级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。天弘中证500C按0.20%计提销售服务费。销售服务费的计算公式为：

日销售服务费 = 前一日各级基金资产净值 × 该日适用费率 / 当年天数。

2、天弘中证500A不收取销售服务费。

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 报告期内转融通证券出借业务发生重大关联交易事项的说明**6.4.10.4.1 与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务的情况**

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用固定期限费率的证券出借业务。

6.4.10.4.2 与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未发生与关联方通过约定申报方式进行的适用市场化期限费率的证券出借业务。

6.4.10.5 各关联方投资本基金的情况**6.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况**

天弘中证500A

份额单位：份

项目	本期 2020年01月01日至 2020年06月30日	上年度可比期间 2019年01月01日至 2019年06月30日
报告期初持有的基金份额	-	-
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	-	-
报告期末持有的基金份额	-	-
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	-

天弘中证500C

份额单位：份

项目	本期	上年度可比期间

	2020年01月01日至 2020年06月30日	2019年01月01日至 2019年06月30日
报告期初持有的基金份额	-	9,952,413.63
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	-	-
报告期末持有的基金份额	-	9,952,413.63
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	1.27%

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各自级别的份额总额计算。

6.4.10.5.2 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。

6.4.10.6 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 2020年01月01日至2020年06月30日		上年度可比期间 2019年01月01日至2019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
国泰君安证券股份有限公司	189,127,434.56	1,657,095.39	115,984,289.96	947,495.34

注：本基金的银行存款由基金托管人国泰君安证券股份有限公司保管，存放在具有基金托管资格的银行，按银行同业利率或约定利率计息。

6.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位：人民币元

本期 2020年01月01日至2020年06月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张/股）	总金额

国泰君安证券股份有限公司	000750	国海证券	配股发行	449,070	1,459,477.50
国泰君安证券股份有限公司	600956	新天绿能	网下申购	2,533	8,054.94
上年度可比期间 2019年01月01日至2019年06月30日					
关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
				数量（单位：张/股）	总金额
国泰君安证券股份有限公司	-	-	-	-	-

6.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况——按摊余成本法核算的货币市场基金之外的基金

本基金本报告期无利润分配事项。

6.4.12 期末（2020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 (单位:股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
002500	山西证券	2020-06-29	2020-07-10	配股未上市	5.00	6.54	233,040	1,165,200.00	1,524,081.60	-
688106	金宏气体	2020-06-09	2020-12-16	科创板打新限售	15.48	41.36	26,075	403,641.00	1,078,462.00	-
688100	威胜信息	2020-01-09	2020-07-21	科创板打新限售	13.78	25.92	11,602	159,875.56	300,723.84	-
688080	映翰通	2020-02-03	2020-08-12	科创板打新限售	27.63	86.78	2,233	61,697.79	193,779.74	-
688568	中科星图	2020-06-30	2020-07-08	新股未上市	16.21	16.21	11,020	178,634.20	178,634.20	-
688377	迪威尔	2020-06-29	2020-07-08	新股未上市	16.42	16.42	7,894	129,619.48	129,619.48	-
688277	天智航	2020-06-24	2020-07-07	新股未上市	12.04	12.04	8,810	106,072.40	106,072.40	-
688027	国盾量子	2020-06-30	2020-07-09	新股未上市	36.18	36.18	2,830	102,389.40	102,389.40	-
688600	皖仪科技	2020-06-23	2020-07-03	新股未上市	15.50	15.50	5,468	84,754.00	84,754.00	-

300847	中船汉光	2020-06-29	2020-07-09	新股未上市	6.94	6.94	1,421	9,861.74	9,861.74	-
300845	捷安高科	2020-06-24	2020-07-03	新股未上市	17.63	17.63	470	8,286.10	8,286.10	-
300843	胜蓝股份	2020-06-23	2020-07-02	新股未上市	10.01	10.01	751	7,517.51	7,517.51	-
300840	酷特智能	2020-06-30	2020-07-08	新股未上市	5.94	5.94	1,185	7,038.90	7,038.90	-
300846	首都在线	2020-06-22	2020-07-01	新股未上市	3.37	3.37	1,131	3,811.47	3,811.47	-

注：根据《上海证券交易所科创板股票公开发行自律委员会促进科创板初期企业平稳发行行业倡导建议》，本基金获配的科创板股票如经抽签方式确定需要锁定的，锁定期限为自发行人股票上市之日起6个月。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(股)	期末成本总额	期末估值总额	备注
601880	大连港	2020-06-22	拟筹划重大资产重组	1.72	2020-07-08	1.89	1,409,003	2,864,061.72	2,423,485.16	-
002470	*ST金正	2020-06-30	实行退市风险警示公告	2.27	2020-07-01	2.16	728,000	3,233,590.66	1,652,560.00	-

注：本基金截至2020年06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2020年06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2020年06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。

6.4.12.4 期末参与转融通证券出借业务的证券

本基金本报告期末无参与转融通证券出借业务的证券。

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

本基金为股票型指数基金，采用指数复制投资策略，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理念，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、内审部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。在全面风险管理体系的框架下，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和风险管理部负责，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、大类风险的识别、计量和控制。风险管理部向公司首席风控官进行汇报。内审部对公司内部控制和风险管理的有效性，经营效率和效果等方面开展独立评价活动，向总经理和督察长汇报。

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。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管人国泰君安证券股份有限公司开立于具有基金托管人资格的银行的托管账户，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。

债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

6.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

本期末及上年度末均未持有短期信用评级的债券。

6.4.13.2.2 按短期信用评级列示的资产支持证券投资

本期末及上年度末均未持有短期信用评级的资产支持证券。

6.4.13.2.3 按短期信用评级列示的同业存单投资

本期末及上年度末均未持有短期信用评级的同业存单。

6.4.13.2.4 按长期信用评级列示的债券投资

本期末及上年度末均未持有长期信用评级的债券。

6.4.13.2.5 按长期信用评级列示的资产支持证券投资

本期末及上年度末均未持有长期信用评级的资产支持证券。

6.4.13.2.6 按长期信用评级列示的同业存单投资

本期末及上年度末均未持有长期信用评级的同业存单。

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2020年06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》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公司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，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。

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、债券投资、资产支持证券投资及买入返售金融资产等。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2020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	189,127,434.56	-	-	-	189,127,434.56
结算备付金	22,596,520.74	-	-	-	22,596,520.74
存出保证金	1,008,705.32	-	-	15,078,440.00	16,087,145.32
交易性金融资产	-	-	-	2,151,786,188.38	2,151,786,188.38
应收证券清算款	-	-	-	26,185,535.60	26,185,535.60
应收利息	-	-	-	102,070.78	102,070.78
应收申购款	-	-	-	30,830,761.84	30,830,761.84
资产总计	212,732,660.62	-	-	2,223,982,996.60	2,436,715,657.22
负债					
应付赎回款	-	-	-	49,016,054.79	49,016,054.79
应付管理人报酬	-	-	-	1,006,671.76	1,006,671.76
应付托管费	-	-	-	201,334.36	201,334.36
应付销售服务费	-	-	-	138,245.54	138,245.54
应付交易费用	-	-	-	637,305.98	637,305.98
应交税费	-	-	-	162,603.13	162,603.13
其他负债	-	-	-	249,650.11	249,650.11
负债总计	-	-	-	51,411,865.67	51,411,865.67
利率敏感度缺口	212,732,660.62	-	-	2,172,571,130.93	2,385,303,791.55
上年度末2019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	130,525,744.58	-	-	-	130,525,744.58
结算备付金	25,197,361.38	-	-	-	25,197,361.38
存出保证金	1,109,204.40	-	-	1,224,194.40	2,333,398.80
交易性金融资产	-	-	-	2,188,588,020.76	2,188,588,020.76
应收利息	-	-	-	73,104.26	73,104.26
应收申购款	-	-	-	21,138,615.39	21,138,615.39
资产总计	156,832,310.36	-	-	2,211,023,934.81	2,367,856,245.17
负债					
应付赎回款	-	-	-	48,990,701.68	48,990,701.68

应付管理人报酬	-	-	-	1,019,193.02	1,019,193.02
应付托管费	-	-	-	203,838.63	203,838.63
应付销售服务费	-	-	-	129,151.25	129,151.25
应付交易费用	-	-	-	570,197.85	570,197.85
应交税费	-	-	-	106,995.74	106,995.74
其他负债	-	-	-	330,237.20	330,237.20
负债总计	-	-	-	51,350,315.37	51,350,315.37
利率敏感度缺口	156,832,310. 36	-	-	2,159,673,619. 44	2,316,505,929. 80

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2020年06月30日，本基金未持有交易性债券投资(2019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(2019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500指数，通过指数化分散投资降低其他价格风险。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日		上年度末 2019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	2,151,786,188.38	90.21	2,188,588,020.76	94.48
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	2,151,786,188.38	90.21	2,188,588,020.76	94.48

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 2020年06月30日	上年度末 2019年12月31日
	业绩比较基准上升5%	121,412,027.11	124,702,071.08
	业绩比较基准下降5%	-121,412,027.11	-124,702,071.08

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2020年06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2,143,975,110.84元，属于第二层次的余额为7,811,077.54元，无属于第三层次的余额(2019年12月31日：第一层次2,184,544,237.72元，第二层次4,043,783.04元，无属于第三层次的余额)。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

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

无。

(c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2020年06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(2019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	2,151,786,188.38	88.31
	其中：股票	2,151,786,188.38	88.31
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	211,723,955.30	8.69
8	其他各项资产	73,205,513.54	3.00
9	合计	2,436,715,657.22	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	19,302,983.00	0.81
B	采矿业	50,315,307.52	2.11
C	制造业	1,253,128,658.79	52.54
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	49,024,363.27	2.06
E	建筑业	27,817,158.82	1.17
F	批发和零售业	119,924,829.39	5.03
G	交通运输、仓储和邮政业	45,066,818.83	1.89
H	住宿和餐饮业	7,218,259.15	0.30
I	信息传输、软件和信息技术服务业	241,881,032.32	10.14
J	金融业	110,100,742.81	4.62
K	房地产业	75,701,013.44	3.17
L	租赁和商务服务业	43,948,473.98	1.84
M	科学研究和技术服务业	15,551,390.75	0.65
N	水利、环境和公共设施管理业	20,564,549.20	0.86
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	2,130,344.64	0.09

Q	卫生和社会工作	15,661,008.00	0.66
R	文化、体育和娱乐业	33,572,130.49	1.41
S	综合	18,515,204.66	0.78
	合计	2,149,424,269.06	90.11

7.2.2 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	2,158,421.23	0.09
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,766.32	0.00
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	190,731.77	0.01
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	-	-
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	2,361,919.32	0.10

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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	300253	卫宁健康	747,249	17,141,892.06	0.72
2	002127	南极电商	752,350	15,927,249.50	0.67
3	002821	凯莱英	60,623	14,731,389.00	0.62
4	600201	生物股份	493,067	13,726,985.28	0.58
5	002185	华天科技	959,700	12,984,741.00	0.54
6	600739	辽宁成大	669,600	12,675,528.00	0.53
7	300558	贝达药业	87,747	12,282,825.06	0.51
8	600529	山东药玻	208,300	12,081,400.00	0.51
9	002439	启明星辰	286,100	12,036,227.00	0.50
10	300088	长信科技	1,068,000	11,961,600.00	0.50
11	002385	大北农	1,285,500	11,710,905.00	0.49
12	300012	华测检测	582,500	11,510,200.00	0.48
13	002131	利欧股份	2,956,785	11,413,190.10	0.48
14	300285	国瓷材料	337,200	11,299,572.00	0.47
15	600079	人福医药	414,678	11,287,535.16	0.47
16	600521	华海药业	318,323	10,800,699.39	0.45
17	600298	安琪酵母	216,352	10,705,096.96	0.45
18	002465	海格通信	807,100	10,443,874.00	0.44
19	603444	吉比特	19,000	10,431,190.00	0.44
20	600143	金发科技	788,364	10,382,753.88	0.44
21	600161	天坛生物	228,627	10,363,661.91	0.43
22	002075	沙钢股份	772,700	9,658,750.00	0.40
23	000009	中国宝安	1,128,920	9,607,109.20	0.40

24	300496	中科创达	123,386	9,587,092.20	0.40
25	002223	鱼跃医疗	263,090	9,576,476.00	0.40
26	601099	太平洋	2,984,000	9,459,280.00	0.40
27	002212	南洋股份	354,853	9,431,992.74	0.40
28	603517	绝味食品	133,100	9,415,494.00	0.39
29	300482	万孚生物	89,800	9,339,200.00	0.39
30	002074	国轩高科	345,900	9,283,956.00	0.39
31	300595	欧普康视	132,834	9,210,709.56	0.39
32	000636	风华高科	313,392	9,147,912.48	0.38
33	002273	水晶光电	532,802	9,132,226.28	0.38
34	300207	欣旺达	480,796	9,087,044.40	0.38
35	601128	常熟银行	1,199,877	9,011,076.27	0.38
36	300418	昆仑万维	359,106	8,963,285.76	0.38
37	603882	金域医学	100,100	8,958,950.00	0.38
38	300315	掌趣科技	1,207,300	8,849,509.00	0.37
39	600426	华鲁恒升	498,282	8,809,625.76	0.37
40	002507	涪陵榨菜	241,759	8,705,741.59	0.36
41	000988	华工科技	352,101	8,601,827.43	0.36
42	300357	我武生物	137,500	8,559,375.00	0.36
43	603939	益丰药房	92,620	8,428,420.00	0.35
44	002340	格林美	1,675,344	8,326,459.68	0.35
45	002603	以岭药业	263,388	8,215,071.72	0.34
46	000975	银泰黄金	520,962	8,168,684.16	0.34
47	002414	高德红外	278,519	8,155,036.32	0.34
48	300168	万达信息	363,700	8,026,859.00	0.34
49	300271	华宇软件	284,400	8,022,924.00	0.34
50	300212	易华录	142,300	7,968,800.00	0.33
51	600885	宏发股份	195,615	7,848,073.80	0.33
52	600859	王府井	172,030	7,835,966.50	0.33
53	002373	千方科技	326,297	7,827,865.03	0.33
54	002353	杰瑞股份	251,400	7,793,400.00	0.33

55	000513	丽珠集团	162,310	7,792,503.10	0.33
56	600132	重庆啤酒	106,159	7,749,607.00	0.32
57	600699	均胜电子	324,880	7,735,392.80	0.32
58	000547	航天发展	562,330	7,687,051.10	0.32
59	601799	星宇股份	60,400	7,670,800.00	0.32
60	002156	通富微电	302,900	7,587,645.00	0.32
61	300009	安科生物	418,206	7,485,887.40	0.31
62	300024	机器人	546,385	7,469,082.95	0.31
63	002019	亿帆医药	324,700	7,458,359.00	0.31
64	002797	第一创业	1,073,200	7,426,544.00	0.31
65	002030	达安基因	271,152	7,397,026.56	0.31
66	000750	国海证券	1,668,370	7,240,725.80	0.30
67	300017	网宿科技	852,200	7,235,178.00	0.30
68	002557	洽洽食品	133,000	7,207,270.00	0.30
69	603858	步长制药	249,395	7,195,045.75	0.30
70	002174	游族网络	275,300	7,179,824.00	0.30
71	600801	华新水泥	297,884	7,062,829.64	0.30
72	002250	联化科技	323,500	7,052,300.00	0.30
73	002138	顺络电子	282,500	7,048,375.00	0.30
74	002195	二三四五	2,505,967	7,041,767.27	0.30
75	600315	上海家化	146,897	7,036,366.30	0.29
76	000021	深科技	321,908	7,027,251.64	0.29
77	603233	大参林	86,336	7,012,209.92	0.29
78	300316	晶盛机电	281,160	6,955,898.40	0.29
79	600380	健康元	425,932	6,917,135.68	0.29
80	600895	张江高科	339,001	6,905,450.37	0.29
81	000050	深天马 A	448,200	6,884,352.00	0.29
82	002152	广电运通	527,300	6,823,262.00	0.29
83	300058	蓝色光标	872,100	6,802,380.00	0.29
84	002572	索菲亚	279,521	6,756,022.57	0.28
85	300070	碧水源	831,000	6,747,720.00	0.28

86	000998	隆平高科	403,300	6,714,945.00	0.28
87	600486	扬农化工	81,300	6,707,250.00	0.28
88	300244	迪安诊断	189,860	6,702,058.00	0.28
89	600845	宝信软件	112,840	6,666,587.20	0.28
90	000401	冀东水泥	412,695	6,619,627.80	0.28
91	600410	华胜天成	480,880	6,539,968.00	0.27
92	600667	太极实业	553,100	6,537,642.00	0.27
93	600037	歌华有线	429,745	6,532,124.00	0.27
94	002500	山西证券	998,040	6,527,181.60	0.27
95	600535	天士力	402,200	6,523,684.00	0.27
96	002078	太阳纸业	680,592	6,479,235.84	0.27
97	603338	浙江鼎力	84,832	6,427,720.64	0.27
98	300274	阳光电源	446,605	6,426,645.95	0.27
99	000623	吉林敖东	407,315	6,407,064.95	0.27
100	600155	华创阳安	533,100	6,391,869.00	0.27
101	002511	中顺洁柔	286,200	6,382,260.00	0.27
102	002382	蓝帆医疗	211,094	6,356,040.34	0.27
103	600642	申能股份	1,074,941	6,352,901.31	0.27
104	002396	星网锐捷	178,500	6,306,405.00	0.26
105	002013	中航机电	789,800	6,239,420.00	0.26
106	000630	铜陵有色	3,224,800	6,223,864.00	0.26
107	002690	美亚光电	118,310	6,223,106.00	0.26
108	601233	桐昆股份	485,200	6,191,152.00	0.26
109	600126	杭钢股份	591,140	6,147,856.00	0.26
110	600879	航天电子	952,100	6,131,524.00	0.26
111	002926	华西证券	574,600	6,107,998.00	0.26
112	603707	健友股份	94,335	6,091,210.95	0.26
113	600884	杉杉股份	511,851	6,034,723.29	0.25
114	600153	建发股份	744,300	6,028,830.00	0.25
115	300010	立思辰	307,678	6,021,258.46	0.25
116	000739	普洛药业	257,796	6,004,068.84	0.25

117	603659	璞泰来	57,200	5,892,744.00	0.25
118	600415	小商品城	1,202,100	5,854,227.00	0.25
119	002281	光迅科技	177,906	5,845,991.16	0.25
120	600811	东方集团	1,300,851	5,749,761.42	0.24
121	600167	联美控股	400,570	5,744,173.80	0.24
122	001914	招商积余	185,600	5,703,488.00	0.24
123	600216	浙江医药	295,602	5,693,294.52	0.24
124	600804	鹏博士	627,100	5,631,358.00	0.24
125	300251	光线传媒	513,500	5,602,285.00	0.23
126	600728	佳都科技	613,000	5,584,430.00	0.23
127	300001	特锐德	261,889	5,483,955.66	0.23
128	002268	卫士通	256,569	5,475,182.46	0.23
129	300115	长盈精密	238,891	5,458,659.35	0.23
130	002028	思源电气	266,017	5,442,707.82	0.23
131	002294	信立泰	183,000	5,427,780.00	0.23
132	600909	华安证券	792,800	5,414,824.00	0.23
133	600511	国药股份	131,693	5,355,954.31	0.22
134	600779	水井坊	85,605	5,343,464.10	0.22
135	300002	神州泰岳	858,182	5,312,146.58	0.22
136	000581	威孚高科	256,169	5,297,574.92	0.22
137	600325	华发股份	741,446	5,234,608.76	0.22
138	000686	东北证券	614,800	5,195,060.00	0.22
139	601689	拓普集团	184,995	5,161,360.50	0.22
140	000997	新大陆	322,150	5,147,957.00	0.22
141	600528	中铁工业	583,306	5,144,758.92	0.22
142	603883	老百姓	51,308	5,132,852.32	0.22
143	002387	维信诺	359,300	5,130,804.00	0.22
144	600418	江淮汽车	580,241	5,123,528.03	0.21
145	600446	金证股份	263,500	5,111,900.00	0.21
146	600827	百联股份	353,200	5,103,740.00	0.21
147	600460	士兰微	344,560	5,058,140.80	0.21

148	600598	北大荒	311,200	5,010,320.00	0.21
149	000999	华润三九	171,279	4,999,634.01	0.21
150	002242	九阳股份	134,097	4,997,795.19	0.21
151	002317	众生药业	288,528	4,951,140.48	0.21
152	600959	江苏有线	1,313,300	4,938,008.00	0.21
153	600733	北汽蓝谷	764,500	4,915,735.00	0.21
154	601168	西部矿业	834,400	4,839,520.00	0.20
155	600256	广汇能源	1,784,000	4,816,800.00	0.20
156	603605	珀莱雅	26,700	4,806,534.00	0.20
157	603806	福斯特	96,218	4,802,240.38	0.20
158	603000	人民网	241,800	4,794,894.00	0.20
159	600260	凯乐科技	350,341	4,736,610.32	0.20
160	000878	云南铜业	446,300	4,735,243.00	0.20
161	300296	利亚德	778,900	4,727,923.00	0.20
162	002368	太极股份	108,201	4,727,301.69	0.20
163	000564	供销大集	1,051,700	4,722,133.00	0.20
164	600820	隧道股份	825,600	4,664,640.00	0.20
165	600704	物产中大	1,107,700	4,663,417.00	0.20
166	002670	国盛金控	508,359	4,651,484.85	0.20
167	600839	四川长虹	1,616,285	4,638,737.95	0.19
168	300113	顺网科技	182,559	4,636,998.60	0.19
169	002081	金螳螂	587,400	4,616,964.00	0.19
170	300630	普利制药	62,225	4,601,538.75	0.19
171	600497	驰宏锌锗	1,337,000	4,599,280.00	0.19
172	300166	东方国信	369,917	4,590,669.97	0.19
173	002124	天邦股份	355,100	4,563,035.00	0.19
174	600673	东阳光	659,406	4,556,495.46	0.19
175	002080	中材科技	293,900	4,555,450.00	0.19
176	600008	首创股份	1,493,000	4,493,930.00	0.19
177	600572	康恩贝	816,983	4,493,406.50	0.19
178	002920	德赛西威	73,200	4,489,356.00	0.19

179	002221	东华能源	505,310	4,441,674.90	0.19
180	603866	桃李面包	86,620	4,408,091.80	0.18
181	300618	寒锐钴业	71,000	4,403,420.00	0.18
182	000158	常山北明	419,840	4,383,129.60	0.18
183	600718	东软集团	380,600	4,376,900.00	0.18
184	600549	厦门钨业	369,300	4,372,512.00	0.18
185	300026	红日药业	789,195	4,356,356.40	0.18
186	601179	中国西电	897,600	4,344,384.00	0.18
187	000800	一汽解放	403,500	4,333,590.00	0.18
188	600875	东方电气	486,500	4,305,525.00	0.18
189	002217	合力泰	818,400	4,296,600.00	0.18
190	600171	上海贝岭	246,643	4,286,655.34	0.18
191	600021	上海电力	573,400	4,243,160.00	0.18
192	601966	玲珑轮胎	209,800	4,237,960.00	0.18
193	000729	燕京啤酒	616,900	4,225,765.00	0.18
194	002831	裕同科技	153,384	4,219,593.84	0.18
195	600060	海信视像	343,400	4,172,310.00	0.17
196	000877	天山股份	275,600	4,161,560.00	0.17
197	600567	山鹰纸业	1,407,700	4,152,715.00	0.17
198	600094	大名城	697,300	4,148,935.00	0.17
199	600881	亚泰集团	1,421,798	4,137,432.18	0.17
200	600862	中航高科	243,800	4,125,096.00	0.17
201	002399	海普瑞	163,500	4,094,040.00	0.17
202	600160	巨化股份	590,621	4,069,378.69	0.17
203	000060	中金岭南	1,093,900	4,069,308.00	0.17
204	002709	天赐材料	119,920	4,052,096.80	0.17
205	002056	横店东磁	359,560	4,045,050.00	0.17
206	600645	中源协和	143,051	4,041,190.75	0.17
207	600597	XD光明乳	267,900	3,980,994.00	0.17
208	000090	天健集团	572,384	3,955,173.44	0.17
209	603228	景旺电子	112,041	3,942,722.79	0.17

210	002458	益生股份	257,800	3,936,606.00	0.17
211	002429	兆驰股份	792,600	3,923,370.00	0.16
212	600026	中远海能	606,734	3,919,501.64	0.16
213	300133	华策影视	537,900	3,899,775.00	0.16
214	600754	锦江酒店	140,525	3,899,568.75	0.16
215	603712	七一二	101,300	3,887,894.00	0.16
216	600580	卧龙电驱	341,777	3,841,573.48	0.16
217	600967	内蒙一机	369,708	3,841,266.12	0.16
218	600273	嘉化能源	438,800	3,835,112.00	0.16
219	603568	伟明环保	164,876	3,825,123.20	0.16
220	601005	重庆钢铁	2,565,600	3,822,744.00	0.16
221	002648	卫星石化	233,200	3,794,164.00	0.16
222	600392	盛和资源	537,775	3,791,313.75	0.16
223	000629	攀钢钒钛	1,879,400	3,777,594.00	0.16
224	002233	塔牌集团	312,900	3,764,187.00	0.16
225	600282	南钢股份	1,164,137	3,760,162.51	0.16
226	000960	锡业股份	438,297	3,751,822.32	0.16
227	600755	厦门国贸	566,636	3,739,797.60	0.16
228	002203	海亮股份	427,100	3,737,125.00	0.16
229	002807	江阴银行	950,500	3,735,465.00	0.16
230	002004	华邦健康	693,190	3,729,362.20	0.16
231	002085	万丰奥威	574,100	3,720,168.00	0.16
232	600039	四川路桥	972,977	3,716,772.14	0.16
233	600064	南京高科	378,610	3,680,089.20	0.15
234	600563	法拉电子	59,103	3,652,565.40	0.15
235	000970	中科三环	372,800	3,645,984.00	0.15
236	601118	海南橡胶	749,200	3,641,112.00	0.15
237	600737	中粮糖业	467,900	3,640,262.00	0.15
238	600166	福田汽车	2,014,299	3,625,738.20	0.15
239	600566	济川药业	142,305	3,623,085.30	0.15
240	601975	招商南油	1,514,000	3,618,460.00	0.15

241	600195	中牧股份	222,418	3,609,844.14	0.15
242	000598	兴蓉环境	784,000	3,606,400.00	0.15
243	300182	捷成股份	901,800	3,598,182.00	0.15
244	000690	宝新能源	761,723	3,595,332.56	0.15
245	600515	海航基础	691,300	3,594,760.00	0.15
246	000778	新兴铸管	1,047,900	3,594,297.00	0.15
247	300324	旋极信息	537,065	3,576,852.90	0.15
248	300474	景嘉微	53,100	3,573,630.00	0.15
249	002110	三钢闽光	536,350	3,572,091.00	0.15
250	600466	蓝光发展	659,960	3,557,184.40	0.15
251	603816	顾家家居	78,967	3,554,304.67	0.15
252	002183	怡亚通	657,600	3,524,736.00	0.15
253	000400	许继电气	264,800	3,495,360.00	0.15
254	600373	中文传媒	296,500	3,492,770.00	0.15
255	002506	协鑫集成	1,334,500	3,483,045.00	0.15
256	002925	盈趣科技	60,000	3,476,400.00	0.15
257	000402	金融街	523,000	3,472,720.00	0.15
258	002635	安洁科技	138,942	3,459,655.80	0.15
259	002038	双鹭药业	269,586	3,453,396.66	0.14
260	600435	北方导航	456,144	3,448,448.64	0.14
261	002745	木林森	223,500	3,444,135.00	0.14
262	000089	深圳机场	448,600	3,436,276.00	0.14
263	000967	盈峰环境	415,300	3,426,225.00	0.14
264	000681	视觉中国	183,951	3,425,167.62	0.14
265	002191	劲嘉股份	384,401	3,425,012.91	0.14
266	000738	航发控制	250,500	3,419,325.00	0.14
267	002092	中泰化学	751,443	3,404,036.79	0.14
268	002595	豪迈科技	174,800	3,401,608.00	0.14
269	601860	紫金银行	801,300	3,389,499.00	0.14
270	600643	爱建集团	425,720	3,384,474.00	0.14
271	002048	宁波华翔	219,098	3,382,873.12	0.14

272	601106	中国一重	1,200,500	3,373,405.00	0.14
273	000039	中集集团	466,506	3,372,838.38	0.14
274	600808	马钢股份	1,305,802	3,368,969.16	0.14
275	000983	西山煤电	896,400	3,361,500.00	0.14
276	600120	浙江东方	487,813	3,351,275.31	0.14
277	000830	鲁西化工	448,800	3,348,048.00	0.14
278	000930	中粮科技	489,900	3,346,017.00	0.14
279	600633	XD浙数文	341,803	3,342,833.34	0.14
280	601333	广深铁路	1,484,400	3,339,900.00	0.14
281	600729	重庆百货	106,700	3,331,174.00	0.14
282	601098	中南传媒	314,400	3,326,352.00	0.14
283	600258	首旅酒店	215,920	3,318,690.40	0.14
284	000825	太钢不锈	997,300	3,311,036.00	0.14
285	600376	首开股份	564,600	3,308,556.00	0.14
286	600056	XD中国医	233,700	3,306,855.00	0.14
287	600388	龙净环保	374,700	3,297,360.00	0.14
288	600649	城投控股	552,400	3,281,256.00	0.14
289	600675	中华企业	800,500	3,258,035.00	0.14
290	000415	渤海租赁	1,082,800	3,226,744.00	0.14
291	000563	陕国投 A	867,650	3,218,981.50	0.13
292	000501	鄂武商 A	204,554	3,207,406.72	0.13
293	002372	伟星新材	275,420	3,203,134.60	0.13
294	601866	中远海发	1,735,600	3,193,504.00	0.13
295	601718	际华集团	961,200	3,191,184.00	0.13
296	300180	华峰超纤	372,700	3,190,312.00	0.13
297	002839	张家港行	553,600	3,188,736.00	0.13
298	002407	多氟多	299,500	3,186,680.00	0.13
299	600776	东方通信	209,200	3,156,828.00	0.13
300	002640	跨境通	483,100	3,135,319.00	0.13
301	002815	崇达技术	154,800	3,131,604.00	0.13
302	002010	传化智联	570,200	3,101,888.00	0.13

303	600022	山东钢铁	2,395,330	3,089,975.70	0.13
304	002064	华峰氨纶	608,300	3,084,081.00	0.13
305	000012	南玻A	612,493	3,074,714.86	0.13
306	603077	和邦生物	2,318,700	3,060,684.00	0.13
307	600500	中化国际	604,140	3,056,948.40	0.13
308	002583	海能达	402,400	3,054,216.00	0.13
309	000078	海王生物	725,550	3,040,054.50	0.13
310	000932	华菱钢铁	804,680	3,033,643.60	0.13
311	600062	华润双鹤	228,415	3,019,646.30	0.13
312	603486	科沃斯	99,760	3,013,749.60	0.13
313	000883	湖北能源	854,400	3,007,488.00	0.13
314	601615	明阳智能	241,500	3,006,675.00	0.13
315	600266	城建发展	592,556	3,004,258.92	0.13
316	002375	亚厦股份	293,400	2,998,548.00	0.13
317	000959	首钢股份	694,600	2,986,780.00	0.13
318	000807	云铝股份	684,600	2,984,856.00	0.13
319	000685	中山公用	387,442	2,983,303.40	0.13
320	600316	洪都航空	188,269	2,974,650.20	0.12
321	000301	东方盛虹	529,100	2,941,796.00	0.12
322	000028	国药一致	65,211	2,935,147.11	0.12
323	002936	郑州银行	848,040	2,917,257.60	0.12
324	601699	潞安环能	523,400	2,915,338.00	0.12
325	000559	万向钱潮	602,300	2,915,132.00	0.12
326	002244	滨江集团	680,800	2,907,016.00	0.12
327	002155	湖南黄金	368,204	2,901,447.52	0.12
328	000027	深圳能源	624,440	2,897,401.60	0.12
329	601000	唐山港	1,296,784	2,891,828.32	0.12
330	000488	晨鸣纸业	584,557	2,887,711.58	0.12
331	000519	中兵红箭	304,447	2,867,890.74	0.12
332	000031	大悦城	562,854	2,864,926.86	0.12
333	000528	柳工	452,031	2,852,315.61	0.12

334	600782	新钢股份	697,600	2,846,208.00	0.12
335	000987	越秀金控	241,000	2,810,060.00	0.12
336	002444	巨星科技	235,240	2,794,651.20	0.12
337	600640	号百控股	139,380	2,780,631.00	0.12
338	600908	无锡银行	566,100	2,779,551.00	0.12
339	002440	闰土股份	302,050	2,760,737.00	0.12
340	002625	光启技术	376,900	2,732,525.00	0.11
341	002266	浙富控股	704,944	2,728,133.28	0.11
342	600073	上海梅林	287,018	2,723,800.82	0.11
343	000156	华数传媒	250,800	2,716,164.00	0.11
344	600777	新潮能源	1,785,500	2,713,960.00	0.11
345	300459	金科文化	784,201	2,705,493.45	0.11
346	601717	郑煤机	456,256	2,687,347.84	0.11
347	002390	信邦制药	583,850	2,662,356.00	0.11
348	600312	平高电气	356,359	2,644,183.78	0.11
349	300072	三聚环保	617,000	2,640,760.00	0.11
350	601958	金钼股份	423,600	2,617,848.00	0.11
351	601608	中信重工	759,622	2,597,907.24	0.11
352	600291	西水股份	287,000	2,597,350.00	0.11
353	002701	奥瑞金	617,184	2,586,000.96	0.11
354	000046	泛海控股	682,400	2,572,648.00	0.11
355	000898	鞍钢股份	1,049,600	2,571,520.00	0.11
356	002424	贵州百灵	308,734	2,562,492.20	0.11
357	002434	万里扬	293,200	2,544,976.00	0.11
358	600409	三友化工	542,100	2,526,186.00	0.11
359	600557	康缘药业	181,420	2,525,366.40	0.11
360	000758	中色股份	603,412	2,522,262.16	0.11
361	000887	中鼎股份	320,546	2,516,286.10	0.11
362	002505	大康农业	1,116,000	2,511,000.00	0.11
363	600765	中航重机	245,018	2,504,083.96	0.10
364	000008	神州高铁	851,700	2,503,998.00	0.10

365	600863	内蒙华电	1,016,823	2,501,384.58	0.10
366	600138	中青旅	253,264	2,499,715.68	0.10
367	002563	森马服饰	354,000	2,495,700.00	0.10
368	601228	广州港	813,100	2,471,824.00	0.10
369	002589	瑞康医药	460,772	2,469,737.92	0.10
370	600751	海航科技	788,293	2,467,357.09	0.10
371	002002	鸿达兴业	679,812	2,454,121.32	0.10
372	000712	锦龙股份	196,000	2,450,000.00	0.10
373	600507	方大特钢	471,964	2,449,493.16	0.10
374	000813	德展健康	392,250	2,431,950.00	0.10
375	601880	大连港	1,409,003	2,423,485.16	0.10
376	600158	中体产业	295,042	2,413,443.56	0.10
377	600970	中材国际	456,796	2,411,882.88	0.10
378	601200	上海环境	199,670	2,396,040.00	0.10
379	600835	上海机电	141,139	2,389,483.27	0.10
380	600478	科力远	506,450	2,385,379.50	0.10
381	600259	广晟有色	79,362	2,380,860.00	0.10
382	600639	浦东金桥	148,971	2,380,556.58	0.10
383	600545	卓郎智能	497,600	2,353,648.00	0.10
384	603885	吉祥航空	258,100	2,348,710.00	0.10
385	300134	大富科技	167,890	2,347,102.20	0.10
386	600717	天津港	527,736	2,332,593.12	0.10
387	000826	启迪环境	312,900	2,321,718.00	0.10
388	600648	外高桥	163,500	2,311,890.00	0.10
389	603198	迎驾贡酒	105,117	2,288,397.09	0.10
390	002503	搜于特	812,100	2,282,001.00	0.10
391	601928	凤凰传媒	334,000	2,271,200.00	0.10
392	002249	大洋电机	621,000	2,241,810.00	0.09
393	600125	铁龙物流	399,900	2,231,442.00	0.09
394	000732	泰禾集团	438,300	2,230,947.00	0.09
395	601598	中国外运	690,000	2,228,700.00	0.09

396	600348	阳泉煤业	526,100	2,220,142.00	0.09
397	600823	世茂股份	492,400	2,201,028.00	0.09
398	000061	农产品	296,900	2,200,029.00	0.09
399	600329	中新药业	126,342	2,188,243.44	0.09
400	002665	首航高科	888,915	2,168,952.60	0.09
401	601611	中国核建	347,900	2,150,022.00	0.09
402	603377	东方时尚	128,644	2,130,344.64	0.09
403	002867	周大生	95,950	2,127,211.50	0.09
404	600582	天地科技	724,500	2,122,785.00	0.09
405	002302	西部建设	220,900	2,120,640.00	0.09
406	300376	易事特	406,100	2,111,720.00	0.09
407	600307	酒钢宏兴	1,370,400	2,110,416.00	0.09
408	002901	大博医疗	17,600	2,099,504.00	0.09
409	000990	诚志股份	164,380	2,085,982.20	0.09
410	600748	上实发展	403,510	2,061,936.10	0.09
411	000718	苏宁环球	664,013	2,051,800.17	0.09
412	600901	江苏租赁	391,800	2,041,278.00	0.09
413	000869	张裕 A	59,619	2,035,988.85	0.09
414	600664	哈药股份	658,292	2,027,539.36	0.09
415	603888	新华网	90,500	2,023,580.00	0.08
416	600141	兴发集团	225,609	2,019,200.55	0.08
417	000717	韶钢松山	529,400	2,011,720.00	0.08
418	600017	日照港	807,700	2,011,173.00	0.08
419	002419	天虹股份	210,100	2,006,455.00	0.08
420	601678	滨化股份	473,093	2,005,914.32	0.08
421	000062	深圳华强	137,360	1,997,214.40	0.08
422	000543	皖能电力	495,860	1,993,357.20	0.08
423	002544	杰赛科技	151,400	1,990,910.00	0.08
424	000848	承德露露	282,791	1,979,537.00	0.08
425	300257	开山股份	150,601	1,968,355.07	0.08
426	002128	露天煤业	252,230	1,954,782.50	0.08

427	600277	亿利洁能	599,346	1,953,867.96	0.08
428	002093	国脉科技	220,529	1,951,681.65	0.08
429	002416	爱施德	270,920	1,945,205.60	0.08
430	600869	XD智慧能	485,500	1,942,000.00	0.08
431	002408	齐翔腾达	310,598	1,928,813.58	0.08
432	002653	海思科	70,500	1,876,005.00	0.08
433	300197	铁汉生态	727,450	1,847,723.00	0.08
434	002948	青岛银行	360,500	1,834,945.00	0.08
435	603328	依顿电子	174,504	1,820,076.72	0.08
436	603515	欧普照明	66,021	1,806,994.77	0.08
437	000553	安道麦A	199,400	1,798,588.00	0.08
438	603650	彤程新材	76,820	1,787,601.40	0.07
439	000537	广宇发展	244,500	1,784,850.00	0.07
440	600565	迪马股份	639,500	1,784,205.00	0.07
441	603766	隆鑫通用	449,100	1,738,017.00	0.07
442	601019	山东出版	274,800	1,717,500.00	0.07
443	603056	德邦股份	126,366	1,709,731.98	0.07
444	600053	九鼎投资	57,007	1,701,088.88	0.07
445	002491	通鼎互联	331,144	1,695,457.28	0.07
446	600787	中储股份	384,899	1,689,706.61	0.07
447	600350	山东高速	273,800	1,681,132.00	0.07
448	603983	丸美股份	19,400	1,668,982.00	0.07
449	600339	中油工程	732,900	1,663,683.00	0.07
450	002470	金正大	728,000	1,652,560.00	0.07
451	601869	长飞光纤	53,300	1,642,173.00	0.07
452	600770	综艺股份	341,175	1,637,640.00	0.07
453	601139	深圳燃气	251,500	1,634,750.00	0.07
454	600338	西藏珠峰	160,101	1,601,010.00	0.07
455	603317	天味食品	28,725	1,596,535.50	0.07
456	000600	建投能源	313,500	1,595,715.00	0.07
457	002051	中工国际	216,412	1,575,479.36	0.07

458	600694	大商股份	64,337	1,543,444.63	0.06
459	601016	节能风电	727,300	1,541,876.00	0.06
460	600657	信达地产	374,200	1,541,704.00	0.06
461	002118	紫鑫药业	336,304	1,493,189.76	0.06
462	002285	世联行	534,788	1,492,058.52	0.06
463	600985	淮北矿业	190,000	1,480,100.00	0.06
464	601801	皖新传媒	263,100	1,462,836.00	0.06
465	603786	科博达	19,300	1,454,255.00	0.06
466	600428	中远海特	469,500	1,446,060.00	0.06
467	600707	彩虹股份	314,000	1,431,840.00	0.06
468	600575	淮河能源	680,400	1,422,036.00	0.06
469	600006	东风汽车	349,898	1,410,088.94	0.06
470	000937	冀中能源	464,059	1,401,458.18	0.06
471	601865	福莱特	72,400	1,361,120.00	0.06
472	600757	长江传媒	265,630	1,352,056.70	0.06
473	600996	贵广网络	184,100	1,312,633.00	0.06
474	600874	创业环保	190,202	1,262,941.28	0.05
475	600623	华谊集团	244,400	1,261,104.00	0.05
476	603556	海兴电力	85,740	1,238,085.60	0.05
477	002941	新疆交建	84,600	1,197,090.00	0.05
478	600058	五矿发展	187,372	1,131,726.88	0.05
479	000785	居然之家	131,500	1,041,480.00	0.04
480	603868	飞科电器	21,003	1,036,077.99	0.04
481	601003	柳钢股份	224,200	993,206.00	0.04
482	600903	贵州燃气	100,520	989,116.80	0.04
483	002946	新乳业	56,500	980,275.00	0.04
484	000025	特力A	51,693	947,532.69	0.04
485	601127	小康股份	110,600	919,086.00	0.04
486	600335	国机汽车	191,599	885,187.38	0.04
487	603355	莱克电气	35,112	873,937.68	0.04
488	601969	海南矿业	178,400	870,592.00	0.04

489	601512	中新集团	72,800	837,200.00	0.04
490	002818	富森美	65,976	811,504.80	0.03
491	603379	三美股份	37,480	804,695.60	0.03
492	603225	新凤鸣	73,312	731,653.76	0.03
493	601811	新华文轩	69,601	707,842.17	0.03
494	002423	中粮资本	80,700	702,090.00	0.03
495	001872	招商港口	46,100	670,755.00	0.03
496	603025	大豪科技	80,973	588,673.71	0.02
497	600917	重庆燃气	81,391	581,131.74	0.02
498	601068	中铝国际	135,700	530,587.00	0.02
499	603256	宏和科技	42,800	489,632.00	0.02
500	002957	科瑞技术	18,100	432,590.00	0.02

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（元）	占基金资产净值比例（%）
1	688106	金宏气体	26,075	1,078,462.00	0.05
2	688100	威胜信息	11,602	300,723.84	0.01
3	688080	映翰通	2,233	193,779.74	0.01
4	688568	中科星图	11,020	178,634.20	0.01
5	688377	迪威尔	7,894	129,619.48	0.01
6	603087	甘李药业	1,076	107,922.80	0.00
7	688277	天智航	8,810	106,072.40	0.00
8	688027	国盾量子	2,830	102,389.40	0.00
9	688600	皖仪科技	5,468	84,754.00	0.00
10	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.00
11	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.00

12	300839	N博汇	502	11,751.82	0.00
13	300847	中船汉光	1,421	9,861.74	0.00
14	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.00
15	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.00
16	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.00
17	300846	首都在线	1,131	3,811.47	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	002185	华天科技	13,964,058.20	0.60
2	300558	贝达药业	10,710,656.35	0.46
3	600529	山东药玻	10,323,018.00	0.45
4	300357	我武生物	9,178,493.04	0.40
5	300088	长信科技	8,657,383.77	0.37
6	300595	欧普康视	8,549,534.19	0.37
7	300482	万孚生物	8,510,163.71	0.37
8	300496	中科创达	8,225,194.62	0.36
9	300271	华宇软件	8,111,975.00	0.35
10	002557	洽洽食品	7,790,063.81	0.34
11	300014	亿纬锂能	7,781,450.28	0.34
12	300024	机器人	7,736,797.70	0.33
13	002156	通富微电	7,727,670.00	0.33
14	300017	网宿科技	7,467,904.01	0.32
15	300212	易华录	7,427,731.00	0.32
16	002138	顺络电子	7,320,630.43	0.32
17	002131	利欧股份	7,233,667.32	0.31
18	300070	碧水源	7,109,104.52	0.31
19	600153	建发股份	7,096,531.99	0.31

20	600745	闻泰科技	6,947,980.43	0.30
----	--------	------	--------------	------

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	002371	北方华创	26,614,544.61	1.15
2	600745	闻泰科技	26,553,517.72	1.15
3	300014	亿纬锂能	26,270,105.86	1.13
4	002129	中环股份	22,822,108.94	0.99
5	600584	长电科技	22,636,202.36	0.98
6	002384	东山精密	22,605,759.79	0.98
7	002463	沪电股份	20,706,462.03	0.89
8	002049	紫光国微	19,640,793.12	0.85
9	300383	光环新网	19,551,806.52	0.84
10	600763	通策医疗	18,801,178.36	0.81
11	002812	恩捷股份	17,828,565.88	0.77
12	300529	健帆生物	17,037,621.78	0.74
13	000066	中国长城	16,810,028.66	0.73
14	600536	中国软件	16,576,793.90	0.72
15	002065	东华软件	16,252,819.95	0.70
16	601100	恒立液压	13,309,887.99	0.57
17	002180	纳思达	12,355,696.42	0.53
18	601872	招商轮船	9,592,553.16	0.41
19	601231	环旭电子	9,151,842.08	0.40
20	300308	中际旭创	9,039,986.76	0.39

注：本项的“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	1,253,331,904.47
卖出股票收入（成交）总额	1,569,310,983.24

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

7.10.1 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
IC2007	IC2007	100	115,988,00 0.00	5,505,800. 00	-
公允价值变动总额合计（元）					5,505,800.00
股指期货投资本期收益（元）					7,749,009.71
股指期货投资本期公允价值变动（元）					5,177,720.00

7.10.2 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。

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 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

7.12.3 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	16,087,145.32
2	应收证券清算款	26,185,535.60
3	应收股利	-
4	应收利息	102,070.78
5	应收申购款	30,830,761.84
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	73,205,513.54

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.12.5.1 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。

7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例 (%)	流通受限情况说明
1	688106	金宏气体	1,078,462.00	0.05	科创板打新限售
2	688100	威胜信息	300,723.84	0.01	科创板打新限售
3	688080	映翰通	193,779.74	0.01	科创板打新限售
4	688568	中科星图	178,634.20	0.01	新股未上市
5	688377	迪威尔	129,619.48	0.01	新股未上市

7.12.6 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。

§ 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	441,	3,546.26	64,766,290.69	4.14%	1,499,526,745.	95.86%

中证500A	111					06	
天弘中证500C	163,741	4,663.24	7,070,301.75	0.93%	756,492,592.24		99.07%
合计	604,852	3,848.64	71,836,592.44	3.09%	2,256,019,337.30		96.91%

注：机构/个人投资者持有基金份额占总份额比例的计算中，针对分级基金，比例的分母采用各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用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基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数 (份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	天弘中证500A	1,488,525.98	0.10%
	天弘中证500C	478,201.92	0.06%
	合计	1,966,727.90	0.08%

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500A	50~100
	天弘中证500C	0
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	天弘中证500A	0~10
	天弘中证500C	0
	合计	0~10

8.4 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0.00份。

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	天弘中证500A	天弘中证500C
基金合同生效日(2015年01月20日)基金份额总额	10,000,000.00	-
本报告期期初基金份额总额	1,783,219,219.27	752,667,885.28
本报告期基金总申购份额	1,841,415,349.79	1,929,979,377.81
减：本报告期基金总赎回份额	2,060,341,533.31	1,919,084,369.10
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	1,564,293,035.75	763,562,893.99

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，经天弘基金管理有限公司股东会2020年第2次会议审议通过，黄浩先生担任公司董事，祖国明先生不再担任公司董事。

本报告期内本基金的基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生变化。

10.6 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 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	
安信证券	2	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券	2	91,344,635.18	3.25%	39,397.72	3.25%	-
方正证券	4	2,705,496,694.87	96.24%	1,166,888.72	96.33%	-
光大证券	2	-	-	-	-	-
广发证券	1	-	-	-	-	-
国泰君安证券	8	2,624,677.50	0.09%	-	-	-
海通证券	1	-	-	-	-	-
银河证券	1	6,038,865.28	0.21%	2,604.65	0.22%	-
中泰证券	1	-	-	-	-	-

中信建投证券	2	5,827,532.09	0.21%	2,496.67	0.21%	-
--------	---	--------------	-------	----------	-------	---

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：1个，其中包括方正证券深圳交易单元1个。

4、本基金报告期内停止租用交易单元：无。

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易		基金交易	
	成交金额	占当期债券成交总额的比例	成交金额	占当期债券回购成交总额的比例	成交金额	占当期权证成交总额的比例	成交金额	占当期基金成交总额的比例
安信证券	-	-	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	1,698,372.00	100.00%	-	-	-	-	-	-
光大证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	-	-	-	-	-	-	-	-
国泰君安证券	-	-	-	-	-	-	-	-
海通证券	-	-	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中泰证券	-	-	-	-	-	-	-	-
中信建投证券	-	-	-	-	-	-	-	-

10.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	天弘基金管理有限公司关于系统升级维护的通知	中国证监会指定媒介	2020-01-03
2	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	2020-01-07
3	天弘基金管理有限公司关于旗下基金在泰信财富基金销售有限公司暂停办理基金销售业务的公告	中国证监会指定媒介	2020-01-11
4	天弘基金管理有限公司关于深圳分公司经营场所变更的公告	中国证监会指定媒介	2020-01-18
5	天弘中证500指数型发起式证券投资基金2019年第4季度报告	中国证监会指定媒介	2020-01-20
6	天弘基金管理有限公司及全资子公司投资旗下偏股型公募基金的公告	中国证监会指定媒介	2020-02-04
7	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、转换业务的公告	中国证监会指定媒介	2020-02-17
8	天弘基金管理有限公司关于增加泉州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、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	2020-03-04
9	天弘基金管理有限公司关于	中国证监会指定媒介	2020-03-25

	推迟披露旗下公募基金2019年年度报告的公告		
10	天弘基金管理有限公司关于调整网上直销交易系统通联支付渠道费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2020-04-02
11	天弘基金管理有限公司关于提醒客户及时提供或更新身份信息资料的公告	中国证监会指定媒介	2020-04-04
12	天弘基金管理有限公司关于终止泰诚财富基金销售（大连）有限公司办理旗下基金相关销售业务的公告	中国证监会指定媒介	2020-04-04
13	天弘基金管理有限公司关于增加重庆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、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	2020-04-17
14	天弘中证500指数型发起式证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会指定媒介	2020-04-21
15	天弘中证500指数型发起式证券投资基金招募说明书（更新）摘要	中国证监会指定媒介	2020-04-21
16	天弘中证500指数型发起式证券投资基金2020年第一季度报告	中国证监会指定媒介	2020-04-22
17	天弘基金管理有限公司关于增加中国银河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、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	2020-04-23

18	天弘中证500指数型发起式证券投资基金2019年年度报告	中国证监会指定媒介	2020-04-24
19	天弘基金管理有限公司关于增加华金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、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	2020-06-10
20	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会指定媒介	2020-06-18

§ 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

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。

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

12.2 存放地点

天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层

12.3 查阅方式

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

公司网站：www.thfund.com.cn

天弘基金管理有限公司
二〇二〇年八月三十一日