

天弘中证 800 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:广发证券股份有限公司

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。

基金托管人广发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	9
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	14
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	14
§5 托管人报告	14
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	14
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	14
5.3 托管人对本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	18
6.4 报表附注	20
§7 投资组合报告	45
7.1 期末基金资产组合情况	45
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	46
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	47
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动	74
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	76
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	76
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	76
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	77
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	77
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	77
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	77
7.12 投资组合报告附注	77
§8 基金份额持有人信息	78
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	78
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	79

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	79
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况	79
§9 开放式基金份额变动	79
§10 重大事件揭示	80
10.1 基金份额持有人大会决议	80
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	80
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	80
10.4 基金投资策略的改变	80
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	80
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	80
10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	81
10.8 其他重大事件	82
§11 影响投资者决策的其他重要信息	84
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	84
11.2 影响投资者决策的其他重要信息	85
§12 备查文件目录	85
12.1 备查文件目录	85
12.2 存放地点	85
12.3 查阅方式	86

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	天弘中证800指数型发起式证券投资基金	
基金简称	天弘中证800	
基金主代码	001588	
基金运作方式	契约型开放式、发起式	
基金合同生效日	2015年07月16日	
基金管理人	天弘基金管理有限公司	
基金托管人	广发证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	25,859,500.63份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	天弘中证800A	天弘中证800C
下属分级基金的交易代码	001588	001589
报告期末下属分级基金的份额总额	15,566,508.86份	10,292,991.77份

2.2 基金产品说明

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

2.3 基金管理人和基金托管人

项目	基金管理人	基金托管人
----	-------	-------

名称	天弘基金管理有限公司		广发证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	童建林	崔瑞娟
	联系电话	022-83310208	020-66338888
	电子邮箱	service@thfund.com.cn	cuirj@gf.com.cn
客户服务电话	95046		95575
传真	022-83865569		020-87555129
注册地址	天津自贸区（中心商务区）响螺湾旷世国际大厦A座1704-241号		广东省广州市黄埔区中新广州知识城腾飞一街2号618室
办公地址	天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层		广州市天河区马场路26号广发证券大厦34楼
邮政编码	300203		510627
法定代表人	胡晓明		孙树明

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报
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800A	天弘中证800C
本期已实现收益	11,704,730.23	2,889,780.49
本期利润	5,697,051.71	953,811.21
加权平均基金份额本期利润	0.0504	0.0407
本期加权平均净值利润率	5.07%	4.15%
本期基金份额净值增长率	8.91%	8.82%
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	1,382,819.96	786,554.12
期末可供分配基金份额利润	0.0888	0.0764
期末基金资产净值	16,949,328.82	11,079,545.89
期末基金份额净值	1.0888	1.0764
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	8.88%	7.64%

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800A

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	9.59%	0.83%	7.47%	0.83%	2.12%	0.00%
过去三个月	16.41%	0.87%	13.08%	0.88%	3.33%	-0.01%
过去六个月	8.91%	1.46%	3.82%	1.48%	5.09%	-0.02%
过去一年	19.93%	1.17%	10.68%	1.19%	9.25%	-0.02%
过去三年	27.48%	1.19%	8.59%	1.21%	18.89%	-0.02%
自基金合同 生效日起至 今	8.88%	1.36%	-1.87%	1.37%	10.75%	-0.01%

天弘中证800C

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	9.58%	0.83%	7.47%	0.83%	2.11%	0.00%
过去三个月	16.37%	0.87%	13.08%	0.88%	3.29%	-0.01%
过去六个月	8.82%	1.46%	3.82%	1.48%	5.00%	-0.02%
过去一年	19.67%	1.17%	10.68%	1.19%	8.99%	-0.02%
过去三年	26.67%	1.19%	8.59%	1.21%	18.08%	-0.02%
自基金合同 生效日起至 今	7.64%	1.36%	-1.87%	1.37%	9.51%	-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800A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07月16日-2020年06月30日)



天弘中证800C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07月16日-2020年06月30日)



- 注：1、本基金合同于2015年07月16日生效。
2、本报告期内，本基金的各项投资比例达到基金合同约定的各项比例要求。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

股东名称	股权比例
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	-	13年	男, 软件工程硕士。历任华夏基金管理有限公司金

		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。
--	--	---	--	--	--

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不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策略跟踪指数，完全复制指数，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。

报告期内，本基金跟踪误差的来源主要是申购赎回分红和打新因素。当由于申赎或打新锁定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基于风险控制的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800A基金份额净值为1.0888元，天弘中证800C基金份额净值为1.0764元。报告期内份额净值增长率天弘中证800A为8.91%，同期业绩比较基准增长率为3.82%；天弘中证800C为8.82%，同期业绩比较基准增长率为3.82%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2020年上半年全球经济受到突发新冠疫情的剧烈影响而遭受重创，经济活动大幅萎缩并一度接近停摆，主要经济体国家失业率急剧攀升，为了应对经济的大幅下滑，全球主要经济体都采取了积极的货币和财政的刺激政策，用以促进经济增长并努力降低疫情的负面影响，我国经济一季度GDP同比下降6.8%，创了近改革开放以来的新低，由于我们采用方法得当，疫情传播被很快控制住，在疫情常态防控下率先复工复产，并推出了一系列的经济刺激政策，二季度经济快速反弹，实现了GDP同比增长3.2%的成绩，随着经济刺激政策的逐步落地，二季度宏观经济主要指标出现了明显的好转，PMI已经连续四个月维持在荣枯线以上、新订单在逐步恢复、用电量基本恢复到正常水平、6月份进出口同比同时转正以及PPI环比转正、社融和信贷增速继续提升，在国内和国外需求逐步恢复的带动下，国内经济仍将呈现出快速反弹状态，尽管外部环境面临一定的不确定性，但仍继续看好下半年的经济增长和全年的经济增长率保持在一个合理的正值水平。

由于在我国率先控制住疫情、并率先复工复产、政策持续宽松、逆周期调节强化、资本市场改革不断推进、中长期资金持续入市的背景下，经济将继续快速反弹，投资者信心增强，继续看好2020年下半年的资本市场。过往经验也证明了疫情对资本市场的影响是短暂的，不会改变资本市场的中长期运行方向。

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

本基金本报告期末进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内本基金管理人无应说明预警信息。

§ 5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

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

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

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

本报告期内，天弘中证800指数型发起式证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本中期报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人依法对天弘基金管理有限公司编制和披露的天弘中证800指数型发起式证券投资基金2020年中期报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 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800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 2020年06月30日	上年度末 2019年12月31日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	1,888,435.71	9,015,806.92
结算备付金		—	228,796.89
存出保证金		107,499.47	141,864.35
交易性金融资产	6.4.7.2	26,328,162.60	135,346,101.31
其中：股票投资		26,328,162.60	135,346,101.31
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		—	—

应收利息	6.4.7.5	905.70	2,126.17
应收股利		-	-
应收申购款		725,959.74	246,933.76
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		29,050,963.22	144,981,629.40
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		835,931.76	1,109,661.44
应付管理人报酬		34,092.36	64,533.72
应付托管费		6,818.47	12,906.73
应付销售服务费		1,907.59	6,059.25
应付交易费用	6.4.7.7	46,403.63	57,587.15
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	96,934.70	169,054.08
负债合计		1,022,088.51	1,419,802.37
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	25,859,500.63	143,898,357.59
未分配利润	6.4.7.10	2,169,374.08	-336,530.56
所有者权益合计		28,028,874.71	143,561,827.03
负债和所有者权益总计		29,050,963.22	144,981,629.40

注：报告截止日2020年06月30日，天弘中证800指数型发起式证券投资基金A类基金份额净值1.0888元，天弘中证800指数型发起式证券投资基金C类基金份额净值1.0764元；基金份额总额25,859,500.63份，其中天弘中证800指数型发起式证券投资基金A类基金份额15,566,508.86份，天弘中证800指数型发起式证券投资基金C类基金份额10,292,991.77份。

6.2 利润表

会计主体：天弘中证800指数型发起式证券投资基金

本报告期：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		7,431,740.74	15,078,529.73
1. 利息收入		33,214.54	16,687.40
其中：存款利息收入	6.4.7.11	33,212.98	16,687.40
债券利息收入		1.56	—
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）		15,317,022.13	-3,666,104.65
其中：股票投资收益	6.4.7.12	14,521,787.73	-4,354,902.06
基金投资收益		—	—
债券投资收益	6.4.7.13	2,046.24	—
资产支持证券投资	6.4.7.13.	—	—
收益	3		
贵金属投资收益		—	—
衍生工具收益	6.4.7.14	—	—

股利收益	6.4.7.15	793,188.16	688,797.41
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	6.4.7.16	-7,943,647.80	18,715,201.42
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	25,151.87	12,745.56
减：二、费用		780,877.82	399,308.61
1. 管理人报酬		332,800.48	171,498.77
2. 托管费		66,560.10	34,299.74
3. 销售服务费		22,731.15	25,190.83
4. 交易费用	6.4.7.18	254,114.26	72,977.92
5. 利息支出		-	-
其中：卖出回购金融资产支出		-	-
6. 税金及附加		-	-
7. 其他费用	6.4.7.19	104,671.83	95,341.35
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		6,650,862.92	14,679,221.12
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		6,650,862.92	14,679,221.12

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：天弘中证800指数型发起式证券投资基金

本报告期：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）	143,898,357.59	-336,530.56	143,561,827.03

二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	6,650,862.92	6,650,862.92
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)	-118,038,856.96	-4,144,958.28	-122,183,815.24
其中: 1. 基金申购款	69,286,543.65	-1,230,941.38	68,055,602.27
2. 基金赎回款	-187,325,400.61	-2,914,016.90	-190,239,417.51
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)	25,859,500.63	2,169,374.08	28,028,874.71
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)	119,300,943.29	-34,139,498.77	85,161,444.52
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	14,679,221.12	14,679,221.12
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)	-35,689,333.59	11,498,433.53	-24,190,900.06
其中: 1. 基金申购款	55,064,745.37	-6,766,852.44	48,297,892.93
2. 基金赎回款	-90,754,078.96	18,265,285.97	-72,488,792.99
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)	83,611,609.70	-7,961,844.12	75,649,765.58

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

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

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

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘中证800指数型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资对象是具有良好流动性的金融工具，以中证800指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。为更好地实现投资目标，本基金也可少量投资于其他股票(非标的指数成份股及其备选成份股，含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、银行存款、债券、债券回购、权证、股指期货、资产支持证券、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许本基金投资的其他金融工具(但须符合中国证监会的相关规定)。本基金投资于股票的资产比例不低于基金资产的90%，投资于中证800指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的80%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券，其中现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准：中证800指数收益率 $\times$ 95%+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800指数型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

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	1,888,435.71
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	1,888,435.71

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		23,582,944.34	26,328,162.60	2,745,218.26
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	23,582,944.34	26,328,162.60	2,745,218.26

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2020年06月30日
应收活期存款利息	857.30
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	-
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	48.40
合计	905.70

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	46,403.63
银行间市场应付交易费用	-
合计	46,403.63

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	262.87
应付证券出借违约金	-
预提费用	88,671.83
其他应付	8,000.00
合计	96,934.70

6.4.7.9 实收基金

6.4.7.9.1 天弘中证800A

金额单位：人民币元

项目 (天弘中证800A)	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	116,608,248.70	116,608,248.70
本期申购	39,597,007.27	39,597,007.27
本期赎回(以“-”号填列)	-140,638,747.11	-140,638,747.11
本期末	15,566,508.86	15,566,508.86

6.4.7.9.2 天弘中证800C

金额单位：人民币元

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

(天弘中证800C)	基金份额(份)	账面金额
上年度末	27,290,108.89	27,290,108.89
本期申购	29,689,536.38	29,689,536.38
本期赎回(以“-”号填列)	-46,686,653.50	-46,686,653.50
本期末	10,292,991.77	10,292,991.77

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800A

单位：人民币元

项目 (天弘中证800A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	16,906.51	-57,412.02	-40,505.51
本期利润	11,704,730.23	-6,007,678.52	5,697,051.71
本期基金份额交易产生的变动数	-8,038,729.20	3,765,002.96	-4,273,726.24
其中：基金申购款	676,331.63	-1,250,873.65	-574,542.02
基金赎回款	-8,715,060.83	5,015,876.61	-3,699,184.22
本期已分配利润	-	-	-
本期末	3,682,907.54	-2,300,087.58	1,382,819.96

6.4.7.10.2 天弘中证800C

单位：人民币元

项目 (天弘中证800C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-247,073.66	-48,951.39	-296,025.05
本期利润	2,889,780.49	-1,935,969.28	953,811.21
本期基金份额交易产生的变动数	-338,839.87	467,607.83	128,767.96
其中：基金申购款	393,895.87	-1,050,295.23	-656,399.36
基金赎回款	-732,735.74	1,517,903.06	785,167.32
本期已分配利润	-	-	-

本期末	2,303,866.96	-1,517,312.84	786,554.12
-----	--------------	---------------	------------

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	31,520.53
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	536.15
其他	1,156.30
合计	33,212.98

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	162,166,591.83
减：卖出股票成本总额	147,644,804.10
买卖股票差价收入	14,521,787.73

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	2,046.24
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	2,046.24

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	14,047.80
减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额	11,999.94
减：应收利息总额	1.62
买卖债券差价收入	2,046.24

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

本基金本报告期未取得其他衍生工具投资收益。

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	793,188.16
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	793,188.16

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	-7,943,647.80
——股票投资	-7,943,647.80
——债券投资	—
——资产支持证券投资	—
——基金投资	—
——贵金属投资	—
——其他	—
2. 衍生工具	—
——权证投资	—
3. 其他	—
减：应税金融商品公允价值变动产生的预估增值税	—
合计	-7,943,647.80

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	24,927.73
基金转换费收入	224.14
合计	25,151.87

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	254,114.26
银行间市场交易费用	—
合计	254,114.26

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	29,835.26
信息披露费	58,836.57
证券出借违约金	-
指数使用费	16,000.00
合计	104,671.83

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

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

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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

金额单位：人民币元

关联方名	本期	上年度可比期间
------	----	---------

称	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	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例	成交金额	占当期股票成交总额的比例
广发证券股份有限公司	165,447,175.30	80.62%	36,553,985.62	60.89%

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

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2020年01月01日至2020年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券股份有限公司	44,061.07	71.98%	34,435.24	74.21%
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			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占期末应付佣金总额的比例
广发证券股份有限公司	15,767.37	60.89%	5,901.31	59.01%

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

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

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 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管理费	332,800.48	171,498.77
其中：支付销售机构的客户维护费	28,233.79	25,153.35

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X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	66,560.10	34,299.74

注：支付基金托管人广发证券股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值X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	本期 2020年01月01日至2020年06月30日
----------	-------------------------------

各关联方 名称	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	天弘中证800A	天弘中证800C	合计
天弘基金 管理有限公司	-	10,704.37	10,704.37
广发证券 股份有限公司	-	227.55	227.55
合计	-	10,931.92	10,931.92
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800A	天弘中证800C	合计
天弘基金 管理有限公司	-	14,649.61	14,649.61
广发证券 股份有限公司	-	11.72	11.72
合计	-	14,661.33	14,661.33

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800C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800A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800A

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	5,000,000.00	5,000,000.00
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	5,000,000.00	-
报告期末持有的基金份额	-	5,000,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	9.55%

天弘中证800C

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	17,236,632.82	17,236,632.82
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	17,236,632.82	-

报告期末持有的基金份额	-	17,236,632.82
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	-	55.10%

注：1、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。

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
广发证券股份有限公司	1,888,435.71	31,520.53	4,975,158.14	15,685.09

注：本基金的银行存款由基金托管人广发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

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券交易。

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

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
688189	南新制药	2020-03-18	2020-09-28	科创板打新限售	34.94	50.21	2,422	84,624.68	121,608.62	-
688466	金科环境	2020-04-27	2020-11-09	科创板打新限售	24.61	36.59	3,001	73,854.61	109,806.59	-
688558	国盛智科	2020-06-19	2020-12-30	科创板打新限售	17.37	35.26	2,631	45,700.47	92,769.06	-
688096	京源环保	2020-03-31	2020-10-09	科创板打新限售	14.34	21.42	4,235	60,729.90	90,713.70	-
688277	天智航	2020-06-24	2020-07-07	新股未上市	12.04	12.04	3,080	37,083.20	37,083.20	-
688568	中科星图	2020-06-30	2020-07-08	新股未上市	16.21	16.21	2,066	33,489.86	33,489.86	-
688377	迪威尔	2020-06-29	2020-07-08	新股未上市	16.42	16.42	1,802	29,588.84	29,588.84	-
688027	国盾量子	2020-06-30	2020-07-09	新股未上市	36.18	36.18	707	25,579.26	25,579.26	-

688600	皖仪科技	2020-06-23	2020-07-03	新股未上市	15.50	15.50	1,595	24,722.50	24,722.50	-
002500	山西证券	2020-06-29	2020-07-10	配股未上市	5.00	6.54	1,830	9,150.00	11,968.20	-
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	11,600	23,679.89	19,952.00	-
0024	金正	2020	实行	2.27	2020	2.16	2,100	8,342.02	4,767.00	-

70	大	-06-30	退市 风险 警示 公告		-07-01					
----	---	--------	----------------------	--	--------	--	--	--	--	--

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控制策略；讨论向公司高级管理层提交的基金运作风险报

告。在业务操作层面风险管理职责主要由内控合规部和风险管理部负责，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。

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	1,888,435.71	-	-	-	1,888,435.71
存出保证金	107,499.47	-	-	-	107,499.47
交易性金融资产	-	-	-	26,328,162.60	26,328,162.60
应收利息	-	-	-	905.70	905.70
应收申购款	-	-	-	725,959.74	725,959.74
资产总计	1,995,935.18	-	-	27,055,028.04	29,050,963.22
负债					
应付赎回款	-	-	-	835,931.76	835,931.76
应付管理人报酬	-	-	-	34,092.36	34,092.36
应付托管费	-	-	-	6,818.47	6,818.47
应付销售服务费	-	-	-	1,907.59	1,907.59
应付交易费用	-	-	-	46,403.63	46,403.63
其他负债	-	-	-	96,934.70	96,934.70
负债总计	-	-	-	1,022,088.51	1,022,088.51
利率敏感度缺口	1,995,935.18	-	-	26,032,939.53	28,028,874.71
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	9,015,806.92	-	-	-	9,015,806.92
结算备付金	228,796.89	-	-	-	228,796.89
存出保证金	141,864.35	-	-	-	141,864.35
交易性金融资产	-	-	-	135,346,101.31	135,346,101.31
应收利息	-	-	-	2,126.17	2,126.17
应收申购款	-	-	-	246,933.76	246,933.76
资产总计	9,386,468.16	-	-	135,595,161.24	144,981,629.40
负债					
应付赎回款	-	-	-	1,109,661.44	1,109,661.44
应付管理人报酬	-	-	-	64,533.72	64,533.72
应付托管费	-	-	-	12,906.73	12,906.73
应付销售服务费	-	-	-	6,059.25	6,059.25

应付交易费用	-	-	-	57,587.15	57,587.15
其他负债	-	-	-	169,054.08	169,054.08
负债总计	-	-	-	1,419,802.37	1,419,802.37
利率敏感度缺口	9,386,468.16	-	-	134,175,358.87	143,561,827.03

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

6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

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 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资	26,328,162.60	93.93	135,346,101.31	94.28

产—股票投资				
交易性金融资产—基金投资	-	-	-	-
交易性金融资产—贵金属投资	-	-	-	-
衍生金融资产—权证投资	-	-	-	-
其他	-	-	-	-
合计	26,328,162.60	93.93	135,346,101.31	94.28

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%	1,393,381.69	7,047,042.59
	业绩比较基准下降5%	-1,393,381.69	-7,047,042.59

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25,699,459.79元，属于第二层次的余额为628,702.81元，无属于第三层次的余额(2019年12月31日：第一层次134,136,433.90元，第二层次1,209,667.41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	26,328,162.60	90.63
	其中：股票	26,328,162.60	90.63
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	1,888,435.71	6.50
8	其他各项资产	834,364.91	2.87
9	合计	29,050,963.22	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	344,509.00	1.23
B	采矿业	613,410.54	2.19
C	制造业	12,895,348.87	46.01
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	542,852.20	1.94
E	建筑业	467,663.19	1.67
F	批发和零售业	545,087.71	1.94
G	交通运输、仓储和邮政业	674,713.53	2.41
H	住宿和餐饮业	20,322.00	0.07
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,503,184.21	5.36
J	金融业	5,889,528.23	21.01
K	房地产业	944,669.03	3.37
L	租赁和商务服务业	412,147.20	1.47
M	科学研究和技术服务业	174,336.00	0.62
N	水利、环境和公共设施管理业	59,825.44	0.21
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	28,161.60	0.10
Q	卫生和社会工作	281,117.60	1.00
R	文化、体育和娱乐业	214,003.00	0.76
S	综合	54,238.20	0.19

	合计	25,665,117.55	91.57
--	----	---------------	-------

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	494,884.71	1.77
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	12,766.32	0.05
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	45,587.43	0.16
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	109,806.59	0.39
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	663,045.05	2.37

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	601318	中国平安	14,345	1,024,233.00	3.65
2	600519	贵州茅台	700	1,024,016.00	3.65
3	600036	招商银行	13,700	461,964.00	1.65
4	600276	恒瑞医药	4,896	451,900.80	1.61
5	000858	五粮液	2,597	444,398.64	1.59
6	000333	美的集团	6,386	381,818.94	1.36
7	000651	格力电器	6,300	356,391.00	1.27
8	002475	立讯精密	5,482	281,500.70	1.00
9	600030	中信证券	11,400	274,854.00	0.98
10	601166	兴业银行	16,600	261,948.00	0.93
11	600887	伊利股份	8,000	249,040.00	0.89
12	000002	万科A	9,101	237,900.14	0.85
13	601398	工商银行	46,900	233,562.00	0.83
14	600900	长江电力	11,800	223,492.00	0.80
15	601888	中国中免	1,300	200,239.00	0.71
16	601328	交通银行	36,600	187,758.00	0.67
17	000661	长春高新	400	174,120.00	0.62
18	300059	东方财富	8,472	171,134.40	0.61
19	600585	海螺水泥	3,201	169,364.91	0.60
20	000725	京东方A	36,100	168,587.00	0.60
21	603288	海天味业	1,340	166,696.00	0.59
22	000001	平安银行	12,900	165,120.00	0.59
23	600000	浦发银行	15,600	165,048.00	0.59
24	600016	民生银行	28,340	160,687.80	0.57
25	002714	牧原股份	1,957	160,474.00	0.57

26	002415	海康威视	4,875	147,956.25	0.53
27	600031	三一重工	7,800	146,328.00	0.52
28	601688	华泰证券	7,701	144,778.80	0.52
29	600048	保利地产	9,600	141,888.00	0.51
30	601012	隆基股份	3,466	141,170.18	0.50
31	000063	中兴通讯	3,500	140,455.00	0.50
32	600837	海通证券	10,700	134,606.00	0.48
33	601668	中国建筑	27,980	133,464.60	0.48
34	601288	农业银行	38,400	129,792.00	0.46
35	603259	药明康德	1,340	129,444.00	0.46
36	300498	温氏股份	5,880	128,184.00	0.46
37	600570	恒生电子	1,108	119,331.60	0.43
38	300015	爱尔眼科	2,640	114,708.00	0.41
39	603986	兆易创新	480	113,236.80	0.40
40	000100	TCL科技	18,000	111,600.00	0.40
41	601229	上海银行	13,170	109,311.00	0.39
42	300142	沃森生物	2,000	104,720.00	0.37
43	600309	万华化学	2,080	103,979.20	0.37
44	002142	宁波银行	3,950	103,766.50	0.37
45	601211	国泰君安	5,900	101,834.00	0.36
46	601988	中国银行	28,100	97,788.00	0.35
47	601601	中国太保	3,550	96,737.50	0.35
48	601169	北京银行	19,700	96,530.00	0.34
49	600588	用友网络	2,161	95,300.10	0.34
50	002352	顺丰控股	1,700	92,990.00	0.33
51	601766	中国中车	16,100	89,677.00	0.32
52	600690	海尔智家	5,000	88,500.00	0.32
53	000338	潍柴动力	6,300	86,436.00	0.31
54	600009	上海机场	1,186	85,475.02	0.30
55	002241	歌尔股份	2,902	85,202.72	0.30
56	002304	洋河股份	800	84,112.00	0.30

57	600999	招商证券	3,800	83,410.00	0.30
58	000568	泸州老窖	900	82,008.00	0.29
59	601899	紫金矿业	18,300	80,520.00	0.29
60	000876	新希望	2,701	80,489.80	0.29
61	300122	智飞生物	800	80,120.00	0.29
62	600703	三安光电	3,200	80,000.00	0.29
63	002594	比亚迪	1,100	78,980.00	0.28
64	600104	上汽集团	4,602	78,187.98	0.28
65	002410	广联达	1,100	76,670.00	0.27
66	002027	分众传媒	13,660	76,086.20	0.27
67	601818	光大银行	21,200	75,896.00	0.27
68	600745	闻泰科技	600	75,570.00	0.27
69	002555	三七互娱	1,600	74,880.00	0.27
70	002230	科大讯飞	2,000	74,860.00	0.27
71	300347	泰格医药	700	71,316.00	0.25
72	600028	中国石化	17,800	69,598.00	0.25
73	600919	江苏银行	12,200	69,174.00	0.25
74	600436	片仔癀	400	68,100.00	0.24
75	002007	华兰生物	1,355	67,899.05	0.24
76	001979	招商蛇口	4,100	67,404.00	0.24
77	300601	康泰生物	400	64,864.00	0.23
78	601088	中国神华	4,300	61,748.00	0.22
79	600406	国电南瑞	3,000	60,750.00	0.22
80	000166	申万宏源	11,920	60,196.00	0.21
81	600547	山东黄金	1,640	60,056.80	0.21
82	000895	双汇发展	1,300	59,917.00	0.21
83	601628	中国人寿	2,200	59,862.00	0.21
84	600050	中国联通	12,300	59,532.00	0.21
85	300003	乐普医疗	1,600	58,432.00	0.21
86	600809	山西汾酒	400	58,000.00	0.21
87	601009	南京银行	7,900	57,907.00	0.21

88	600438	通威股份	3,300	57,354.00	0.20
89	002271	东方雨虹	1,400	56,882.00	0.20
90	300413	芒果超媒	870	56,724.00	0.20
91	000538	云南白药	602	56,473.62	0.20
92	601939	建设银行	8,900	56,159.00	0.20
93	002129	中环股份	2,500	56,150.00	0.20
94	000938	紫光股份	1,288	55,358.24	0.20
95	000776	广发证券	3,900	55,068.00	0.20
96	601006	大秦铁路	7,800	54,912.00	0.20
97	603444	吉比特	100	54,901.00	0.20
98	300014	亿纬锂能	1,145	54,788.25	0.20
99	601390	中国中铁	10,800	54,216.00	0.19
100	601857	中国石油	12,900	54,051.00	0.19
101	600019	宝钢股份	11,792	53,771.52	0.19
102	002460	赣锋锂业	1,001	53,623.57	0.19
103	300136	信维通信	1,000	53,020.00	0.19
104	002500	山西证券	7,930	51,862.20	0.19
105	300253	卫宁健康	2,250	51,615.00	0.18
106	002044	美年健康	3,560	51,299.60	0.18
107	002371	北方华创	300	51,273.00	0.18
108	002602	世纪华通	3,329	50,966.99	0.18
109	000977	浪潮信息	1,300	50,934.00	0.18
110	600196	复星医药	1,500	50,775.00	0.18
111	002050	三花智控	2,313	50,654.70	0.18
112	601186	中国铁建	6,000	50,280.00	0.18
113	603019	中科曙光	1,300	49,920.00	0.18
114	600015	华夏银行	8,100	49,572.00	0.18
115	002001	新 和 成	1,700	49,470.00	0.18
116	300124	汇川技术	1,300	49,387.00	0.18
117	002127	南极电商	2,300	48,691.00	0.17
118	601989	中国重工	12,100	48,400.00	0.17

119	300433	蓝思科技	1,700	47,668.00	0.17
120	002311	海大集团	1,000	47,590.00	0.17
121	601933	永辉超市	5,000	46,900.00	0.17
122	002624	完美世界	800	46,112.00	0.16
123	002456	欧菲光	2,474	45,496.86	0.16
124	002236	大华股份	2,350	45,143.50	0.16
125	600958	东方证券	4,700	44,603.00	0.16
126	603160	汇顶科技	200	44,580.00	0.16
127	601336	新华保险	1,001	44,324.28	0.16
128	000157	中联重科	6,800	43,724.00	0.16
129	600741	华域汽车	2,100	43,659.00	0.16
130	600352	浙江龙盛	3,400	43,486.00	0.16
131	002024	苏宁易购	4,900	42,973.00	0.15
132	600183	生益科技	1,465	42,880.55	0.15
133	002916	深南电路	252	42,215.04	0.15
134	300558	贝达药业	300	41,994.00	0.15
135	601377	兴业证券	6,100	41,785.00	0.15
136	601788	光大证券	2,600	41,756.00	0.15
137	603501	韦尔股份	200	40,390.00	0.14
138	600201	生物股份	1,447	40,284.48	0.14
139	300033	同花顺	300	39,924.00	0.14
140	600383	金地集团	2,900	39,730.00	0.14
141	002008	大族激光	1,100	39,545.00	0.14
142	600346	恒力石化	2,820	39,480.00	0.14
143	601138	工业富联	2,600	39,390.00	0.14
144	601901	方正证券	5,400	38,232.00	0.14
145	601225	陕西煤业	5,300	38,213.00	0.14
146	002185	华天科技	2,800	37,884.00	0.14
147	600739	辽宁成大	2,000	37,860.00	0.14
148	600660	福耀玻璃	1,800	37,566.00	0.13
149	002463	沪电股份	1,500	37,470.00	0.13

150	601877	正泰电器	1,400	36,890.00	0.13
151	000425	徐工机械	6,200	36,642.00	0.13
152	600522	中天科技	3,200	36,640.00	0.13
153	002736	国信证券	3,200	36,160.00	0.13
154	300408	三环集团	1,300	36,010.00	0.13
155	300088	长信科技	3,200	35,840.00	0.13
156	002120	韵达股份	1,464	35,794.80	0.13
157	002202	金风科技	3,551	35,403.47	0.13
158	600109	国金证券	3,100	35,371.00	0.13
159	601669	中国电建	10,100	34,946.00	0.12
160	600529	山东药玻	600	34,800.00	0.12
161	002385	大北农	3,800	34,618.00	0.12
162	000783	长江证券	5,100	34,374.00	0.12
163	601155	新城控股	1,100	34,364.00	0.12
164	002131	利欧股份	8,900	34,354.00	0.12
165	300144	宋城演艺	1,980	34,254.00	0.12
166	000860	顺鑫农业	600	34,188.00	0.12
167	603993	洛阳钼业	9,300	34,131.00	0.12
168	600340	华夏幸福	1,492	34,107.12	0.12
169	601108	财通证券	3,300	33,825.00	0.12
170	601800	中国交建	4,600	33,764.00	0.12
171	002439	启明星辰	800	33,656.00	0.12
172	300012	华测检测	1,700	33,592.00	0.12
173	601985	中国核电	8,200	33,538.00	0.12
174	300285	国瓷材料	1,000	33,510.00	0.12
175	601555	东吴证券	4,090	33,374.40	0.12
176	600089	特变电工	4,862	32,915.74	0.12
177	000069	华侨城 A	5,400	32,724.00	0.12
178	600079	人福医药	1,202	32,718.44	0.12
179	600010	宝钢股份	30,000	32,400.00	0.12
180	000768	中航飞机	1,800	31,932.00	0.11

181	603369	今世缘	800	31,832.00	0.11
182	603799	华友钴业	816	31,709.76	0.11
183	600867	通化东宝	1,800	31,374.00	0.11
184	600521	华海药业	920	31,215.60	0.11
185	002465	海格通信	2,400	31,056.00	0.11
186	600143	金发科技	2,300	30,291.00	0.11
187	000596	古井贡酒	201	30,198.24	0.11
188	600029	南方航空	5,800	29,986.00	0.11
189	002841	视源股份	300	29,856.00	0.11
190	600298	安琪酵母	600	29,688.00	0.11
191	600606	绿地控股	4,800	29,664.00	0.11
192	000066	中国长城	2,237	29,528.40	0.11
193	002493	荣盛石化	2,400	29,520.00	0.11
194	600795	国电电力	15,700	29,045.00	0.10
195	000963	华东医药	1,147	29,019.10	0.10
196	600487	亨通光电	1,760	28,881.60	0.10
197	002075	沙钢股份	2,300	28,750.00	0.10
198	601099	太平洋	9,000	28,530.00	0.10
199	600161	天坛生物	628	28,467.24	0.10
200	603517	绝味食品	400	28,296.00	0.10
201	000009	中国宝安	3,320	28,253.20	0.10
202	002179	中航光电	688	28,214.88	0.10
203	600705	中航资本	7,100	28,116.00	0.10
204	600061	国投资本	2,200	28,006.00	0.10
205	002157	正邦科技	1,600	27,968.00	0.10
206	600926	杭州银行	3,120	27,830.40	0.10
207	600886	国投电力	3,500	27,510.00	0.10
208	000625	长安汽车	2,500	27,500.00	0.10
209	601607	上海医药	1,490	27,386.20	0.10
210	002422	科伦药业	1,300	27,300.00	0.10
210	002223	鱼跃医疗	750	27,300.00	0.10

212	601128	常熟银行	3,600	27,036.00	0.10
213	603882	金域医学	300	26,850.00	0.10
214	002074	国轩高科	1,000	26,840.00	0.10
215	002466	天齐锂业	1,160	26,622.00	0.09
216	002212	南洋股份	1,000	26,580.00	0.09
217	600426	华鲁恒升	1,500	26,520.00	0.09
218	300207	欣旺达	1,400	26,460.00	0.09
219	300315	掌趣科技	3,600	26,388.00	0.09
220	600498	烽火通信	912	26,365.92	0.09
221	000636	风华高科	900	26,271.00	0.09
222	601162	天风证券	4,330	26,239.80	0.09
223	600111	北方稀土	2,800	26,096.00	0.09
224	002273	水晶光电	1,518	26,018.52	0.09
225	600637	东方明珠	2,690	25,958.50	0.09
226	600893	航发动力	1,100	25,828.00	0.09
227	601111	中国国航	3,900	25,779.00	0.09
228	600176	中国巨石	2,800	25,620.00	0.09
229	601799	星宇股份	200	25,400.00	0.09
230	002507	涪陵榨菜	700	25,207.00	0.09
231	300418	昆仑万维	1,000	24,960.00	0.09
232	300357	我武生物	400	24,900.00	0.09
233	600115	东方航空	5,900	24,898.00	0.09
234	002340	格林美	4,950	24,601.50	0.09
235	600011	华能国际	5,800	24,476.00	0.09
236	000988	华工科技	1,000	24,430.00	0.09
237	600511	国药股份	600	24,402.00	0.09
238	002821	凯莱英	100	24,300.00	0.09
239	000975	银泰黄金	1,543	24,194.24	0.09
240	601727	上海电气	4,798	24,181.92	0.09
241	601100	恒立液压	300	24,060.00	0.09
242	002601	龙蟠佰利	1,300	24,050.00	0.09

243	601360	三六零	1,300	23,803.00	0.08
244	601600	中国铝业	8,600	23,736.00	0.08
245	601816	京沪高铁	3,800	23,674.00	0.08
246	603939	益丰药房	260	23,660.00	0.08
247	601066	中信建投	600	23,628.00	0.08
248	601618	中国中冶	9,400	23,594.00	0.08
249	000786	北新建材	1,100	23,463.00	0.08
250	300496	中科创达	300	23,310.00	0.08
251	600233	圆通速递	1,600	23,296.00	0.08
252	002414	高德红外	795	23,277.60	0.08
253	603833	欧派家居	200	23,180.00	0.08
254	003816	中国广核	7,800	23,088.00	0.08
255	000656	金科股份	2,800	22,848.00	0.08
256	600221	海航控股	15,200	22,800.00	0.08
257	600859	王府井	500	22,775.00	0.08
258	600271	航天信息	1,400	22,736.00	0.08
259	600332	白云山	700	22,631.00	0.08
260	300271	华宇软件	800	22,568.00	0.08
261	002156	通富微电	900	22,545.00	0.08
262	300212	易华录	400	22,400.00	0.08
263	601838	成都银行	2,800	22,288.00	0.08
264	002607	中公教育	800	22,200.00	0.08
265	002797	第一创业	3,200	22,144.00	0.08
266	000513	丽珠集团	461	22,132.61	0.08
267	300168	万达信息	1,000	22,070.00	0.08
268	300009	安科生物	1,230	22,017.00	0.08
269	002252	上海莱士	2,600	21,996.00	0.08
270	600489	中金黄金	2,400	21,936.00	0.08
271	600132	重庆啤酒	300	21,900.00	0.08
272	601919	中远海控	6,300	21,861.00	0.08
273	603899	晨光文具	400	21,840.00	0.08

273	000728	国元证券	2,600	21,840.00	0.08
275	002603	以岭药业	700	21,833.00	0.08
276	000547	航天发展	1,597	21,830.99	0.08
277	002353	杰瑞股份	700	21,700.00	0.08
278	002557	洽洽食品	400	21,676.00	0.08
279	600885	宏发股份	540	21,664.80	0.08
280	300024	机器人	1,580	21,598.60	0.08
281	002373	千方科技	900	21,591.00	0.08
282	600118	中国卫星	700	21,581.00	0.08
283	000750	国海证券	4,960	21,526.40	0.08
284	600177	雅戈尔	3,600	21,456.00	0.08
285	603233	大参林	264	21,442.08	0.08
286	600699	均胜电子	900	21,429.00	0.08
287	600068	葛洲坝	3,600	21,420.00	0.08
288	000961	中南建设	2,400	21,360.00	0.08
289	000703	恒逸石化	2,338	21,345.94	0.08
290	300017	网宿科技	2,500	21,225.00	0.08
291	601997	贵阳银行	2,960	21,193.60	0.08
292	002195	二三四五	7,479	21,015.99	0.07
293	603858	步长制药	724	20,887.40	0.07
294	002174	游族网络	800	20,864.00	0.07
295	300595	欧普康视	300	20,802.00	0.07
296	300482	万孚生物	200	20,800.00	0.07
297	600066	宇通客车	1,700	20,740.00	0.07
298	002019	亿帆医药	901	20,695.97	0.07
299	601998	中信银行	4,000	20,600.00	0.07
300	300628	亿联网络	300	20,478.00	0.07
301	600390	五矿资本	2,900	20,474.00	0.07
302	600895	张江高科	1,000	20,370.00	0.07
303	300058	蓝色光标	2,600	20,280.00	0.07
304	000998	隆平高科	1,200	19,980.00	0.07

305	000050	深天马 A	1,300	19,968.00	0.07
306	002138	顺络电子	800	19,960.00	0.07
307	601880	大连港	11,600	19,952.00	0.07
308	600004	白云机场	1,300	19,812.00	0.07
309	300316	晶盛机电	800	19,792.00	0.07
310	002030	达安基因	724	19,750.72	0.07
311	300070	碧水源	2,432	19,747.84	0.07
312	000021	深科技	900	19,647.00	0.07
313	601198	东兴证券	1,800	19,620.00	0.07
313	002250	联化科技	900	19,620.00	0.07
315	600380	健康元	1,204	19,552.96	0.07
316	601881	中国银河	1,700	19,499.00	0.07
317	600845	宝信软件	330	19,496.40	0.07
318	600801	华新水泥	820	19,442.20	0.07
319	002152	广电运通	1,500	19,410.00	0.07
320	603707	健友股份	300	19,371.00	0.07
321	002572	索菲亚	800	19,336.00	0.07
322	300274	阳光电源	1,340	19,282.60	0.07
323	000401	冀东水泥	1,200	19,248.00	0.07
324	600219	南山铝业	9,460	19,203.80	0.07
325	600155	华创阳安	1,600	19,184.00	0.07
326	600315	上海家化	400	19,160.00	0.07
327	600410	华胜天成	1,400	19,040.00	0.07
327	002078	太阳纸业	2,000	19,040.00	0.07
329	600085	同仁堂	700	18,984.00	0.07
330	600667	太极实业	1,600	18,912.00	0.07
330	600642	申能股份	3,200	18,912.00	0.07
332	600018	上港集团	4,500	18,900.00	0.07
333	002773	康弘药业	380	18,848.00	0.07
334	600535	天士力	1,160	18,815.20	0.07
335	002673	西部证券	2,300	18,768.00	0.07

336	000630	铜陵有色	9,700	18,721.00	0.07
337	601018	宁波港	5,200	18,564.00	0.07
338	600126	杭钢股份	1,780	18,512.00	0.07
339	600516	方大炭素	2,933	18,419.24	0.07
340	600037	歌华有线	1,200	18,240.00	0.07
341	002013	中航机电	2,300	18,170.00	0.06
342	002926	华西证券	1,700	18,071.00	0.06
343	002382	蓝帆医疗	600	18,066.00	0.06
344	601319	中国人保	2,800	18,032.00	0.06
344	600879	航天电子	2,800	18,032.00	0.06
346	603605	珀莱雅	100	18,002.00	0.06
347	000623	吉林敖东	1,143	17,979.39	0.06
348	601233	桐昆股份	1,400	17,864.00	0.06
349	002511	中顺洁柔	800	17,840.00	0.06
350	600153	建发股份	2,200	17,820.00	0.06
350	002146	荣盛发展	2,200	17,820.00	0.06
352	600170	上海建工	5,800	17,806.00	0.06
353	002508	老板电器	570	17,732.70	0.06
354	600655	豫园股份	2,000	17,720.00	0.06
355	603806	福斯特	354	17,668.14	0.06
356	002396	星网锐捷	500	17,665.00	0.06
357	300010	立思辰	900	17,613.00	0.06
358	601117	中国化学	3,200	17,536.00	0.06
359	600362	江西铜业	1,300	17,498.00	0.06
360	601231	环旭电子	800	17,472.00	0.06
361	600884	杉杉股份	1,475	17,390.25	0.06
362	600811	东方集团	3,900	17,238.00	0.06
363	600167	联美控股	1,190	17,064.60	0.06
364	600415	小商品城	3,500	17,045.00	0.06
365	600369	西南证券	3,700	16,983.00	0.06
366	300244	迪安诊断	480	16,944.00	0.06

367	601878	浙商证券	1,700	16,847.00	0.06
368	600297	广汇汽车	5,267	16,801.73	0.06
369	600998	九州通	900	16,758.00	0.06
370	300001	特锐德	800	16,752.00	0.06
371	600208	新湖中宝	5,600	16,688.00	0.06
372	603338	浙江鼎力	220	16,669.40	0.06
373	600486	扬农化工	200	16,500.00	0.06
374	002268	卫 士 通	770	16,431.80	0.06
375	002281	光迅科技	500	16,430.00	0.06
376	600760	中航沈飞	500	16,410.00	0.06
377	600728	佳都科技	1,800	16,398.00	0.06
378	002028	思源电气	800	16,368.00	0.06
379	300251	光线传媒	1,500	16,365.00	0.06
380	000739	普洛药业	700	16,303.00	0.06
381	603658	安图生物	100	16,244.00	0.06
382	600804	鹏博士	1,800	16,164.00	0.06
383	601658	邮储银行	3,500	15,995.00	0.06
383	300115	长盈精密	700	15,995.00	0.06
385	002958	青农商行	3,600	15,948.00	0.06
386	002690	美亚光电	300	15,780.00	0.06
387	600674	川投能源	1,700	15,759.00	0.06
388	600909	华安证券	2,300	15,709.00	0.06
389	002153	石基信息	400	15,612.00	0.06
390	600325	华发股份	2,200	15,532.00	0.06
391	300002	神州泰岳	2,500	15,475.00	0.06
392	600216	浙江医药	800	15,408.00	0.05
393	001914	招商积余	500	15,365.00	0.05
394	600848	上海临港	713	15,308.11	0.05
395	002739	万达电影	1,000	15,270.00	0.05
396	000686	东北证券	1,800	15,210.00	0.05
397	601689	拓普集团	540	15,066.00	0.05

398	002938	鹏鼎控股	300	15,018.00	0.05
399	600418	江淮汽车	1,700	15,011.00	0.05
400	600528	中铁工业	1,700	14,994.00	0.05
401	002242	九阳股份	400	14,908.00	0.05
402	002294	信立泰	500	14,830.00	0.05
403	300630	普利制药	200	14,790.00	0.05
404	600733	北汽蓝谷	2,300	14,789.00	0.05
405	002939	长城证券	1,200	14,784.00	0.05
406	600959	江苏有线	3,924	14,754.24	0.05
407	600460	士兰微	1,000	14,680.00	0.05
408	000999	华润三九	500	14,595.00	0.05
409	601168	西部矿业	2,500	14,500.00	0.05
410	600598	北大荒	900	14,490.00	0.05
411	000581	威孚高科	700	14,476.00	0.05
412	600827	百联股份	1,000	14,450.00	0.05
413	000997	新大陆	900	14,382.00	0.05
414	600027	华电国际	4,200	14,364.00	0.05
415	600256	广汇能源	5,300	14,310.00	0.05
416	002387	维信诺	1,000	14,280.00	0.05
417	603156	养元饮品	664	14,276.00	0.05
418	002032	苏泊尔	200	14,200.00	0.05
419	601021	春秋航空	400	14,096.00	0.05
420	300296	利亚德	2,300	13,961.00	0.05
421	002558	巨人网络	800	13,920.00	0.05
422	000564	供销大集	3,100	13,919.00	0.05
423	600704	物产中大	3,300	13,893.00	0.05
424	603000	人民网	700	13,881.00	0.05
425	000878	云南铜业	1,300	13,793.00	0.05
426	600839	四川长虹	4,800	13,776.00	0.05
427	002670	国盛金控	1,505	13,770.75	0.05
428	600497	驰宏锌锗	4,000	13,760.00	0.05

429	002317	众生药业	800	13,728.00	0.05
430	600446	金证股份	700	13,580.00	0.05
431	600820	隧道股份	2,401	13,565.65	0.05
432	000627	天茂集团	2,600	13,546.00	0.05
433	300166	东方国信	1,080	13,402.80	0.05
434	002081	金螳螂	1,700	13,362.00	0.05
435	000671	阳光城	2,100	13,314.00	0.05
436	600008	首创股份	4,400	13,244.00	0.05
437	600572	康恩贝	2,400	13,200.00	0.05
438	600583	海油工程	2,900	13,195.00	0.05
439	002221	东华能源	1,500	13,185.00	0.05
440	601992	金隅集团	4,300	13,158.00	0.05
441	002468	申通快递	801	13,144.41	0.05
442	600673	东阳光	1,900	13,129.00	0.05
443	002368	太极股份	300	13,107.00	0.05
444	601179	中国西电	2,700	13,068.00	0.05
445	600260	凯乐科技	960	12,979.20	0.05
446	000800	一汽解放	1,200	12,888.00	0.05
447	002124	天邦股份	1,000	12,850.00	0.05
448	300113	顺网科技	500	12,700.00	0.05
449	300026	红日药业	2,300	12,696.00	0.05
450	600718	东软集团	1,100	12,650.00	0.05
451	002217	合力泰	2,400	12,600.00	0.04
452	600021	上海电力	1,700	12,580.00	0.04
453	600482	中国动力	800	12,560.00	0.04
454	000158	常山北明	1,200	12,528.00	0.04
455	600094	大名城	2,100	12,495.00	0.04
456	600779	水井坊	200	12,484.00	0.04
457	300618	寒锐钴业	200	12,404.00	0.04
458	002080	中材科技	800	12,400.00	0.04
459	600875	东方电气	1,400	12,390.00	0.04

459	600567	山鹰纸业	4,200	12,390.00	0.04
461	601633	长城汽车	1,600	12,352.00	0.04
462	000729	燕京啤酒	1,800	12,330.00	0.04
463	600038	中直股份	300	12,321.00	0.04
464	002920	德赛西威	200	12,266.00	0.04
465	600881	亚泰集团	4,200	12,222.00	0.04
466	600549	厦门钨业	1,030	12,195.20	0.04
467	600171	上海贝岭	700	12,166.00	0.04
468	600060	海信视像	1,000	12,150.00	0.04
469	601966	玲珑轮胎	600	12,120.00	0.04
470	002831	裕同科技	440	12,104.40	0.04
471	000877	天山股份	800	12,080.00	0.04
472	600160	巨化股份	1,750	12,057.50	0.04
473	002901	大博医疗	100	11,929.00	0.04
474	000060	中金岭南	3,200	11,904.00	0.04
475	600597	光明乳业	800	11,888.00	0.04
476	600862	中航高科	700	11,844.00	0.04
477	600977	中国电影	900	11,817.00	0.04
478	600026	中远海能	1,800	11,628.00	0.04
479	002925	盈趣科技	200	11,588.00	0.04
480	000090	天健集团	1,670	11,539.70	0.04
481	603712	七一二	300	11,514.00	0.04
482	603486	科沃斯	380	11,479.80	0.04
483	601005	重庆钢铁	7,700	11,473.00	0.04
484	600967	内蒙一机	1,100	11,429.00	0.04
485	002648	卫星石化	700	11,389.00	0.04
486	002429	兆驰股份	2,300	11,385.00	0.04
487	600273	嘉化能源	1,300	11,362.00	0.04
488	600392	盛和资源	1,610	11,350.50	0.04
489	600282	南钢股份	3,500	11,305.00	0.04
490	600645	中源协和	400	11,300.00	0.04

491	000629	攀钢钒钛	5,600	11,256.00	0.04
492	002056	横店东磁	1,000	11,250.00	0.04
493	002807	江阴银行	2,860	11,239.80	0.04
494	600580	卧龙电驱	999	11,228.76	0.04
495	600755	厦门国贸	1,700	11,220.00	0.04
495	000709	河钢股份	5,500	11,220.00	0.04
497	603568	伟明环保	483	11,205.60	0.04
498	603866	桃李面包	220	11,195.80	0.04
499	601216	君正集团	4,400	11,176.00	0.04
500	300133	华策影视	1,540	11,165.00	0.04
501	000960	锡业股份	1,300	11,128.00	0.04
502	002004	华邦健康	2,068	11,125.84	0.04
503	600754	锦江酒店	400	11,100.00	0.04
504	600039	四川路桥	2,900	11,078.00	0.04
505	601916	浙商银行	2,800	11,032.00	0.04
506	002085	万丰奥威	1,700	11,016.00	0.04
507	600737	中粮糖业	1,400	10,892.00	0.04
508	600064	南京高科	1,120	10,886.40	0.04
509	002233	塔牌集团	900	10,827.00	0.04
510	002709	天赐材料	320	10,812.80	0.04
511	603816	顾家家居	240	10,802.40	0.04
512	601238	广汽集团	1,200	10,800.00	0.04
512	600166	福田汽车	6,000	10,800.00	0.04
514	300182	捷成股份	2,700	10,773.00	0.04
515	000970	中科三环	1,100	10,758.00	0.04
516	601975	招商南油	4,500	10,755.00	0.04
517	601118	海南橡胶	2,200	10,692.00	0.04
518	002458	益生股份	700	10,689.00	0.04
519	000778	新兴铸管	3,100	10,633.00	0.04
520	000598	兴蓉环境	2,300	10,580.00	0.04
521	002203	海亮股份	1,200	10,500.00	0.04

522	002506	协鑫集成	4,000	10,440.00	0.04
523	600515	海航基础	2,000	10,400.00	0.04
524	000690	宝新能源	2,200	10,384.00	0.04
525	600466	蓝光发展	1,920	10,348.80	0.04
526	002110	三钢闽光	1,550	10,323.00	0.04
527	601577	长沙银行	1,300	10,322.00	0.04
528	603659	璞泰来	100	10,302.00	0.04
529	600195	中牧股份	632	10,257.36	0.04
530	002038	双鹭药业	800	10,248.00	0.04
531	600566	济川药业	400	10,184.00	0.04
531	002183	怡亚通	1,900	10,184.00	0.04
533	601860	紫金银行	2,400	10,152.00	0.04
534	300324	旋极信息	1,524	10,149.84	0.04
535	601106	中国一重	3,600	10,116.00	0.04
536	600808	马钢股份	3,900	10,062.00	0.04
537	002399	海普瑞	400	10,016.00	0.04
537	000723	美锦能源	1,600	10,016.00	0.04
539	000983	西山煤电	2,670	10,012.50	0.04
540	603883	老百姓	100	10,004.00	0.04
541	603228	景旺电子	284	9,993.96	0.04
542	000039	中集集团	1,380	9,977.40	0.04
543	002092	中泰化学	2,200	9,966.00	0.04
544	002635	安洁科技	400	9,960.00	0.04
544	000825	太钢不锈	3,000	9,960.00	0.04
544	000402	金融街	1,500	9,960.00	0.04
547	000089	深圳机场	1,300	9,958.00	0.04
548	600376	首开股份	1,697	9,944.42	0.04
549	600056	中国医药	700	9,905.00	0.04
550	601333	广深铁路	4,400	9,900.00	0.04
550	000967	盈峰环境	1,200	9,900.00	0.04
552	600398	海澜之家	1,700	9,894.00	0.04

553	600435	北方导航	1,300	9,828.00	0.04
554	600120	浙江东方	1,430	9,824.10	0.04
555	002191	劲嘉股份	1,100	9,801.00	0.03
556	600633	浙数文化	1,000	9,780.00	0.03
557	600675	中华企业	2,400	9,768.00	0.03
558	002595	豪迈科技	500	9,730.00	0.03
559	601236	红塔证券	500	9,700.00	0.03
560	000830	鲁西化工	1,300	9,698.00	0.03
561	600388	龙净环保	1,100	9,680.00	0.03
562	000930	中粮科技	1,412	9,643.96	0.03
563	600188	兖州煤业	1,100	9,636.00	0.03
564	002407	多氟多	900	9,576.00	0.03
565	601866	中远海发	5,200	9,568.00	0.03
566	000738	航发控制	700	9,555.00	0.03
567	600643	爱建集团	1,200	9,540.00	0.03
568	000415	渤海租赁	3,200	9,536.00	0.03
569	601098	中南传媒	900	9,522.00	0.03
570	600649	城投控股	1,600	9,504.00	0.03
571	600373	中文传媒	800	9,424.00	0.03
572	300180	华峰超纤	1,100	9,416.00	0.03
573	000563	陕国投 A	2,530	9,386.30	0.03
574	600729	重庆百货	300	9,366.00	0.03
575	000681	视觉中国	500	9,310.00	0.03
576	601718	际华集团	2,800	9,296.00	0.03
577	600022	山东钢铁	7,200	9,288.00	0.03
578	002048	宁波华翔	600	9,264.00	0.03
579	300459	金科文化	2,685	9,263.25	0.03
580	000501	鄂武商 A	590	9,251.20	0.03
581	002010	传化智联	1,700	9,248.00	0.03
582	002745	木林森	600	9,246.00	0.03
583	603077	和邦生物	7,000	9,240.00	0.03

583	000400	许继电气	700	9,240.00	0.03
585	600258	首旅酒店	600	9,222.00	0.03
586	002839	张家港行	1,600	9,216.00	0.03
587	601808	中海油服	700	9,198.00	0.03
588	002064	华峰氨纶	1,800	9,126.00	0.03
589	601898	中煤能源	2,400	9,120.00	0.03
590	002583	海能达	1,200	9,108.00	0.03
591	002640	跨境通	1,400	9,086.00	0.03
592	002372	伟星新材	780	9,071.40	0.03
593	600776	东方通信	600	9,054.00	0.03
594	600500	中化国际	1,780	9,006.80	0.03
595	601698	中国卫通	500	9,005.00	0.03
596	600062	华润双鹤	680	8,989.60	0.03
597	000012	南 玻 A	1,790	8,985.80	0.03
598	000932	华菱钢铁	2,380	8,972.60	0.03
599	600928	西安银行	1,700	8,942.00	0.03
600	600266	城建发展	1,752	8,882.64	0.03
601	000883	湖北能源	2,500	8,800.00	0.03
602	000078	海王生物	2,100	8,799.00	0.03
603	000807	云铝股份	2,000	8,720.00	0.03
604	600025	华能水电	2,300	8,717.00	0.03
605	601615	明阳智能	700	8,715.00	0.03
606	000559	万向钱潮	1,800	8,712.00	0.03
607	002936	郑州银行	2,530	8,703.20	0.03
608	002155	湖南黄金	1,100	8,668.00	0.03
609	000488	晨鸣纸业	1,754	8,664.76	0.03
610	601000	唐山港	3,878	8,647.94	0.03
611	603983	丸美股份	100	8,603.00	0.03
612	000959	首钢股份	2,000	8,600.00	0.03
613	002244	滨江集团	2,000	8,540.00	0.03
614	000027	深圳能源	1,840	8,537.60	0.03

615	000519	中兵红箭	900	8,478.00	0.03
616	000685	中山公用	1,100	8,470.00	0.03
617	600989	宝丰能源	1,000	8,420.00	0.03
618	601699	潞安环能	1,500	8,355.00	0.03
619	600908	无锡银行	1,700	8,347.00	0.03
620	000301	东方盛虹	1,500	8,340.00	0.03
621	002444	巨星科技	700	8,316.00	0.03
622	000528	柳 工	1,310	8,266.10	0.03
623	002375	亚厦股份	800	8,176.00	0.03
624	000987	越秀金控	700	8,162.00	0.03
625	600782	新钢股份	2,000	8,160.00	0.03
626	000031	大悦城	1,600	8,144.00	0.03
627	002266	浙富控股	2,100	8,127.00	0.03
628	002815	崇达技术	400	8,092.00	0.03
629	600777	新潮能源	5,300	8,056.00	0.03
630	002625	光启技术	1,110	8,047.50	0.03
631	600372	中航电子	600	7,992.00	0.03
632	600640	号百控股	400	7,980.00	0.03
633	600316	洪都航空	500	7,900.00	0.03
634	300072	三聚环保	1,829	7,828.12	0.03
635	002440	闰土股份	850	7,769.00	0.03
636	002390	信邦制药	1,700	7,752.00	0.03
637	000898	鞍钢股份	3,160	7,742.00	0.03
638	601717	郑煤机	1,300	7,657.00	0.03
639	600073	上海梅林	800	7,592.00	0.03
640	000156	华数传媒	700	7,581.00	0.03
641	002701	奥瑞金	1,800	7,542.00	0.03
642	000046	泛海控股	2,000	7,540.00	0.03
643	603786	科博达	100	7,535.00	0.03
644	601608	中信重工	2,200	7,524.00	0.03
644	000758	中色股份	1,800	7,524.00	0.03

646	603317	天味食品	135	7,503.30	0.03
647	002424	贵州百灵	900	7,470.00	0.03
648	600409	三友化工	1,600	7,456.00	0.03
649	002505	大康农业	3,300	7,425.00	0.03
650	600312	平高电气	1,000	7,420.00	0.03
651	601958	金钼股份	1,200	7,416.00	0.03
652	603515	欧普照明	270	7,389.90	0.03
653	600863	内蒙华电	3,000	7,380.00	0.03
654	000008	神州高铁	2,500	7,350.00	0.03
655	601228	广州港	2,400	7,296.00	0.03
656	600291	西水股份	800	7,240.00	0.03
657	600751	海航科技	2,300	7,199.00	0.03
658	600765	中航重机	700	7,154.00	0.03
659	601077	渝农商行	1,500	7,080.00	0.03
660	600478	科力远	1,500	7,065.00	0.03
660	000887	中鼎股份	900	7,065.00	0.03
662	002002	鸿达兴业	1,956	7,061.16	0.03
663	002563	森马服饰	1,000	7,050.00	0.03
664	002589	瑞康医药	1,300	6,968.00	0.02
665	601200	上海环境	580	6,960.00	0.02
665	600557	康缘药业	500	6,960.00	0.02
667	600507	方大特钢	1,340	6,954.60	0.02
668	002434	万里扬	800	6,944.00	0.02
669	600138	中青旅	700	6,909.00	0.02
670	600970	中材国际	1,300	6,864.00	0.02
671	000708	中信特钢	400	6,836.00	0.02
672	000813	德展健康	1,100	6,820.00	0.02
673	601928	凤凰传媒	1,000	6,800.00	0.02
674	002503	搜于特	2,418	6,794.58	0.02
675	600835	上海机电	400	6,772.00	0.02
676	300474	景嘉微	100	6,730.00	0.02

677	600125	铁龙物流	1,200	6,696.00	0.02
678	000826	启迪环境	900	6,678.00	0.02
679	600717	天津港	1,508	6,665.36	0.02
680	002867	周大生	300	6,651.00	0.02
681	600545	卓郎智能	1,400	6,622.00	0.02
682	000732	泰禾集团	1,300	6,617.00	0.02
683	600158	中体产业	800	6,544.00	0.02
684	603198	迎驾贡酒	300	6,531.00	0.02
685	002249	大洋电机	1,800	6,498.00	0.02
686	601598	中国外运	2,000	6,460.00	0.02
687	600639	浦东金桥	400	6,392.00	0.02
688	603885	吉祥航空	700	6,370.00	0.02
689	002665	首航高科	2,600	6,344.00	0.02
690	600348	阳泉煤业	1,500	6,330.00	0.02
691	600307	酒钢宏兴	4,100	6,314.00	0.02
692	600823	世茂股份	1,400	6,258.00	0.02
693	000712	锦龙股份	500	6,250.00	0.02
694	300376	易事特	1,200	6,240.00	0.02
695	601611	中国核建	1,000	6,180.00	0.02
695	600563	法拉电子	100	6,180.00	0.02
697	601869	长飞光纤	200	6,162.00	0.02
698	600582	天地科技	2,100	6,153.00	0.02
699	600748	上实发展	1,200	6,132.00	0.02
700	600968	海油发展	2,600	6,058.00	0.02
701	600259	广晟有色	200	6,000.00	0.02
702	600664	哈药股份	1,941	5,978.28	0.02
703	600017	日照港	2,400	5,976.00	0.02
704	603377	东方时尚	360	5,961.60	0.02
705	601678	滨化股份	1,400	5,936.00	0.02
706	000061	农产品	800	5,928.00	0.02
707	000718	苏宁环球	1,900	5,871.00	0.02

708	600277	亿利洁能	1,800	5,868.00	0.02
709	300134	大富科技	417	5,829.66	0.02
710	002302	西部建设	600	5,760.00	0.02
711	002416	爱施德	800	5,744.00	0.02
712	600901	江苏租赁	1,100	5,731.00	0.02
713	002419	天虹股份	600	5,730.00	0.02
714	000717	韶钢松山	1,500	5,700.00	0.02
715	600648	外高桥	400	5,656.00	0.02
716	000543	皖能电力	1,400	5,628.00	0.02
717	600869	智慧能源	1,400	5,600.00	0.02
718	002945	华林证券	400	5,524.00	0.02
719	002128	露天煤业	700	5,425.00	0.02
720	000553	安道麦A	600	5,412.00	0.02
721	000848	承德露露	770	5,390.00	0.02
722	300197	铁汉生态	2,100	5,334.00	0.02
723	002093	国脉科技	602	5,327.70	0.02
724	002653	海思科	200	5,322.00	0.02
725	600565	迪马股份	1,900	5,301.00	0.02
726	601828	美凯龙	500	5,295.00	0.02
727	002544	杰赛科技	400	5,260.00	0.02
728	300257	开山股份	400	5,228.00	0.02
729	002408	齐翔腾达	840	5,216.40	0.02
730	603328	依顿电子	500	5,215.00	0.02
731	600329	中新药业	300	5,196.00	0.02
732	600141	兴发集团	580	5,191.00	0.02
733	601298	青岛港	900	5,112.00	0.02
734	000537	广宇发展	700	5,110.00	0.02
735	002948	青岛银行	1,000	5,090.00	0.02
736	000062	深圳华强	350	5,089.00	0.02
737	000990	诚志股份	400	5,076.00	0.02
738	603766	隆鑫通用	1,300	5,031.00	0.02

739	601019	山东出版	800	5,000.00	0.02
740	600339	中油工程	2,200	4,994.00	0.02
741	603868	飞科电器	100	4,933.00	0.02
742	600350	山东高速	800	4,912.00	0.02
743	600299	安迪苏	400	4,888.00	0.02
744	601212	白银有色	1,900	4,845.00	0.02
745	600787	中储股份	1,100	4,829.00	0.02
746	600770	综艺股份	1,000	4,800.00	0.02
747	002470	金正大	2,100	4,767.00	0.02
748	603650	彤程新材	200	4,654.00	0.02
749	002491	通鼎互联	900	4,608.00	0.02
750	000600	建投能源	900	4,581.00	0.02
751	601139	深圳燃气	700	4,550.00	0.02
752	600657	信达地产	1,100	4,532.00	0.02
753	000028	国药一致	100	4,501.00	0.02
754	603888	新华网	200	4,472.00	0.02
755	601016	节能风电	2,100	4,452.00	0.02
756	002118	紫鑫药业	1,000	4,440.00	0.02
757	002285	世联行	1,560	4,352.40	0.02
758	600428	中远海特	1,400	4,312.00	0.02
759	002941	新疆交建	300	4,245.00	0.02
760	600338	西藏珠峰	420	4,200.00	0.01
761	600575	淮河能源	2,000	4,180.00	0.01
762	600707	彩虹股份	900	4,104.00	0.01
763	600757	长江传媒	800	4,072.00	0.01
764	002051	中工国际	558	4,062.24	0.01
765	603056	德邦股份	300	4,059.00	0.01
766	600006	东风汽车	1,000	4,030.00	0.01
767	000937	冀中能源	1,300	3,926.00	0.01
768	600985	淮北矿业	500	3,895.00	0.01
769	601801	皖新传媒	700	3,892.00	0.01

770	601865	福莱特	200	3,760.00	0.01
771	600623	华谊集团	700	3,612.00	0.01
772	600996	贵广网络	500	3,565.00	0.01
773	603379	三美股份	160	3,435.20	0.01
774	000869	张裕 A	100	3,415.00	0.01
775	600874	创业环保	500	3,320.00	0.01
776	000025	特力 A	180	3,299.40	0.01
777	000785	居然之家	400	3,168.00	0.01
778	600058	五矿发展	500	3,020.00	0.01
779	600053	九鼎投资	100	2,984.00	0.01
780	600903	贵州燃气	300	2,952.00	0.01
781	603260	合盛硅业	100	2,734.00	0.01
782	002818	富森美	220	2,706.00	0.01
783	601003	柳钢股份	600	2,658.00	0.01
784	601127	小康股份	300	2,493.00	0.01
785	603355	莱克电气	100	2,489.00	0.01
786	603556	海兴电力	170	2,454.80	0.01
787	601969	海南矿业	500	2,440.00	0.01
788	600694	大商股份	100	2,399.00	0.01
789	002957	科瑞技术	100	2,390.00	0.01
790	600335	国机汽车	500	2,310.00	0.01
791	601512	中新集团	200	2,300.00	0.01
792	601811	新华文轩	200	2,034.00	0.01
793	002423	中粮资本	200	1,740.00	0.01
794	002946	新乳业	100	1,735.00	0.01
795	601068	中铝国际	400	1,564.00	0.01
796	603225	新凤鸣	156	1,556.88	0.01
797	603025	大豪科技	213	1,548.51	0.01
798	001872	招商港口	100	1,455.00	0.01
799	600917	重庆燃气	200	1,428.00	0.01
800	603256	宏和科技	100	1,144.00	0.00

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	688189	南新制药	2,422	121,608.62	0.43
2	688466	金科环境	3,001	109,806.59	0.39
3	688558	N国盛	2,631	92,769.06	0.33
4	688096	京源环保	4,235	90,713.70	0.32
5	688277	天智航	3,080	37,083.20	0.13
6	688568	中科星图	2,066	33,489.86	0.12
7	688377	迪威尔	1,802	29,588.84	0.11
8	603087	甘李药业	279	27,983.70	0.10
9	688027	国盾量子	707	25,579.26	0.09
10	688600	皖仪科技	1,595	24,722.50	0.09
11	300842	帝科股份	455	18,527.60	0.07
12	600956	新天绿能	2,533	12,766.32	0.05
13	300839	N博汇	502	11,751.82	0.04
14	300845	捷安高科	470	8,286.10	0.03
15	300843	胜蓝股份	751	7,517.51	0.03
16	300840	酷特智能	1,185	7,038.90	0.03
17	300846	首都在线	1,131	3,811.47	0.01

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	601318	中国平安	1,637,572.00	1.14

2	600519	贵州茅台	1,318,744.32	0.92
3	600036	招商银行	666,872.00	0.46
4	601398	工商银行	595,592.00	0.41
5	000661	长春高新	571,101.00	0.40
6	000651	格力电器	523,484.00	0.36
7	600276	恒瑞医药	499,859.94	0.35
8	000002	万 科 A	468,157.00	0.33
9	000333	美的集团	467,274.00	0.33
10	601166	兴业银行	462,100.00	0.32
11	600030	中信证券	409,468.00	0.29
12	600900	长江电力	370,863.00	0.26
13	600887	伊利股份	355,557.00	0.25
14	000858	五 粮 液	350,344.00	0.24
15	300601	康泰生物	304,014.00	0.21
16	601688	华泰证券	290,899.00	0.20
17	601328	交通银行	283,698.00	0.20
18	600585	海螺水泥	281,813.00	0.20
19	603986	兆易创新	275,727.00	0.19
20	600016	XD民生银	268,237.00	0.19

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

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	6,488,060.00	4.52
2	600519	贵州茅台	5,569,850.04	3.88
3	600036	招商银行	2,816,672.00	1.96
4	600276	恒瑞医药	2,511,220.60	1.75
5	000858	五 粮 液	2,250,778.67	1.57

6	000651	格力电器	2,222,877.84	1.55
7	000333	美的集团	2,213,353.00	1.54
8	601166	兴业银行	1,905,473.00	1.33
9	600030	中信证券	1,533,614.00	1.07
10	600887	伊利股份	1,488,098.00	1.04
11	002475	立讯精密	1,335,535.00	0.93
12	600900	长江电力	1,281,187.65	0.89
13	000002	万科 A	1,276,061.00	0.89
14	000661	长春高新	1,272,741.00	0.89
15	601398	工商银行	1,181,085.00	0.82
16	600016	XD民生银	1,161,756.00	0.81
17	601328	交通银行	1,147,840.00	0.80
18	601288	农业银行	1,089,974.00	0.76
19	600000	浦发银行	979,555.00	0.68
20	000001	平安银行	962,407.00	0.67

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	46,570,513.19
卖出股票收入（成交）总额	162,166,591.83

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

7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

7.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

7.9 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

7.12 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	107,499.47
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	905.70
5	应收申购款	725,959.74
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	834,364.91

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	688189	南新制药	121,608.62	0.43	科创板打新限售
2	688466	金科环境	109,806.59	0.39	科创板打新限售
3	688558	国盛智科	92,769.06	0.33	科创板打新限售
4	688096	京源环保	90,713.70	0.32	科创板打新限售
5	688277	天智航	37,083.20	0.13	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
天弘中证800A	4,123	3,775.53	0.00	0.00%	15,566,508.86	100.00%

天弘 中证8 00C	3,22 5	3,191.63	0.00	0.00%	10,292,991.77	100.0 0%
合计	7,34 8	3,519.26	0.00	0.00%	25,859,500.63	100.0 0%

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800 A	10,247.23	0.07%
	天弘中证800 C	415.34	0.00%
	合计	10,662.57	0.04%

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

本基金成立后有10,000,000.00份为发起份额，发起份额承诺的持有期限为2015年07月16日至2018年07月16日。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800A	天弘中证800C
基金合同生效日(2015年07月16日)基金份额总额	5,000,000.00	5,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	116,608,248.70	27,290,108.89
本报告期基金总申购份额	39,597,007.27	29,689,536.38
减：本报告期基金总赎回份额	140,638,747.11	46,686,653.50
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	15,566,508.86	10,292,991.77

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、托管人的托管业务部门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	
东兴证券	1	-	-	-	-	-
方正证券	1	24,656,541.51	12.01%	10,634.84	17.37%	-
广发证券	3	165,521,770.30	80.61%	44,061.07	71.98%	-
西藏东方财富证券	2	15,146,635.76	7.38%	6,518.17	10.65%	-

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等。

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

3、本基金报告期内新租用交易单元：1个，其中包括东兴证券上海交易单元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	成交金额	占当期	成	占当期权	成	占当期基

		债券成交总额的比例		债券回购成交总额的比例	成交额	证成交总额的比例	成交额	金成交总额的比例
东兴证券	-	-	-	-	-	-	-	-
方正证券	-	-	-	-	-	-	-	-
广发证券	13,271.30	50.95%	-	-	-	-	-	-
西藏东方财富证券	12,776.50	49.05%	-	-	-	-	-	-

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，其中包括东方财富证券上海交易单元1个，广发证券上海交易单元1个，方正证券深圳交易单元1个，东方财富证券深圳交易单元1个。

4、本基金报告期内停止租用交易单元：无。

10.8 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
3	天弘基金管理有限公司关于天弘中证800指数型发起式证券投资基金恢复大额申购、转换转入、定期定额投资业务的公告	中国证监会指定媒介	2020-01-17

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800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推迟披露旗下公募基金2019年年度报告的公告	中国证监会指定媒介	2020-03-25
8	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
9	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
10	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
11	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
12	天弘中证800指数型发起式证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会指定媒介	2020-04-21
13	天弘中证800指数型发起式	中国证监会指定媒介	2020-04-21

	证券投资基金招募说明书 (更新) 摘要		
14	天弘中证800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
15	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
16	天弘中证800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
17	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

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金 份额比例 达到或者 超过20% 的时间区 间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20200511- 20200517, 20200520,	24,175,80 3.64	-	24,175,80 3.64	-	-

		20200602- 20200609					
	2	20200101- 20200623	34,419,97 4.13	-	34,419,97 4.13	-	-
	3	20200407- 20200611	21,227,10 4.02	11,350,51 9.84	32,577,62 3.86	-	-
产品特有风险							
基金管理人秉承谨慎勤勉、独立决策、规范运作、充分披露原则，公平对待投资者，保障投资者合法权益。当单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20% 时，由此可能导致的特有风险主要包括： （1）超出基金管理人允许的单一投资者持有基金份额比例的申购申请不被确认的风险； （2）极端市场环境下投资者集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对赎回申请的风险； （3）持有基金份额占比较高的投资者大额赎回可能引发基金净值大幅波动的风险； （4）持有基金份额占比较高的投资者在召开基金份额持有人大会并对重大事项进行投票表决时，可能拥有较大话语权； （5）极端情况下，持有基金份额占比较高的投资者大量赎回后，可能出现连续六十个工作日基金资产净值低于 5000 万元而面临的转换基金运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等风险。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

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

12.2 存放地点

天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层

12.3 查阅方式

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

公司网站：www.thfund.com.cn

天弘基金管理有限公司
二〇二〇年八月三十一日