天弘债券型发起式证券投资基金

2016 第二季度 报告

2016年6月30日

基金管理人:天弘基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2016年07月19日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年7月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

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

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

本报告财务资料未经审计。

本报告期自2016年4月1日起至2016年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	天弘债券发起式
基金主代码	420008
基金运作方式	契约型开放式、发起式
基金合同生效日	2012年06月10日
报告期末基金份额总额	957,445,511.54份
投资目标	本基金在追求基金资产长期稳健增值的基础上,力争获得高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金通过对宏观经济、利率走势、资金供求、信用风险状况、证券市场走势等方面的分析和预测,在严格的风险控制基础上,主动构建及调整投资组合,力求实现基金资产的稳定增值。
业绩比较基准	中债综合指数
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中较低风险的基金品种,其风险收益预期高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。
基金管理人	天弘基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	天弘债券型发起式A / 天弘债券型发起式B
下属分级基金的交易代码	420008 / 420108
报告期末下属分级基金的份额总额	202,425,609.24份 / 755,019,902.30份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2016年04月01日-2016年06月30日)	
	天弘债券型发起式A	天弘债券型发起式B
1.本期已实现收益	-974,558.17	-4,500,988.48
2.本期利润	-2,573,041.90	-8,543,241.65
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0114	-0.0115
4.期末基金资产净值	233,563,585.72	857,772,277.76
5.期末基金份额净值	1.154	1.136

注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

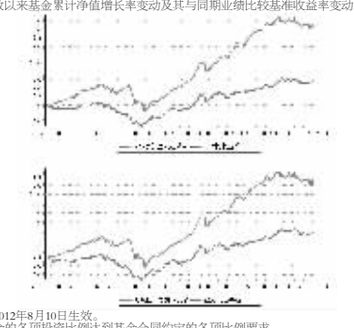
天弘债券型发起式A

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.86%	0.19%	-0.52%	0.07%	-0.34%	0.12%

天弘债券型发起式B

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-0.96%	0.21%	-0.52%	0.07%	-0.44%	0.14%

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



注:1.本基金合同于2012年8月10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 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈钢	本基金基金经理;本公司副总经理、固定收益总监兼固定收益部总经理。	2013年08月	2016年05月	14年	男,工商管理硕士。历任华龙证券公司固定收益部高级经理;北京宸星投资管理公司投资经理;兴业证券公司债券总部研究部经理;银华基金管理有限公司机构理财部高级经理;中国人寿资产管理有限公司固定收益部高级投资经理等。
凌超	本基金基金经理	2016年05月	-	10年	男,经济学硕士。历任长江证券股份有限公司研发员、投资经理、光大保德信基金管理有限公司基金经理、海富通基金管理有限公司投资顾问、基金经理。2016年1月加盟本公司。

注:1、上述任职日期为本基金管理人对外披露的任职日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

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

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

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

2016年三季度,经济基本面整体平稳,但经济持续改善预期被证伪,一季度快速上涨的蔬菜价格也明显回落,市场的通胀担忧显著缓解。政策面方面,一季度的大规模刺激伴随着权威人士的表态告一段落,政策重心重回供给侧结构性改革,但基建投资作为托底经济的主要手段,仍然维持较高增速,货币政策则维持稳健,二季度未进行降息降准操作,主要通过公开市场操作以及MLF等工具维护资金面稳定。资金面方面,二季度资金面平稳程度有所改善,与央行对资金面态度转趋积极有关。债券市场行情方面,4月份由于中铁物资信用事件冲击,债市出现明显调整,5月份市场震荡上涨,6月份由于经济增长预期下修、英国退欧引发市场避险情绪以及营改增免税同业往来范围扩大等利好刺激,债券市场再次上涨。

本基金在报告期内,前期认为市场有调整风险,因此提前降低仓位,以规避风险,因此在4月份的债市调整中受冲击程度明显较小,取得了较好的效果,在债市调整结束之后,我们判断市场后续仍有机会,因此择优配置了信用资质优良的中高等级信用债,杠杆维持在适度水平。同时在严控股票仓位的情况下参与了权益市场的机会,为客户创造较高的稳健收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2016年6月30日,天弘债券发起式A级份额净值为1.154元,天弘债券发起式B级份额净值为1.136元。报告期内份额净值增长率天弘债券发起式A级为-0.86%,天弘债券发起式B级为-0.96%,同期业绩比较基准增长率为-0.52%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内本基金管理人无应说明预警信息。

4.7 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2016年三季度,基本面方面,我们仍然维持经济增长将整体平稳的判断,通胀水平受基数影响将处于年内低点,基本面因素对债市相对中性。政策面方面,基建投资将延续前期趋势,维持较高增速以托底经济,货币政策维持稳健,三季度虽然仍有降准空间,但降息及OMO利率下调概率不大。资金面方面,央行着力建立利率走廊制度,资金面波动显著下降,央行公开市场操作利率对资金利率起到锚的作用,资金利率难以出现下行,制约债券市场收益率进一步下行。综合以上因素,债券市场收益率三季度将呈现区间波动的态势。

投资策略上,本基金将选择有利配置时点,积极布局后续的市场机会,同时将在严守投资纪律的前提下适当参与股票市场的机会,争取为持有人创造稳健收益。

§5 投资组合报告

5.1 报告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	125,640,291.48	11.47
	其中:股票	125,640,291.48	11.47
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	879,267,172.90	80.30
	其中:债券	879,267,172.90	80.30
	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	1,557,501.04	0.14
8	其他资产	88,498,909.92	8.08
9	合计	1,094,963,875.34	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	114,222,482.98	10.47
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	—	—
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,417,808.50	1.05
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	125,640,291.48	11.51

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	002056	横店东磁	1,651,200	28,070,400.00	2.57
2	300389	艾比森	994,741	24,440,786.37	2.24
3	002103	广博股份	827,402	16,721,794.42	1.53
4	002341	新纶科技	770,267	16,583,848.51	1.52
5	300036	超图软件	466,033	11,417,808.50	1.05
6	600879	航天电子	707,000	11,015,060.00	1.01
7	000932	华菱钢铁	2,682,300	10,595,085.00	0.97
8	002160	常铝股份	775,743	6,795,508.68	0.62

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	69,964,000.00	6.41
	其中:政策性金融债	69,964,000.00	6.41
4	企业债券	384,207,193.60	35.21
5	企业短期融资券	400,850,000.00	36.73
6	中期票据	—	—
7	可转债(可交换债)	24,245,979.30	2.22
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	879,267,172.90	80.57

注:可转债项下包含可交换债7,698,976.90元。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	011699437	16大唐新能SCP001	700,000	70,063,000.00	6.42
2	1480372	14大石桥债	500,000	54,285,000.00	4.97
3	011699333	16国能源SCP004	500,000	50,045,000.00	4.59
4	011699362	16澜沧江SCP001	500,000	50,030,000.00	4.58
5	122371	14亨通01	400,000	40,920,000.00	3.75

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

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

5.11.2 基金投资的前十名股票,均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

5.11.3 其他资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	595,238.15
2	应收证券清算款	76,490,110.26
3	应收股利	—
4	应收利息	11,412,317.91
5	应收申购款	1,243.60
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	88,498,909.92

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113008	电气转债	5,365,499.30	0.49
2	132001	14宝钢EB	4,783,104.00	0.44
3	132002	15天集EB	641,531.70	0.06
4	110031	航信转债	70,585.60	0.01

5.11.5 报告期末前十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	000932	华菱钢铁	10,595,085.00	0.97	按露重大事项

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

	天弘债券型发起式A	天弘债券型发起式B
报告期期初基金份额总额	258,408,076.88	726,430,989.70
报告期期间基金总申购份额	426,436.11	114,492,472.83
减:报告期期间基金总赎回份额	56,408,903.75	85,903,560.23
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	—	—
报告期期末基金份额总额	202,425,609.24	755,019,902.30

注:总申购份额含转换转入份额;总赎回份额含转换转出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

	天弘债券型发起式A	天弘债券型发起式B
报告期期初管理人持有的本基金份额	10,287,988.75	—
报告期期间买入/申购总份额	—	—
报告期期间卖出/赎回总份额	—	—
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,287,988.75	—
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	1.07	—

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,800.08	1.04%	10,000,800.08	1.04%	三年
基金管理人高级管理人员	—	—	—	—	
基金经理等人员	—	—	—	—	
基金管理人股东	—	—	—	—	
其他	—	—	—	—	
合计	10,000,800.08	1.04%	10,000,800.08	1.04%	

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准天弘债券型发起式证券投资基金募集的文件

2、天弘债券型发起式证券投资基金基金合同

3、天弘债券型发起式证券投资基金招募说明书

4、天弘债券型发起式证券投资基金托管协议

5、天弘基金管理有限公司批准成立批件及营业执照

9.2 存放地点

天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层

9.3 查阅方式

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

公司网站:www.thfund.com.cn

天弘基金管理有限公司
二〇一六年七月十九日

天弘中证500指数型发起式证券投资基金

2016 第二季度 报告

2016年6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
报告送出日期:2016年07月19日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人国泰君安证券股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年7月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。

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

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

本报告财务资料未经审计。

本报告期自2016年4月1日起至2016年6月30日止。

§2 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	730,932,701.60份
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,属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种,其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2016年04月01日-2016年06月30日)
1.本期已实现收益	-57,991,814.49
2.本期利润	12,794,870.68
3.加权平均基金份额本期利润	0.0162
4.期末基金资产净值	728,092,168.61
5.期末基金份额净值	0.9961

注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

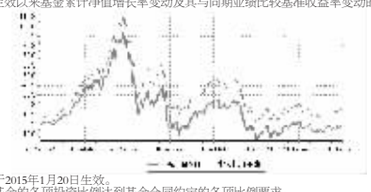
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如,开放式基金的申购赎回费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.45%	1.54%	-0.46%	1.57%	0.91%	-0.03%

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



注:1、本基金合同于2015年1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。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘冬	本基金基金经理。	2016年02月	—	10年	男,经济学硕士。2007年7月至2008年10月在长江证券股份有限公司研究部任宏观策略研究员。2008年11月加盟本公司,历任本公司投资部固定收益研究员、宏观策略研究员、基金经理助理等。

注:1、上述任职日期为本基金管理人对外披露的任职日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

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

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

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

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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

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

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

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

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

本报告期内,股市由一季度的剧烈波动逐渐转为平稳,波动率和振幅都明显下降。本基金根据指数化投资流程和定量研究,进行了基金的日常操作。跟踪误差来源主要是申购赎回、成分股停牌因素影响。根据基金合同的规定,对指数基金操作采取被动复制策略,结合市场趋势预判与量化分析,优化组合结构,使本基金与所跟踪指数的市场表现尽量一致,给投资者提供一个较好的指数投资工具。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2016年6月30日,本基金份额净值为0.9961元,本报告期份额净值增长率0.45%,同期业绩比较基准增长率为-0.46%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内本基金管理人无应说明预警信息。

4.7 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

国内经济总体仍然处于偏弱状态,但政策层面在稳经济、调结构方面均有措施出台,且对股票市场也是呵护的意愿;从经济数据来看,中短期基本面方面总体偏稳定,但就经济内生增长动力来说还是偏弱,需要经济结构的转型,才有可能获更有效的经济活力。三季度以来,尽管股票市场指数总体涨幅不大,但结构性机会不错,且市场总体比较活跃;在流动性和政策面有一定支持的情况下,后续市场面临较大的风险在于高估值与盈利业绩的匹配程度有一定偏差,因此,在挖掘结构性机会的同时也要关注高估值的回调风险。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	689,143,665.24	90.91
	其中:股票	689,143,665.24	90.91
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	42,372,066.24	5.59
8	其他资产	26,540,160.75	3.50
9	合计	758,055,892.23	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

5.2.1.1 报告期末(指数投资)按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	12,977,058.63	1.78
B	采矿业	28,189,946.88	3.87
C	制造业	407,109,738.52	55.91
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	19,421,459.76	2.67
E	建筑业	20,746,741.72	2.85
F	批发和零售业	39,537,972.26	5.43
G	交通运输、仓储和邮政业	18,405,612.65	2.53
H	住宿和餐饮业	1,207,906.00	0.17
I	信息传输、软件和信息技术服务业	44,653,806.81	6.13
J	金融业	3,349,669.70	0.46
K	房地产业	44,951,430.21	6.17
L	租赁和商务服务业	9,773,485.90	1.34
M	科学研究和技术服务业	3,229,471.00	0.44
N	水利、环境和公共设施管理业	4,958,153.43	0.68
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	2,013,758.80	0.28
R	文化、体育和娱乐业	12,089,593.79	1.66
S	综合	8,209,559.87	1.13
	合计	680,827,365.93	93.51

5.2.1.2 报告期末(积极投资)按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	622,350.00	0.09
C	制造业	2,439,958.96	0.34
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	257,856.00	0.04
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	3,492,936.00	0.48
J	金融业	—	—
K	房地产业	1,503,198.35	0.21
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	8,316,299.31	1.14

注:由于指数成份股调整,上表所列示股票被调出成份股后停牌,故以积极投资股票列示(下同)。

5.3 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

5.3.1 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前十名股票投资明细

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	002466	天齐锂业	111,200	4,747,128.00	0.65
2	002405	四维图新	156,815	3,857,649.00	0.53
3	600584	长电科技	185,611	3,766,047.19	0.52
4	002340	格林美	382,326	3,352,999.02	0.46
5	600522	中天科技	330,298	3,236,920.40	0.44
6	300072	三聚环保	109,707	3,032,301.48	0.42
7	002049	同方国芯	67,800	2,979,810.00	0.41
8	600201	生物股份	105,544	2,884,517.52	0.40
9	002085	万丰奥威	167,500	2,879,325.00	0.40
10	600521	华海药业	115,055	2,798,137.60	0.38

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

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	600654	中安消	188,400	3,492,936.00	0.48
2	000511	烯碳新材	273,538	2,439,958.96	0.34
3	000718	苏宁环球	151,685	1,503,198.35	0.21
4	000693	华泽钴镍	49,788	622,350.00	0.09
5	000582	北部湾港	15,800	257,856.00	0.04

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

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

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11 投资组合报告附注

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

5.11.2 基金投资的前十名股票,均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	980,580.85
2	应收证券清算款	21,873,775.57
3	应收股利	—
4	应收利息	22,155.51
5	应收申购款	3,629,148.82
6	其他应收款	—
7	待摊费用	34,500.00
8	其他	—
9	合计	26,540,160.75

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限情况。

5.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600654	中安消	3,492,936.00	0.48	重大资产重组
2	000511	烯碳新材	2,439,958.96	0.34	2015年年报被会计师事务所出具了无法表示意见的审计报告
3	000718	苏宁环球	1,503,198.35	0.21	重大资产重组
4	000693	华泽钴镍	622,350.00	0.09	重大资产重组
5	000582	北部湾港	257,856.00	0.04	重大资产重组

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	677,835,946.11
报告期期间基金总申购份额	1,136,784,104.99
减:报告期期间基金总赎回份额	1,083,687,349.50
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	—
报告期期末基金份额总额	730,932,701.60

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。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	10,000,000.00
报告期期间买入/申购总份额	—
报告期期间卖出/赎回总份额	—
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,000,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	1.37

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明