

天弘中证800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:兴业银行股份有限公司
报告送达日期:2016年7月19日

§ 1 要要点

本基金管理人的主要职责和基金的财产独立于基金管理人、基金托管人和其他任何个人、机构、公司的财产。基金管理人、基金托管人、基金销售代理人和其他任何个人、机构、公司保证不从事损害基金份额持有人利益的行为。在基金合同存续期间，基金管理人承诺不从事下列行为：（一）以其固有财产从事投资活动；（二）不公平地对待其管理的不同基金财产；（三）利用基金财产为基金份额持有人以外的第三人牟取利益；（四）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；（五）对基金进行虚假宣传；（六）违规向基金份额持有人违规销售基金；（七）泄露基金投资计划、投资意向等未公开信息；（八）从事内幕交易、操纵证券交易价格及其他不正当的证券交易活动；（九）向基金份额持有人违规承诺收益或者承担损失；（十）法律、行政法规和中国证监会规定禁止的其他行为。

基金管理人承诺不从事上述行为。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。

本报告自2016年4月1日起至2016年6月30日止。

§ 2 基金产品概况

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A 衣、食、农、渔业	60,153,000	0.04	
B 工业企业	327,262,522	3.48	
C 制造业	329,000,000	3.60	
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业	314,135,952	3.34	
E 建筑业	281,863,391	3.00	
F 交通运输、仓储和邮政业	266,273,380	2.85	
G 住宿和餐饮业	33,466,001	0.04	
H 科学研究、技术服务业	357,419,000	3.55	
K 金融、房地产	2,516,000,000	23.24	
Q 卫生和社会工作	485,594,85	5.17	
R 文化、体育和娱乐业	111,339,601	1.18	
S 其他服务业	111,000,000	1.07	
N 水利、环境和公共设施管理业	64,652,365	0.69	
O 国际服务、修理以及其他服务业	—	—	
P 教育	20,933,409	0.21	
Q 卫生和社会工作	135,237,000	1.00	
R 文化、体育和娱乐业	96,000,000	0.82	
S 合计	8,824,223,32	93.07	

§ 3 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6月30日)
天弘中证800A	天弘中证800C	
1.本期初来收入		-66,939.00
2.本期申购		-43,726.31
3.期初红利分配金额		-0.0059
4.期末基金资产净值		5,488,851.36
5.期末可供分配利润		3,911,741.60
6.期末可供分配利润占基金资产净值的比例(%)		0.7037
7.期末可供分配利润总额		7,877,69.21
8.期末可供分配利润总额占基金资产净值的比例(%)		1.135,645.19%

§ 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6月30日)
天弘中证800A	天弘中证800C	
1.本期初来收入		-66,939.00
2.本期申购		-43,726.31
3.期初红利分配金额		-0.0059
4.期末基金资产净值		5,488,851.36
5.期末可供分配利润		3,911,741.60
6.期末可供分配利润占基金资产净值的比例(%)		0.7037
7.期末可供分配利润总额		7,877,69.21
8.期末可供分配利润总额占基金资产净值的比例(%)		1.135,645.19%

§ 3.2 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6月30日)
天弘中证800A	天弘中证800C	
1.本期初来收入		-66,939.00
2.本期申购		-43,726.31
3.期初红利分配金额		-0.0059
4.期末基金资产净值		5,488,851.36
5.期末可供分配利润		3,911,741.60
6.期末可供分配利润占基金资产净值的比例(%)		0.7037
7.期末可供分配利润总额		7,877,69.21
8.期末可供分配利润总额占基金资产净值的比例(%)		1.135,645.19%

§ 3.3 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6月30日)
天弘中证800A	天弘中证800C	
1.本期初来收入		-66,939.00
2.本期申购		-43,726.31
3.期初红利分配金额		-0.0059
4.期末基金资产净值		5,488,851.36
5.期末可供分配利润		3,911,741.60
6.期末可供分配利润占基金资产净值的比例(%)		0.7037
7.期末可供分配利润总额		7,877,69.21
8.期末可供分配利润总额占基金资产净值的比例(%)		1.135,645.19%

§ 3.4 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6月30日)
天弘中证800A	天弘中证800C	
1.本期初来收入		-66,939.00
2.本期申购		-43,726.31
3.期初红利分配金额		-0.0059
4.期末基金资产净值		5,488,851.36
5.期末可供分配利润		3,911,741.60
6.期末可供分配利润占基金资产净值的比例(%)		0.7037
7.期末可供分配利润总额		7,877,69.21
8.期末可供分配利润总额占基金资产净值的比例(%)		1.135,645.19%

§ 3.5 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6月30日)
天弘中证800A	天弘中证800C	
1.本期初来收入		-66,939.00
2.本期申购		-43,726.31
3.期初红利分配金额		-0.0059
4.期末基金资产净值		5,488,851.36
5.期末可供分配利润		3,911,741.60
6.期末可供分配利润占基金资产净值的比例(%)		0.7037
7.期末可供分配利润总额		7,877,69.21
8.期末可供分配利润总额占基金资产净值的比例(%)		1.135,645.19%

§ 3.6 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6月30日)
天弘中证800A	天弘中证800C	
1.本期初来收入		-66,939.00
2.本期申购		-43,726.31
3.期初红利分配金额		-0.0059
4.期末基金资产净值		5,488,851.36
5.期末可供分配利润		3,911,741.60
6.期末可供分配利润占基金资产净值的比例(%)		0.7037
7.期末可供分配利润总额		7,877,69.21
8.期末可供分配利润总额占基金资产净值的比例(%)		1.135,645.19%

§ 3.7 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6月30日)
天弘中证800A	天弘中证800C	
1.本期初来收入		-66,939.00
2.本期申购		-43,726.31
3.期初红利分配金额		-0.0059
4.期末基金资产净值		5,488,851.36
5.期末可供分配利润		3,911,741.60
6.期末可供分配利润占基金资产净值的比例(%)		0.7037
7.期末可供分配利润总额		7,877,69.21
8.期末可供分配利润总额占基金资产净值的比例(%)		1.135,645.19%

§ 3.8 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6月30日)

<tbl_r cells="2" ix="