

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

2019 年年度报告

2019 年 12 月 31 日

基金管理人:天弘基金管理有限公司

基金托管人:招商证券股份有限公司

送出日期:2020 年 04 月 24 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。本年度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。

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2020年04月22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。

2019年08月12日天弘量化驱动股票型证券投资基金正式更名为“天弘中证500指数增强型证券投资基金”。原天弘量化驱动股票型证券投资基金本报告期自2019年01月01日起至2019年08月11日止，天弘中证500指数增强型证券投资基金本报告期自2019年08月12日起至2019年12月31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	6
2.1 基金基本情况	6
2.2 基金产品说明	7
2.3 基金管理人和基金托管人	7
2.4 信息披露方式	8
2.5 其他相关资料	8
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况(转型后)	8
3.1 主要会计数据和财务指标	8
3.2 基金净值表现	9
3.3 过去三年基金的利润分配情况	13
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况（转型前）	13
3.1 主要会计数据和财务指标	13
3.2 基金净值表现	14
3.3 过去三年基金的利润分配情况	18
§4 管理人报告	18
4.1 基金管理人及基金经理情况	18
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	20
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	20
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	21
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	22
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	22
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	23
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	24
4.9 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	24
§5 托管人报告	24
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	24
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	25
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见	25
§6 审计报告(转型后)	25
6.1 审计报告基本信息	错误!未定义书签。
6.2 审计报告的基本内容	错误!未定义书签。
§6 审计报告(转型前)	28
6.1 审计报告基本信息	错误!未定义书签。
6.2 审计报告的基本内容	错误!未定义书签。
§7 年度财务报表(转型后)	30
7.1 资产负债表	30
7.2 利润表	32
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	34
7.4 报表附注	35
§7 年度财务报表(转型前)	62
7.1 资产负债表	62
7.2 利润表	64
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	65

7.4 报表附注	67
§8 投资组合报告(转型后)	96
8.1 期末基金资产组合情况	96
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	97
8.3 期末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	99
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	105
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	107
8.6 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	107
8.7 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	107
8.8 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	107
8.9 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	107
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	107
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	108
8.12 投资组合报告附注	108
§8 投资组合报告（转型前）	109
8.1 期末基金资产组合情况	109
8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合	109
8.3 期末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	110
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	116
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合	120
8.6 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	120
8.7 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	120
8.8 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	120
8.9 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	120
8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	120
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	121
8.12 投资组合报告附注	121
§9 基金份额持有人信息(转型后)	121
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	122
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	122
9.3 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	122
§9 基金份额持有人信息(转型前)	123
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	123
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	124
9.3 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	124
§10 开放式基金份额变动(转型后)	124
§10 开放式基金份额变动(转型前)	125
§11 重大事件揭示	125
11.1 基金份额持有人大会决议	125
11.2 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	126
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	126
11.4 基金投资策略的改变	126
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	126
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	126
转型后	126
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	126
转型前	127
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	128

11.8 其他重大事件.....	129
§12 影响投资者决策的其他重要信息.....	134
12.1 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.....	134
12.2 影响投资者决策的其他重要信息.....	135
§13 备查文件目录.....	135
13.1 备查文件目录.....	135
13.2 存放地点.....	135
13.3 查阅方式.....	135

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

转型后

基金名称	天弘中证500指数增强型证券投资基金	
基金简称	天弘中证500指数增强	
基金主代码	001556	
基金运作方式	契约型开放式	
基金转型合同生效日	2019年08月12日	
基金管理人	天弘基金管理有限公司	
基金托管人	招商证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	190,118,789.19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500指数增强A	天弘中证500指数增强C
下属分级基金的交易代码	001556	001557
报告期末下属分级基金的份额总额	112,188,364.07份	77,930,425.12份

转型前

基金名称	天弘量化驱动股票型证券投资基金	
基金简称	天弘量化驱动股票	
基金主代码	001556	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2018年01月18日	
基金管理人	天弘基金管理有限公司	
基金托管人	招商证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	53,550,746.13份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	天弘量化驱动股票A	天弘量化驱动股票C
下属分级基金的交易代码	001556	001557
报告期末下属分级基金的份额总额	14,408,757.35份	39,141,988.78份

2.2 基金产品说明

转型后

投资目标	本基金为股票型指数增强基金，在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，力争获取高于标的指数的投资收益。
投资策略	本基金采用指数增强型投资策略，以中证500指数作为基金投资组合的标的指数，结合深入的宏观面、基本面研究及数量化投资技术，在指数化投资基础上优化调整投资组合，力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%，年跟踪误差不超过7.75%，以实现高于标的指数的投资收益和基金资产的长期增值。
业绩比较基准	中证500指数收益率×95%+银行活期存款税后利率×5%
风险收益特征	本基金为股票指数增强型基金，其预期的风险和收益高于货币市场基金、债券型基金、混合型基金。

转型前

投资目标	本基金采用量化投资策略构建投资组合，在严格控制风险的前提下，力争实现基金资产的长期稳健增值。
投资策略	本基金采用量化投资策略构建投资组合，利用数量化投资信息反应速度快、投资覆盖范围广、风险水平可控性强、投资纪律执行力高等优势，以自上而下的资产配置策略和自下而上的个股选择的组合构建方式，在控制整体风险的基础上追求组合收益的最大化。
业绩比较基准	中证500指数收益率×85%+中证综合债券指数收益率×15%
风险收益特征	本基金为股票型基金，其风险收益预期高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

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	招商证券股份有限公司

信息披露 负责人	姓名	童建林	韩鑫普
	联系电话	022-83310208	0755-82943666
	电子邮箱	service@thfund.com.cn	tgb@cmschina.com.cn
客户服务电话		95046	95565
传真		022-83865569	0755-82960794
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	深圳市福田区福田街道福华一路111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	深圳市福田区福田街道福华一路111号
邮政编码		300203	518000
法定代表人		胡晓明	霍达

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
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.thfund.com.cn
基金年度报告备置地点	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
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	中国上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
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、基金净值表现及利润分配情况 (转型后)

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	2019年08月12日（新基金合同生效日） - 2019年12月31日	
	天弘中证500指数增强A	天弘中证500指数增强C
本期已实现收益	2,222,865.33	2,373,479.45
本期利润	6,546,421.68	6,514,593.43
加权平均基金份额本期利润	0.1159	0.0914
本期加权平均净值利润率	14.57%	11.71%
本期基金份额净值增长率	16.14%	16.02%
3.1.2 期末数据和指标	2019年末	
期末可供分配利润	-18,551,651.22	-13,828,396.15
期末可供分配基金份额利润	-0.1654	-0.1774
期末基金资产净值	93,636,712.85	64,102,028.97
期末基金份额净值	0.8346	0.8226
3.1.3 累计期末指标	2019年末	
基金份额累计净值增长率	16.14%	16.02%

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。

4、天弘量化驱动股票型证券投资基金自2019年08月12日转型为天弘中证500指数增强型证券投资基金。新基金合同生效日，指《天弘中证500指数增强型证券投资基金基金合同》生效日，即2019年08月12日，下同。天弘中证500指数增强型证券投资基金报告期为2019年08月12日至2019年12月31日。

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500指数增强A

阶段	份额净值 增长率①	份额净值 增长率标	业绩比较 基准收益	业绩比较 基准收益	①-③	②-④
----	--------------	--------------	--------------	--------------	-----	-----

		准差②	率③	率标准差 ④		
过去三个月	6.92%	0.84%	6.29%	0.88%	0.63%	-0.04%
自基金转型 日起至今(20 19年08月12 日-2019年12 月31日)	16.14%	0.95%	13.77%	0.97%	2.37%	-0.02%

天弘中证500指数增强C

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
过去三个月	6.85%	0.84%	6.29%	0.88%	0.56%	-0.04%
自基金转型 日起至今(20 19年08月12 日-2019年12 月31日)	16.02%	0.95%	13.77%	0.97%	2.25%	-0.02%

注：1、天弘中证 500 指数增强型证券投资基金的业绩比较基准为：中证 500 指数收益率×95%+银行活期存款税后利率×5%。中证 500 指数扣除了沪深 300 指数样本股及最近一年日均总市值排名前 300 名的股票，再按照最近一年（新股为上市以来）的日均成交金额由高到低排名，剔除排名后 20%的股票，然后将剩余股票按照日均总市值由高到低进行排名，选取排名在前 500 名的股票作为该指数样本股。该指数综合反映了沪深证券市场内小市值公司的整体状况，并能够作为投资业绩的评价标准，为指数化投资和指数衍生产品创新提供基础条件。

2、基金转型日，指天弘量化驱动股票型证券投资基金转型为天弘中证 500 指数增强型证券投资基金的日期，即 2019 年 08 月 12 日。

3.2.2 自基金转型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500指数增强A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2019年08月12日-2019年12月31日)



天弘中证500指数增强C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2019年08月12日-2019年12月31日)

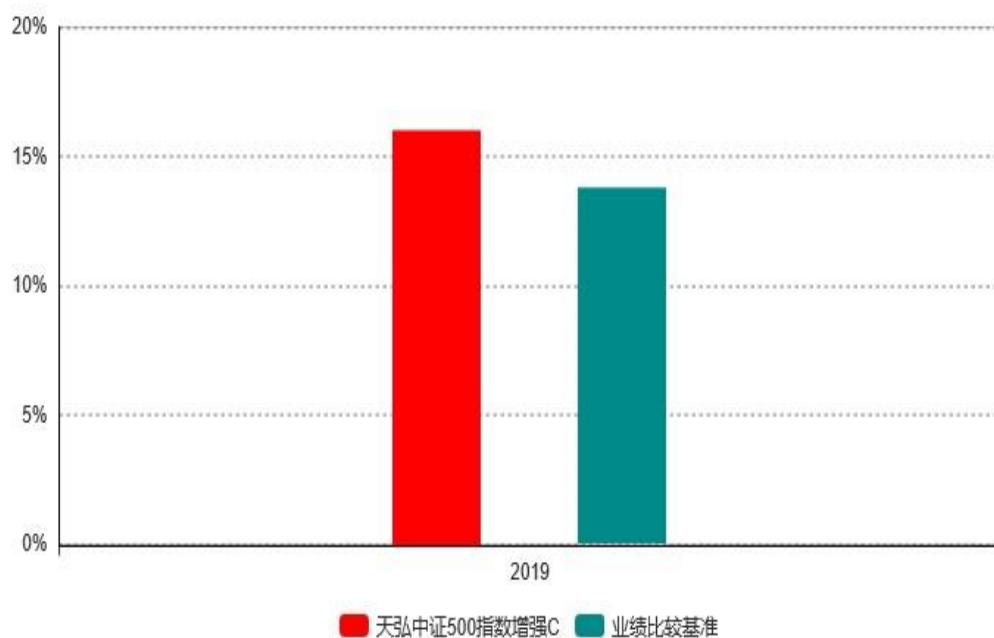
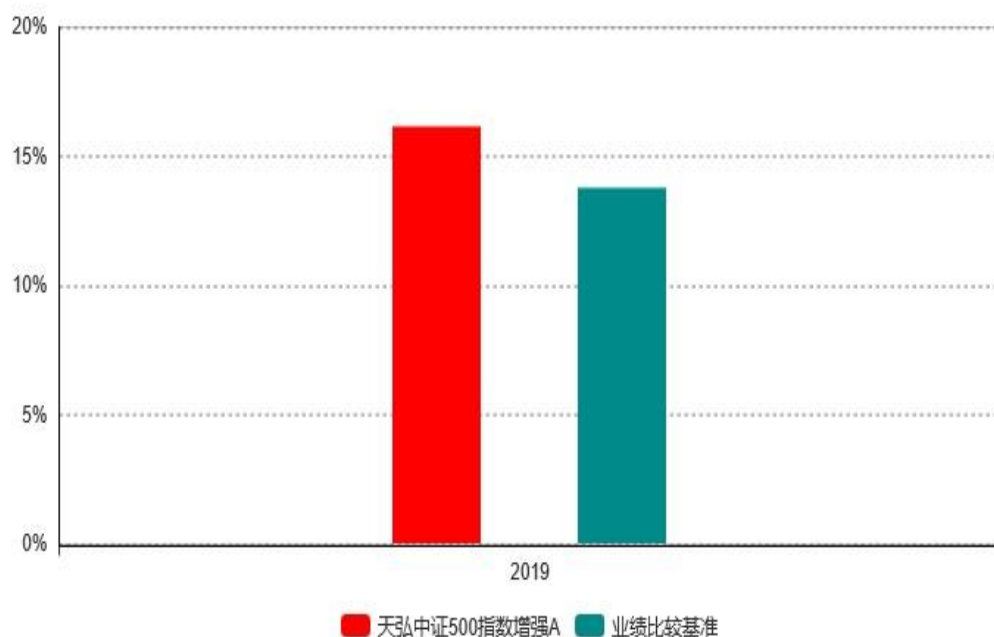


注：1、本基金于 2019 年 08 月 12 日由天弘量化驱动股票型证券投资基金转型而成，名称变更为“天弘中证 500 指数增强型证券投资基金”，自本基金转型起至披露时点不满一年。

2、按照本基金合同的约定，基金管理人应当自基金合同生效之日起 6 个月内使基金的

投资组合比例符合基金合同的有关约定。本基金的建仓期为 2019 年 08 月 12 日至 2020 年 02 月 11 日，截止本报告期末本基金仍处于建仓期。

3.2.3 自基金转型以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金于 2019 年 08 月 12 日转型。基金转型生效当年 2019 年的净值增长率按照基金转型生效后当年的实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金于2019年08月12日由天弘量化驱动股票型证券投资基金转型而成，自新基金合同生效日以来未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况（转型前）

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(2019年01月01日-2019年08月11日)		2018年(2018年01月18日-2018年12月31日)	
	天弘量化驱动股票A	天弘量化驱动股票C	天弘量化驱动股票A	天弘量化驱动股票C
本期已实现收益	1,789,815.13	1,416,310.95	-2,724,106.60	-2,854,915.32
本期利润	1,607,033.57	190,812.61	-5,234,572.51	-10,686,077.91
加权平均基金份额本期利润	0.1038	0.0092	-0.2793	-0.3011
本期加权平均净值利润率	13.87%	1.24%	-35.82%	-39.20%
本期基金份额净值增长率	12.47%	12.20%	-30.61%	-30.89%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年08月11日)		2018年末	
	天弘量化驱动股票A	天弘量化驱动股票C	天弘量化驱动股票A	天弘量化驱动股票C
期末可供分配利润	-4,055,069.52	-11,390,806.23	-6,218,991.08	-5,615,159.97
期末可供分配基金份额利润	-0.2814	-0.2910	-0.3611	-0.3681
期末基金资产净值	10,353,687.83	27,751,182.55	11,002,730.94	9,639,966.50
期末基金份额净值	0.7186	0.7090	0.6389	0.6319

3.1.3 累计期末指标	报告期末(2019年08月11日)		2018年末	
基金份额累计净值增长率	-21.96%	-22.45%	-30.61%	-30.89%

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。

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

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

天弘量化驱动股票A

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
过去六个月 (2019年07月01日-2019年08月11日)	-4.80%	1.14%	-5.87%	1.02%	1.07%	0.12%
过去一年(2019年01月01日-2019年08月11日)	12.47%	1.54%	9.56%	1.43%	2.91%	0.11%
自基金合同生效日起至 今(2018年01月18日-2019年08月11日)	-21.96%	1.47%	-21.36%	1.36%	-0.60%	0.11%

天弘量化驱动股票C

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
过去六个月 (2019年07月 01日-2019年 08月11日)	-4.83%	1.14%	-5.87%	1.02%	1.04%	0.12%
过去一年(20 19年01月01 日-2019年08 月11日)	12.20%	1.54%	9.56%	1.43%	2.64%	0.11%
自基金合同 生效日起至 今(2018年01 月18日-2019 年08月11日)	-22.45%	1.46%	-21.36%	1.36%	-1.09%	0.10%

注：1、天弘量化驱动股票型证券投资基金的业绩比较基准：中证 500 指数收益率×85%+中证综合债券指数收益率×15%。中证 500 指数包含了沪深 300 指数成份股之外的 A 股市场中流动性好、代表性强的中小盘股票，综合反映了沪深证券市场内中小市值公司的整体情况，对沪深股市中小盘的整体走势具有较强代表性且该指数认可度较高；中证综合债指数是综合反映银行间和交易所市场国债、金融债、企业债、央票及短融整体走势的跨市场债券指数，可以更全面地反映我国债券市场的整体价格变动趋势。

2、上述表格中的基金合同生效日，指《天弘量化驱动股票型证券投资基金基金合同》生效日，即 2018 年 01 月 18 日。

3.2.2 自基金转型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

天弘量化驱动股票A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图



天弘量化驱动股票C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

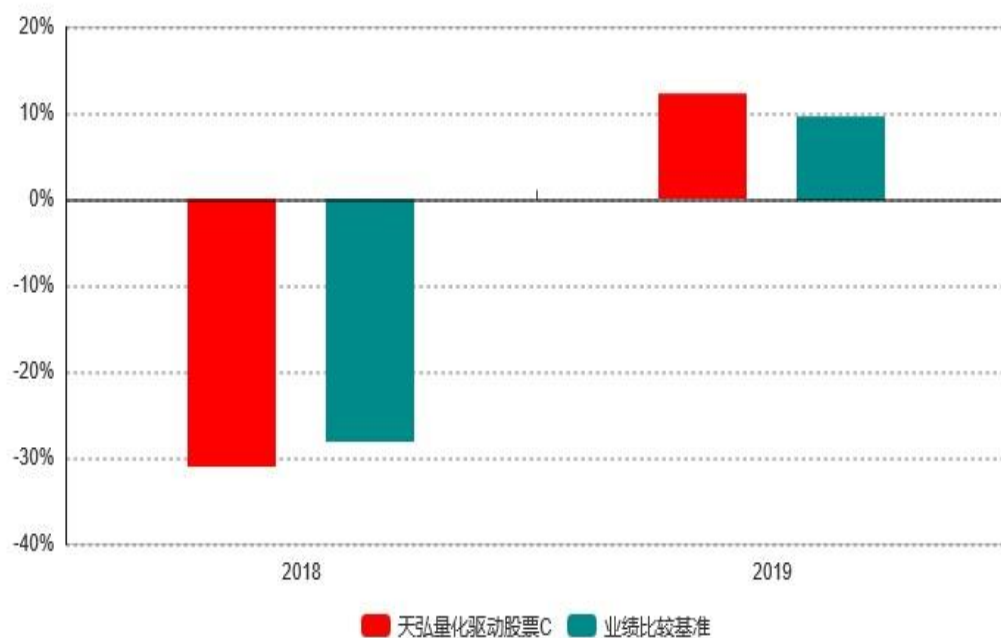
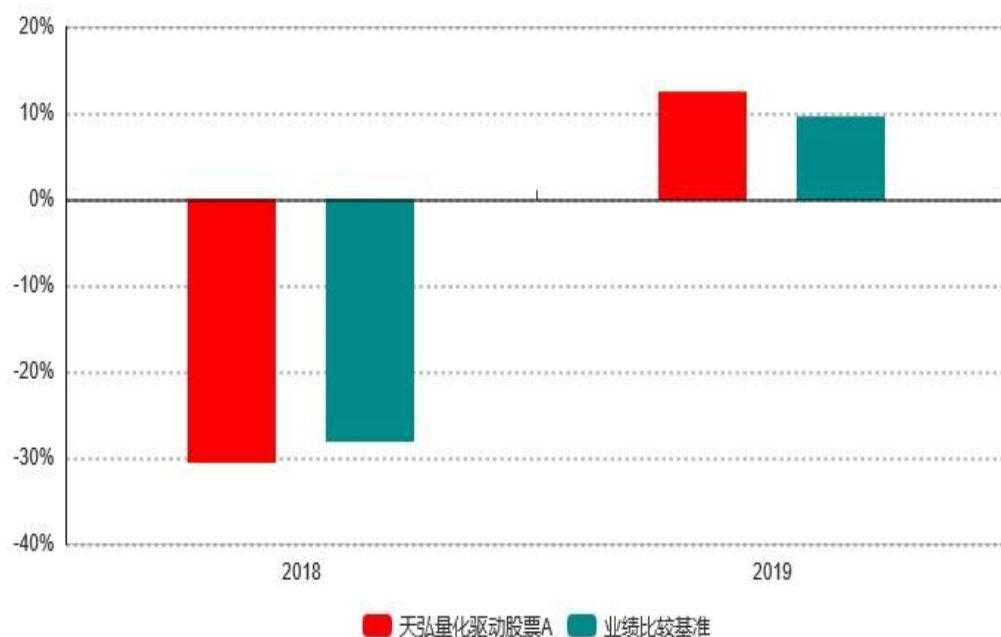


注：1、本基金于 2018 年 01 月 18 日由天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金转型而成，名称变更为“天弘量化驱动股票型证券投资基金”，且本基金已于 2019 年 08

月 12 日转型为天弘中证 500 指数增强型证券投资基金。

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。

3.2.3 自基金转型以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：本基金于 2018 年 01 月 18 日由天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金转型而成，且本基金已于 2019 年 08 月 12 日转型为天弘中证 500 指数增强型证券投资基金。基金转型生效当年 2018 年和 2019 年的净值增长率按照基金转型生效后和基金转型生效前当年的实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金于2018年01月18日由天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金转型而成，自新基金合同生效日以来未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

§ 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
浙江蚂蚁小微金融服务集团股份有限公司	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%

截至2019年12月31日，本基金管理人共管理62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（原天弘沪深300指数型发起式证券投资基金）、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（原天弘量化驱动股票型证券投资基金）、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（原天弘创业板指数型发起式证券投资基金）、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、天弘中证电子指数型发起式证券投资基金、天弘中证计算机主题指数型发起式证券投资基金（原“天弘中证计算机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。

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		
杨超	本基金基金经理；指数与数量投资部副总经理。	2019年08	—	9年	男，金融数学与计算硕士学位。历任建信基金管理

		月			有限责任公司基金经理助理，泰达宏利基金管理有限公司基金经理。2019年1月加盟本公司。
张子法	本基金基金经理。	2018年01月	2019年08月	17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。
沙川	本基金基金经理。	2018年01月	2019年08月	9年	男，数学硕士。历任中国中投证券有限责任公司量化分析师。2013年9月加盟本公司，历任金融工程研究员。

注：1、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 公平交易制度和控制方法

基金管理人一直坚持公平对待旗下所有基金的原则，严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，在研究分析、投资决策和交易执行等各个环节落实公平交易原则。公平交易范围包括各类投资组合、所有投资交易品种、以及一级市场申购、二级市场交易等所有投资交易管理活动及授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

针对公司旗下所有投资组合的交易所公开竞价交易，通过交易系统内的公平交易程序，对于不同投资组合同日同向买卖同一证券的指令自动进行比例分配。针对场外网下

交易业务，依照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部场外、网下交易业务的相关规定，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。对于以公司名义进行的交易严格按照发行分配的原则或价格优先、比例分配的原则在各投资组合间进行分配。

4.3.2 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。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

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

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

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

4.4 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

2019年基金完成了合同的变更，全年基金表现稳健，特别是在转型后，本基金更加贴合业绩比较基准的前提下，通过审慎的研究和合理的风险管理措施，较为成功地部署

和运行了相应的量化投资模型。在运行期一方面将跟踪误差控制在了较低的水平下，另一方面创造了一定幅度的超额收益。基金在行业配置和风格偏离上比较业绩比较基准保持相对中性，主要超额收益来自于个股的偏离。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2019年08月11日（2019年01月01日至2019年08月11日），天弘量化驱动股票A基金份额净值为0.7186元，天弘量化驱动股票C基金份额净值为0.7090元。报告期内份额净值增长率天弘量化驱动股票A为12.47%，天弘量化驱动股票C为12.22%，同期业绩比较基准增长率均为9.56%。

截至2019年12月31日（2019年08月12日至2019年12月31日），天弘中证500指数增强A基金份额净值为0.8346元，天弘中证500指数增强C基金份额净值为0.8226元。报告期内份额净值增长率天弘中证500指数增强A为16.14%，天弘中证500指数增强C为16.02%，同期业绩比较基准增长率均为13.77%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

进入2020年，武汉疫情快速蔓延至全国，经济活动阶段性停滞，货币和财政政策在这种新环境下可能会出现一些超预期的变化。我们也将密切关注上市公司特别是中小上市公司的盈利变化和经营状态，第一时间对其基本面信息做出跟踪，对模型进行及时调整，力争为客户获取相对可预期的业绩比较基准收益的前提下，同时获取持续的alpha收益。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人的监察稽核工作一切从合规运作、防范和控制风险、保障基金份额持有人利益出发，由独立的内控合规部门按照规定的权限和程序，认真履行职责，对公司、基金运作及员工行为的合法性、合规性进行定期和不定期监督和检查。发现问题及时提出建议并督促相关部门改进完善，及时与有关人员沟通，并定期制作监察稽核报告报公司董事会。公司经理层面成立了风险管理委员会，根据公司总体风险控制目标，分配各业务和各环节风险控制目标和要求；落实公司重大风险管理的决定或决议；听取并讨论会议成员的报告；对会议成员提出的或发现的已经存在的风险点，在充分讨论、协调基础上形成具体的风险控制措施；对潜在风险点分析讨论，拟定应对措施；对发生的风险事件和重大差错，分析原因、总结经验教训、风险定级、划分责任，向总经理办公会报告。

同时，本基金管理人根据全面性原则、独立性原则、相互制约原则、定性和定量相结合原则、重要性原则建立了一套比较完整的内部控制体系，该内部控制体系由一系列业务管理制度及相应的业务处理、控制程序组成，具体包括控制环境、风险评估、控制

活动、信息和沟通、监控等要素。本基金管理人已通过了 ISAE3402（《国际鉴证业务准则第3402号》）认证，获得无保留意见的控制设计适当性报告。

本报告期，本基金管理人全面开展基金运作监察稽核工作，确保基金投资、营销及后台运作等各环节的合法合规。通过定期检查、不定期抽查等工作方法，完善内部控制，基金运作没有出现违规行为。本报告期内，本基金管理人有关本基金的监察稽核主要工作如下：

1、在研究环节，加强研究业务独立性，注重程序合规和质量控制；在关注研究报告形式与内容的合法性基础上，跟踪检查投资备选库的入选、维护依据；进一步规范新股、新债询价、申购流程；定期检查关联方关系以及关联交易的日常维护；定期评估研究对投资的支持程度，对投资业绩的贡献度；

2、在投资交易环节，对投资运作过程中的风险点进行识别和监控，预防和控制由内部或外部流程、人员和系统失控而造成的损失；根据法律法规要求、基金合同约定、投资决策委员会的决定，适时提出增加或优化交易系统风控指标的建议，通过投资交易系统控制投资风险；跟踪每日的交易行为和交易结果，发现预警信息通过电话、邮件及合规提示及时提醒，保障投资环节的合规运作；监督检查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合规执行情况，保证各投资组合场外交易的事中合规控制；

3、投资管理人员管理环节，加强对投资管理人员即时聊天工具、办公电话、移动电话、终端设备网上交易的合规监控，监督投资管理人员直系亲属账户及股票交易申报制度、交易时间移动电话集中保管制度的有效执行，采取各种有效方式杜绝老鼠仓、不公平交易及各种形式的利益输送行为；

4、基金募集与营销环节，对基金宣传推介材料及定投、费率优惠等基金销售业务活动进行事前合规检查，做到事前防范风险，保障基金营销合法合规。在基金利用互联网平台营销方面，对各类新兴业务的活动方案进行事前合规评估，保证业务开展的同时注重事前风险防范；

5、基金运营环节，加强对注册登记、会计核算、基金清算、估值业务的稽核力度，保证基金运营安全、准确；

6、信息披露环节，严格按照信息披露管理办法的规定，认真做好本基金的信息披露工作，保证信息披露的真实、准确、完整、及时。

报告期内，本基金整体运作合法合规，内部控制和风险防范措施逐步完善，保障了基金份额持有人的利益。本基金管理人将继续以合规运作、防范和控制风险、保障基金份额持有人利益出发，提高内部控制和风险管理的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

4.7 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定与估值相关的定价服务。

4.8 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。

4.9 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

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

§ 5 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，招商证券股份有限公司在本基金的托管过程中，严格遵守了《证券投资基金法》、基金合同、托管协议和其他有关规定，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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期，本托管人按照国家有关规定、基金合同、托管协议和其他有关规定，对本基金的基金资产净值计算、基金费用开支等方面进行了认真的复核，对本基金的投资运作方面进行了监督，未发现基金管理人有关损害基金份额持有人利益的行为。报告期内，本基金未实施利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人复核审查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。

§ 6 审计报告(转型后)

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2020)第23601号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	天弘中证500指数增强型证券投资基金(原天弘量化驱动股票型证券投资基金)全体基金份额持有人
审计意见	(一)我们审计的内容 我们审计了天弘中证500指数增强型证券投资基金(原天弘量化驱动股票型证券投资基金，以下简称“天弘中证500指数增强”)的财务报表，包括2019年12月31日的资产负债表，2019年8月12日(基金合同生效日)至2019年12月31日止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。(二)我们的意见 我们认为，后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以

	下简称“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,公允反映了天弘中证500指数增强2019年12月31日的财务状况以及2019年8月12日(基金合同生效日)至2019年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。按照中国注册会计师职业道德守则,我们独立于天弘中证500指数增强,并履行了职业道德方面的其他责任。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	无
管理层和治理层对财务报表的责任	天弘中证500指数增强的基金管理人天弘基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表,使其实现公允反映,并设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时,基金管理人管理层负责评估天弘中证500指数增强的持续经营能力,披露与持续经营相关的事项(如适用),并运用持续经营假设,除非基金管理人管理层计划清算天弘中证500指数增强、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督天弘中证500指数增强的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证,并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平

	的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作： （一）识别和评估由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。 （二）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。 （三）评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。 （四）对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对天弘中证500指数增强持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致天弘中证500指数增强不能持续经营。 （五）评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。
--	---

会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
注册会计师的姓名	张振波、周祎
会计师事务所的地址	中国上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
审计报告日期	2020-04-23

§ 6 审计报告(转型前)

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2020)第23576号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	天弘量化驱动股票型证券投资基金全体基金份额持有人
审计意见	(一)我们审计的内容 我们审计了天弘量化驱动股票型证券投资基金(以下简称“天弘量化驱动”)的财务报表,包括2019年8月11日(基金转型前日)的资产负债表,2019年1月1日至2019年8月11日(基金转型前日)止期间的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。(二)我们的意见 我们认为,后附的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)、中国证券投资基金业协会(以下简称“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,公允反映了天弘量化驱动2019年8月11日(基金转型前日)的财务状况以及2019年1月1日至2019年8月11日(基金转型前日)止期间的经营成果和基金净值变动情况。
形成审计意见的基础	我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行

	了审计工作。审计报告的“注册会计师对财务报表审计的责任”部分进一步阐述了我们在这些准则下的责任。我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。按照中国注册会计师职业道德守则，我们独立于天弘量化驱动，并履行了职业道德方面的其他责任。
强调事项	无
其他事项	无
其他信息	无
管理层和治理层对财务报表的责任	天弘量化驱动的基金管理人天弘基金管理有限公司(以下简称“基金管理人”)管理层负责按照企业会计准则和中国证监会、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财务报表，使其实现公允反映，并设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。在编制财务报表时，基金管理人管理层负责评估天弘量化驱动的持续经营能力，披露与持续经营相关的事项(如适用)，并运用持续经营假设，除非基金管理人管理层计划清算天弘量化驱动、终止运营或别无其他现实的选择。基金管理人治理层负责监督天弘量化驱动的财务报告过程。
注册会计师对财务报表审计的责任	我们的目标是对财务报表整体是否不存在由于舞弊或错误导致的重大错报获取合理保证，并出具包含审计意见的审计报告。合理保证是高水平的保证，但并不能保证按照审计准则执行的审计在某一重大错报存在时总能发现。错报可能由于舞弊或错误导致，如果合理预期错报单独或汇总起来可能影响财务报表使用者依据财务报表作出的经济决策，则通常认为错报是重大的。在按照审计准则执行审计工作的过程中，我们运用职业判断，并保持职业怀疑。同时，我们也执行以下工作：（一）识别和评估由于舞弊或错误

	导致的财务报表重大错报风险；设计和实施审计程序以应对这些风险，并获取充分、适当的审计证据，作为发表审计意见的基础。由于舞弊可能涉及串通、伪造、故意遗漏、虚假陈述或凌驾于内部控制之上，未能发现由于舞弊导致的重大错报的风险高于未能发现由于错误导致的重大错报的风险。（二）了解与审计相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。（三）评价基金管理人管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计及相关披露的合理性。（四）对基金管理人管理层使用持续经营假设的恰当性得出结论。同时，根据获取的审计证据，就可能导致对天弘量化驱动持续经营能力产生重大疑虑的事项或情况是否存在重大不确定性得出结论。如果我们得出结论认为存在重大不确定性，审计准则要求我们在审计报告中提请报表使用者注意财务报表中的相关披露；如果披露不充分，我们应当发表非无保留意见。我们的结论基于截至审计报告日可获得的信息。然而，未来的事项或情况可能导致天弘量化驱动不能持续经营。（五）评价财务报表的总体列报(包括披露)、结构和内容，并评价财务报表是否公允反映相关交易和事项。我们与基金管理人治理层就计划的审计范围、时间安排和重大审计发现等事项进行沟通，包括沟通我们在审计中识别出的值得关注的内部控制缺陷。
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
注册会计师的姓名	张振波、周祎
会计师事务所的地址	中国上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
审计报告日期	2020-04-23

§ 7 年度财务报表(转型后)

7.1 资产负债表

会计主体：天弘中证500指数增强型证券投资基金

报告截止日：2019年12月31日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2019年12月31日
资 产：		
银行存款	7.4.7.1	8,723,455.52
结算备付金		1,059,565.05
存出保证金		99,444.82
交易性金融资产	7.4.7.2	149,549,267.62
其中：股票投资		149,549,267.62
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	7.4.7.3	—
买入返售金融资产	7.4.7.4	—
应收证券清算款		236,815.57
应收利息	7.4.7.5	4,894.15
应收股利		—
应收申购款		487,076.31
递延所得税资产		—
其他资产	7.4.7.6	—
资产总计		160,160,519.04
负债和所有者权益	附注号	本期末 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	7.4.7.3	—
卖出回购金融资产款		—

应付证券清算款		-
应付赎回款		2,065,243.37
应付管理人报酬		82,832.86
应付托管费		13,805.46
应付销售服务费		17,971.00
应付交易费用	7.4.7.7	151,217.45
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	90,707.08
负债合计		2,421,777.22
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	190,118,789.19
未分配利润	7.4.7.10	-32,380,047.37
所有者权益合计		157,738,741.82
负债和所有者权益总计		160,160,519.04

注：1. 报告截止日2019年12月31日，天弘中证500指数增强型证券投资基金A类基金份额净值0.8346元，天弘中证500指数增强型证券投资基金C类基金份额净值0.8226元；基金份额总额190,118,789.19份，其中天弘中证500指数增强型证券投资基金A类基金份额112,188,364.07份，天弘中证500指数增强型证券投资基金C类基金份额77,930,425.12份。

2、天弘量化驱动股票型证券投资基金于2019年08月12日转型为天弘中证500指数增强型证券投资基金。本财务报表的实际编制期间为2019年08月12日至2019年12月31日，上年度可比期间的数据将在转型前表格中一并披露（下同）。

7.2 利润表

会计主体：天弘中证500指数增强型证券投资基金

本报告期：2019年08月12日至2019年12月31日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期2019年08月12日（新基金合同生效日）至2019年1
-----	-----	--------------------------------

		2月31日
一、收入		13,936,251.10
1. 利息收入		48,405.59
其中：存款利息收入	7.4.7.11	48,405.59
债券利息收入		-
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）		5,269,388.50
其中：股票投资收益	7.4.7.12	5,220,323.65
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	-
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.2	-
贵金属投资收益		-
衍生工具收益	7.4.7.14	-
股利收益	7.4.7.15	49,064.85
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	8,464,670.33
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		-
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	153,786.68
减：二、费用		875,235.99
1. 管理人报酬		232,807.18
2. 托管费		38,801.20
3. 销售服务费		65,110.12
4. 交易费用	7.4.7.18	515,807.10
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	7.4.7.19	22,710.39
三、利润总额（亏损总额以“-”号填		13,061,015.11

列)		
减：所得税费用		-
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		13,061,015.11

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：天弘中证500指数增强型证券投资基金

本报告期：2019年08月12日至2019年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2019年08月12日（新基金合同生效日）至2019年12月31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）	53,550,746.13	-15,445,875.75	38,104,870.38
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	-	13,061,015.11	13,061,015.11
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）	136,568,043.06	-29,995,186.73	106,572,856.33
其中：1. 基金申购款	211,799,602.07	-45,681,598.33	166,118,003.74
2. 基金赎回款	-75,231,559.01	15,686,411.60	-59,545,147.41
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）	190,118,789.19	-32,380,047.37	157,738,741.82

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

郭树强

薄贺龙

肖慧敏

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

天弘中证500指数增强型证券投资基金(以下简称“本基金”)系由原天弘量化驱动股票型证券投资基金(以下简称“原基金”)转型而来,天弘量化驱动股票型证券投资基金系由原天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金转型而来。本基金合同生效日为2019年8月12日,本基金的基金管理人为天弘基金管理有限公司,基金托管人为招商证券股份有限公司。

根据原基金基金份额持有人大会以通讯方式通过的《关于天弘量化驱动股票型证券投资基金转型有关事项的议案》,基金管理人天弘基金管理有限公司于2019年8月12日发布了《天弘基金管理有限公司关于天弘量化驱动股票型证券投资基金基金份额持有人大会决议生效的公告》。根据《天弘量化驱动股票型证券投资基金转型方案说明书》以及相关法律法规的规定,经与基金托管人招商证券股份有限公司协商一致,基金管理人已将《天弘量化驱动股票型证券投资基金基金合同》、《天弘量化驱动股票型证券投资基金托管协议》修订为《天弘中证500 指数增强型证券投资基金基金合同》、《天弘中证500指数增强型证券投资基金托管协议》,并据此更新了《天弘中证500 指数增强型证券投资基金招募说明书》,上述文件已经中国证监会变更注册。《天弘中证500指数增强型证券投资基金基金合同》和《天弘中证500指数增强型证券投资基金托管协议》自2019年8月12日起生效,原《天弘量化驱动股票型证券投资基金基金合同》、《天弘量化驱动股票型证券投资基金托管协议》自同一起失效。

根据《天弘中证500指数增强型证券投资基金基金合同》和《天弘中证500指数增强型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、销售服务费收取方式的不同,将基金份额分为不同的类别。在投资人申购、赎回基金时收取申购费用、赎回费用,并不再从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为天弘中证500指数增强型证券投资基金A类(以下简称“A类基金”);在投资人申购基金时不收取申购费用、赎回时收取赎回费用,且从本类别基金资产中计提销售服务费的基金份额,称为天弘中证500指数增强型证券投资基金C类(以下简称“C类基金”)。本基金A类和C类基金份额分别设置代码,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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘中证500指数增强型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，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、金融债、地方政府债、企业债、公司债、次级债、可转换债券（含可分离交易可转债）、可交换债券、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资券等）、货币市场工具、同业存单、银行存款、债券回购、股指期货、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具（但须符合中国证监会相关规定）。本基金投资于股票的资产不低于基金资产的90%，投资于标的指数成份股、备选成份股的资产占非现金基金资产的比例不低于非现金基金资产的80%；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，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，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500指数收益率 $\times$ 95%+银行活期存款税后利率 $\times$ 5%。

本财务报表由本基金的基金管理人天弘基金管理有限公司于2020年4月23日批准报出。

7.4.2 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指数增强型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2019年08月12日（新基金合同生效日）至2019年12月31日止期间的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2019年12月31日的财务状况以及2019年08月12日（新基金合同生效日）至2019年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历 1 月 1 日起至 12 月 31 日止。本期财务报表的实际编制期间为 2019 年 08 月 12 日(新基金合同生效日)至 2019 年 12 月 31 日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：（1）收取该金融资产现金流量的合同权利终止；（2）该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和

报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/（累计亏损）。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

（1）对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃（包括涨跌停时的交易不活跃）等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协（AMAC）基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

（2）对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引（试行）》（以下简称“指引”），按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

（3）对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、可交换债券、资产支持证券和私募债券除外）及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种（可转换债券、可交换债券、资产支持证券和私募债券除外），按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日
活期存款	8,723,455.52
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	8,723,455.52

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末2019年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		143,894,305.31	149,549,267.62	5,654,962.31
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		143,894,305.31	149,549,267.62	5,654,962.31

7.4.7.3 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。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 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。

7.4.7.4.2 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。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日
应收活期存款利息	4,321.05
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	523.93
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	49.17
合计	4,894.15

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日
交易所市场应付交易费用	151,217.45
银行间市场应付交易费用	-
合计	151,217.45

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	707.08
应付证券出借违约金	-
预提费用	40,000.00
其他应付	50,000.00
合计	90,707.08

7.4.7.9 实收基金

7.4.7.9.1 天弘中证500指数增强A

金额单位：人民币元

项目 (天弘中证500指数增强A)	本期2019年08月12日（新基金合同生效日）至2019年1 2月31日	
	基金份额（份）	账面金额
新基金合同生效日	14,408,757.35	14,408,757.35
本期申购	117,589,773.75	117,589,773.75
本期赎回（以“-”号填列）	-19,810,167.03	-19,810,167.03
本期末	112,188,364.07	112,188,364.07

7.4.7.9.2 天弘中证500指数增强C

金额单位：人民币元

项目	本期2019年08月12日（新基金合同生效日）至2019年1 2月31日
----	---

（天弘中证500指数增强C）	基金份额（份）	账面金额
新基金合同生效日	39,141,988.78	39,141,988.78
本期申购	94,209,828.32	94,209,828.32
本期赎回（以“-”号填列）	-55,421,391.98	-55,421,391.98
本期末	77,930,425.12	77,930,425.12

注：1、申购含转换转入份额；赎回含转换转出份额。

2、根据《天弘中证500指数增强型证券投资基金基金合同》、《天弘中证500指数增强型证券投资基金招募说明书》、《天弘基金管理有限公司关于天弘量化驱动股票型证券投资基金基金份额持有人大会决议生效的公告》的相关规定，自2019年08月12日起，原天弘量化驱动股票型证券投资基金基金份额持有人转为天弘中证500指数增强型证券投资基金基金份额持有人。根据的《天弘基金管理有限公司关于天弘中证500指数增强型证券投资基金开放日常申购、赎回、定期定额投资及转换业务的公告》，本基金自2019年08月12日起正常办理日常申购、赎回、定期定额投资及转换业务。

7.4.7.10 未分配利润

7.4.7.10.1 天弘中证500指数增强A

单位：人民币元

项目 （天弘中证500指数增强A）	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
新基金合同生效日	-2,889,012.04	-1,166,057.48	-4,055,069.52
本期利润	2,222,865.33	4,323,556.35	6,546,421.68
本期基金份额交易产生的变动数	-17,251,293.18	-3,791,710.20	-21,043,003.38
其中：基金申购款	-20,719,781.12	-4,252,353.60	-24,972,134.72
基金赎回款	3,468,487.94	460,643.40	3,929,131.34
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-17,917,439.89	-634,211.33	-18,551,651.22

7.4.7.10.2 天弘中证500指数增强C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
----	-------	-------	---------

（天弘中证500指数增强C）			
新基金合同生效日	-8,223,959.68	-3,166,846.55	-11,390,806.23
本期利润	2,373,479.45	4,141,113.98	6,514,593.43
本期基金份额交易产生的变动数	-7,458,655.37	-1,493,527.98	-8,952,183.35
其中：基金申购款	-17,854,756.34	-2,854,707.27	-20,709,463.61
基金赎回款	10,396,100.97	1,361,179.29	11,757,280.26
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-13,309,135.60	-519,260.55	-13,828,396.15

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2019年08月12日（新基金合同生效日）至2019年12月31日
活期存款利息收入	44,958.48
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	3,107.01
其他	340.10
合计	48,405.59

7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年08月12日（新基金合同生效日）至2019年12月31日
卖出股票成交总额	266,933,560.16
减：卖出股票成本总额	261,713,236.51
买卖股票差价收入	5,220,323.65

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期未取得债券投资收益。

7.4.7.13.2 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。

7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期未取得衍生工具投资收益。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年08月12日（新基金合同生效日）至2019年12月 31日
股票投资产生的股利收益	49,064.85
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	49,064.85

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年08月12日（新基金合同生效日）至2019年12月31日
1. 交易性金融资产	8,464,670.33
——股票投资	8,464,670.33
——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	8,464,670.33

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年08月12日（新基金合同生效日）至2019年12月31日
基金赎回费收入	148,172.46
基金转换费收入	5,614.22
合计	153,786.68

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年08月12日（新基金合同生效日）至2019年12月31日
交易所市场交易费用	515,807.10
银行间市场交易费用	-
合计	515,807.10

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年08月12日（新基金合同生效日）至2019年12月31日
审计费用	3,343.26
信息披露费	-57,806.78
证券出借违约金	-
其他应付	77,173.91

合计	22,710.39
----	-----------

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 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。

7.4.9 关联方关系

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
招商证券股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
浙江蚂蚁小微金融服务集团股份有限公司	基金管理人的股东
天津信托有限责任公司	基金管理人的股东
内蒙古君正能源化工集团股份有限公司	基金管理人的股东
芜湖高新投资有限公司	基金管理人的股东
新疆天瑞博丰股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
新疆天惠新盟股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
新疆天阜恒基股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
新疆天聚宸兴股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
天弘创新资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司

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。

7.4.10 本报告期的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年08月12日（新基金合同生效日）至2019年12月31日	
	成交金额	占当期股票成交 总额的比例
招商证券股份有限 公司	410,372,459.25	64.81%

7.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名 称	本期 2019年08月12日（新基金合同生效日）至2019年12月31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
招商证券 股份有限 公司	94,924.22	49.69%	94,924.22	62.77%

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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年08月12日（新基金合同生效日）至2019年 12月31日
----	---

当期发生的基金应支付的管理费	232,807.18
其中：支付销售机构的客户维护费	38,656.76

注：1. 支付基金管理人天弘基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.60% 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 × 0.60% / 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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年08月12日（新基金合同生效日）至2019年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	38,801.20

注：支付基金托管人招商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 × 0.10% / 当年天数。

7.4.10.2.3 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 2019年08月12日（新基金合同生效日）至2019年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	天弘中证500指数增强A	天弘中证500指数增强C	合计
天弘基金管理有 限公司	-	37,641.17	37,641.17
招商证券股份有 限公司	-	13.44	13.44
合计	-	37,654.61	37,654.61

注：1、支付C类基金份额销售机构的销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值 0.30% 的年费率计提，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。销售服务费的计算公式为：日销售服务费=前一日C类基金份额基金资产净值 X 0.30% / 当年天数。

2、本基金A类份额不收取销售服务费。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期末与关联方进行过银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 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

本基金本报告期内转融通证券出借业务未发生重大关联交易事项。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 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500指数增强A

份额单位：份

项目	本期 2019年08月12日（新基金合同生效日）至2019年12月31日
新基金合同生效日（2019年08月12日）持有的基金份额	5,000,000.00
报告期初持有的基金份额	—
报告期间申购/买入总份额	69,247,358.12
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	74,247,358.12
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	66.18%

天弘中证500指数增强C

份额单位：份

项目	本期 2019年08月12日（新基金合同生效日）至2019年12月31日
新基金合同生效日（2019年08月12日）持有的基金份额	5,000,000.00
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	5,000,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	6.42%

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 A、C类各自级别的份额总额计算。

7.4.10.5.2 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

本基金本期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.10.6 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 2019年08月12日（新基金合同生效日）至2019年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
招商证券股份有限公司	8,723,455.52	44,958.48

注：本基金的银行存款由本基金托管人招商证券股份有限公司保管，存放在具有基金托管资格的交通银行股份有限公司，按银行同业利率或约定利率计息。

7.4.10.7 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期未在承销期内参与关联方承销证券交易。

7.4.10.8 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 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。

7.4.12 期末（2019年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
688123	聚辰股份	2019-12-16	2020-06-23	科创板打新限售	33.25	58.12	3,330	110,722.50	193,539.60	-
688081	兴图新科	2019-12-26	2020-07-06	新股未上市	28.21	28.21	2,628	74,135.88	74,135.88	-
002973	侨银环保	2019-12-27	2020-01-06	新股未上市	5.74	5.74	1,146	6,578.04	6,578.04	-

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。

7.4.12.2 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
000029	深深房A	2016-09-14	重大资产重组	10.97	-	-	6,704	78,333.49	73,542.88	-

注：本基金截至2019年12月31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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2019年12月31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。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2019年12月31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。

7.4.12.4 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 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在对标的指数进行有效跟踪的被动投资基础上，结合增强型的主动投资，力争获取高于标的指数的投资收益。

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。

7.4.13.2 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招商证券股份有限公司开立于具有基金托管人资格的交通银行股份有限公司的托管账户，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。

于2019年12月31日，本基金无债券投资。

7.4.13.3 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2019年12月31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。

7.4.13.3.1 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7.4.12。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%。于2019年12月31日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为0.22%。

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。于2019年12月31日，本基金组合资产中7个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末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	8,723,455.52	-	-	-	8,723,455.52

天弘中证 500 指数增强型证券投资基金（原天弘量化驱动股票型
证券投资基金转型）2019 年年度报告

款					
结算备付金	1,058,564.05	-	-	1,001.00	1,059,565.05
存出保证金	99,444.82	-	-	-	99,444.82
交易性金融资产	-	-	-	149,549,267.62	149,549,267.62
应收证券清算款	-	-	-	236,815.57	236,815.57
应收利息	-	-	-	4,894.15	4,894.15
应收申购款	-	-	-	487,076.31	487,076.31
资产总计	9,881,464.39	-	-	150,279,054.65	160,160,519.04
负债					
应付赎回款	-	-	-	2,065,243.37	2,065,243.37
应付管理人报酬	-	-	-	82,832.86	82,832.86
应付托管费	-	-	-	13,805.46	13,805.46
应付销售服务费	-	-	-	17,971.00	17,971.00
应付交易费用	-	-	-	151,217.45	151,217.45
其他负债	-	-	-	90,707.08	90,707.08
负债总计	-	-	-	2,421,777.22	2,421,777.22
利率敏感度缺口	9,881,464.39	-	-	147,857,277.43	157,738,741.82

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2019年12月31日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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的股票，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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于股票的资产不低于基金资产的90%，投资于标的指数成份股、备选成份股的资产占非现金基金资产的比例不低于非现金基金资产的80%；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，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例(%)

交易性金融资产—股票投资	149,549,267.62	94.81
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	149,549,267.62	94.81

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注7.4.1)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 2019年12月31日
	业绩比较基准(附注7.4.1)上升5%	8,348,438.44
	业绩比较基准(附注7.4.1)下降5%	-8,348,438.44

7.4.14 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2019年12月31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149,201,471.22元，属于第二层次的余额为347,796.40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2019年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(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 年度财务报表(转型前)

7.1 资产负债表

会计主体：天弘量化驱动股票型证券投资基金

报告截止日：2019年08月11日

单位：人民币元

资 产	附注 号	本期末 2019年08月11日	上年度末 2018年12月31日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	2,215,534.33	1,546,218.74
结算备付金		182,217.75	133,992.22
存出保证金		29,968.78	72,253.39
交易性金融资产	7.4.7.2	35,805,843.04	19,257,000.69
其中：股票投资		35,805,843.04	19,257,000.69
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	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		20,366.36	-
应收利息	7.4.7.5	5,704.33	842.01
应收股利		-	-
应收申购款		38,048.74	64,264.43
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		38,297,683.33	21,074,571.48
负债和所有者权益	附注号	本期末 2019年08月11日	上年度末 2018年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		55,300.20	28,902.18
应付管理人报酬		17,619.49	26,739.89
应付托管费		2,936.58	4,456.63
应付销售服务费		3,416.64	3,296.50
应付交易费用	7.4.7.7	19,016.86	28,468.15
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	94,523.18	340,010.69
负债合计		192,812.95	431,874.04
所有者权益：			

实收基金	7.4.7.9	53,550,746.13	32,476,848.49
未分配利润	7.4.7.10	-15,445,875.75	-11,834,151.05
所有者权益合计		38,104,870.38	20,642,697.44
负债和所有者权益总计		38,297,683.33	21,074,571.48

注：1. 报告截止日2019年08月11日，天弘量化驱动股票型证券投资基金A类基金份额净值0.7186元，天弘量化驱动股票型证券投资基金C类基金份额净值0.7090元；基金份额总额53,550,746.13份，其中天弘量化驱动股票型证券投资基金A类基金份额

14,408,757.35份，天弘量化驱动股票型证券投资基金C类基金份额39,141,988.78份。

2、天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金于2018年01月18日转型为天弘量化驱动股票型证券投资基金，且天弘量化驱动股票型证券投资基金于2019年08月12日转型为天弘中证500指数增强型证券投资基金。本财务报表的实际编制期间为2019年01月01日至2019年08月11日，上年度可比期间为2018年01月18日至2018年12月31日（下同）。

7.2 利润表

会计主体：天弘量化驱动股票型证券投资基金

本报告期：2019年01月01日至2019年08月11日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期2019年01月01日至2019年08月11日	上年度可比期间2018年01月18日至2018年12月31日
一、收入		2,384,273.19	-14,219,370.88
1. 利息收入		19,490.44	90,681.05
其中：存款利息收入	7.4.7.11	19,490.44	72,169.81
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	18,511.24
证券出借利息收入		-	-
其他利息收入		-	-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		3,728,598.98	-4,394,762.98

其中：股票投资收益	7.4.7.12	3,351,755.11	-4,796,409.42
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	-	-
资产支持证券投资 收益	7.4.7.13. 2	-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	376,843.87	401,646.44
3. 公允价值变动收益（损 失以“-”号填列）	7.4.7.16	-1,408,279.90	-10,341,628.50
4. 汇兑收益（损失以“-” 号填列）		-	-
5. 其他收入（损失以“-” 号填列）	7.4.7.17	44,463.67	426,339.55
减：二、费用		586,427.01	1,701,279.54
1. 管理人报酬		244,724.99	599,110.09
2. 托管费		40,787.46	99,851.65
3. 销售服务费		36,986.69	103,978.53
4. 交易费用	7.4.7.18	169,464.35	564,905.02
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	7.4.7.19	94,463.52	333,434.25
三、利润总额（亏损总额 以“-”号填列）		1,797,846.18	-15,920,650.42
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以“-” 号填列）		1,797,846.18	-15,920,650.42

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：天弘量化驱动股票型证券投资基金

本报告期：2019年01月01日至2019年08月11日

单位：人民币元

项 目	本期 2019年01月01日至2019年08月11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)	32,476,848.49	-11,834,151.05	20,642,697.44
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	1,797,846.18	1,797,846.18
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)	21,073,897.64	-5,409,570.88	15,664,326.76
其中：1. 基金申购款	42,992,339.54	-10,431,263.87	32,561,075.67
2. 基金赎回款	-21,918,441.90	5,021,692.99	-16,896,748.91
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)	53,550,746.13	-15,445,875.75	38,104,870.38
项 目	上年度可比期间 2018年01月18日至2018年12月31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)	104,163,445.56	-8,801,887.68	95,361,557.88
二、本期经营活动	-	-15,920,650.42	-15,920,650.42

产生的基金净值变动数(本期利润)			
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)	-71,686,597.07	12,888,387.05	-58,798,210.02
其中：1. 基金申购款	145,457,547.74	-32,060,587.10	113,396,960.64
2. 基金赎回款	-217,144,144.81	44,948,974.15	-172,195,170.66
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)	32,476,848.49	-11,834,151.05	20,642,697.44

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署：

郭树强

薄贺龙

肖慧敏

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

天弘量化驱动股票型证券投资基金(以下简称“本基金”)系由原天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金(以下简称“原基金”)转型而来。本基金合同生效日为2018年1月18日，本基金的基金管理人为天弘基金管理有限公司，基金托管人为招商证券股份有限公司。

根据原基金份额持有人大会以通讯方式审议通过的《关于天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金转型有关事项的议案》，本基金的基金管理人天弘基金管理有限公司于2018年1月18日发布了《关于天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金基

金份额持有人大会决议生效的公告》。根据《天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金转型方案说明书》以及相关法律法规的规定，经与基金托管人招商证券股份有限公司协商一致，本基金的基金管理人天弘基金管理有限公司将《天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金基金合同》、《天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金托管协议》修订为《天弘量化驱动股票型证券投资基金基金合同》、《天弘量化驱动股票型证券投资基金托管协议》，并已经中国证监会证监许可[2017]1261号《关于准予天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金变更注册的批复》变更注册。《天弘量化驱动股票型证券投资基金基金合同》、《天弘量化驱动股票型证券投资基金托管协议》将自《关于天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金基金份额持有人大会决议生效的公告》公告发布之日，即2018年1月18日起生效，《天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金基金合同》、《天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金托管协议》自同日失效。

根据《天弘量化驱动股票型证券投资基金基金合同》和《天弘量化驱动股票型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。收取申购费用的，而不是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为天弘量化驱动股票型证券投资基金A类（以下简称“A类基金”）；不收取申购费用的，而是在本类别基金资产中计提销售服务费的，称为天弘量化驱动股票型证券投资基金C类（以下简称“C类基金”）。A类基金和C类基金两种收费模式并存，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。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘量化驱动股票型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，包括国内依法发行上市的股票（包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票）、债券（包括国债、央行票据、金融债券、企业债券、公司债券、中期票据、短期融资券、超短期融资券、次级债券、政府支持机构债券、地方政府债券、中小企业私募债券、可转换债券（含分离交易可转债）、可交易债券及其他经中国证监会允许投资的债券）、债券回购、资产支持证券、银行存款、同业存单、货币市场工具、权证、股指期货以及法律法规或中国证监会允许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80%；投资于权证的资产比例不低于基金资产的3%，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。本基金的业绩比较基准：中证500指数收益率×85%+中证综合债券指数收益率×15%。

本财务报表由本基金的基金管理人天弘基金管理有限公司于2020年4月23日批准报出。

7.4.2 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》、《天弘量化驱动股票型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4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。

经中国证监会批准，基金管理人天弘基金管理有限公司将本基金于基金合同失效日转型为天弘中证500指数增强型证券投资基金并相应延长存续期至不定期，因此本基金财务报表仍以本基金持续经营假设为编制基础。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2019年01月01日至2019年08月11日止期间的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2019年08月11日的财务状况以及2019年01月01日至2019年08月11日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2019年01月01日至2019年08月11日，比较财务报表的实际编制期间为2018年01月18日（基金合同生效日）至2018年12月31日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。除衍生工具所产生的金融资产在资产负债表中以衍生金融资产列示外，以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资、资产支持证券投资和衍生工具按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易且最近交易日后未发生影响公允价值计量的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。有充足证据表明估值日或最近交易日的市场交易价格不能真实反映

公允价值的，应对市场交易价格进行调整，确定公允价值。与上述投资品种相同，但具有不同特征的，应以相同资产或负债的公允价值为基础，并在估值技术中考虑不同特征因素的影响。特征是指对资产出售或使用的限制等，如果该限制是针对资产持有者的，那么在估值技术中不应将该限制作为特征考虑。此外，基金管理人不应考虑因大量持有相关资产或负债所产生的溢价或折价。

(2) 当金融工具不存在活跃市场，采用在当前情况下适用并且有足够可利用数据和其他信息支持的估值技术确定公允价值。采用估值技术时，优先使用可观察输入值，只有在无法取得相关资产或负债可观察输入值或取得不切实可行的情况下，才可以使用不可观察输入值。

(3) 如经济环境发生重大变化或证券发行人发生影响金融工具价格的重大事件，应对估值进行调整并确定公允价值。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税及由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项，根据资产支持证

券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分，将本金部分冲减资产支持证券投资成本，并将投资收益部分扣除在适用情况下由基金管理人缴纳的增值税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

本基金同一类别的每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：（1）该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；（2）本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；（3）本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法、市盈率法、现金流量折现法等估值技术进行估值。

(2) 对于在锁定期内的非公开发行股票、首次公开发行股票时公司股东公开发售股份、通过大宗交易取得的带限售期的股票等流通受限股票，根据中国基金业协会中基协发[2017]6号《关于发布〈证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)〉的通知》之附件《证券投资基金投资流通受限股票估值指引(试行)》(以下简称“指引”)，按估值日在证券交易所上市交易的同一股票的公允价值扣除中证指数有限公司根据指引所独立提供的该流通受限股票剩余限售期对应的流动性折扣后的价值进行估值。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券、资产支持证券和私募债券除外)及在银行间同业市场交易的固定收益品种，根据中国证监会公告[2017]13号《中国证监会关于证券投资基金估值业务的指导意见》及《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场固定收益品种按照中债金融估值中心有限公司所独立提供的估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 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。

7.4.6 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，以产生的利息及利息性质的收入为销售额。

(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。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2019年08月11日	上年度末 2018年12月31日
----	--------------------	---------------------

活期存款	2,215,534.33	1,546,218.74
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	2,215,534.33	1,546,218.74

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末2019年08月11日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		38,615,551.06	35,805,843.04	-2,809,708.02
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		38,615,551.06	35,805,843.04	-2,809,708.02
项目		上年度末2018年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		20,658,428.81	19,257,000.69	-1,401,428.12
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	20,658,428.81	19,257,000.69	-1,401,428.12

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2019年08月11日	上年度末 2018年12月31日
应收活期存款利息	5,346.17	739.93
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	310.54	66.33
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	47.62	35.75
合计	5,704.33	842.01

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2019年08月11日	上年度末 2018年12月31日
交易所市场应付交易费用	19,016.86	28,468.15
银行间市场应付交易费用	-	-
合计	19,016.86	28,468.15

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2019年08月11日	上年度末 2018年12月31日
应付券商交易单元保证金	-	-
应付赎回费	59.66	10.69
应付证券出借违约金	-	-
预提费用	94,463.52	340,000.00
合计	94,523.18	340,010.69

7.4.7.9 实收基金

7.4.7.9.1 天弘量化驱动股票A

金额单位：人民币元

项目 (天弘量化驱动股票A)	本期2019年01月01日至2019年08月11日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	17,221,722.02	17,221,722.02
本期申购	5,013,808.56	5,013,808.56
本期赎回（以“-”号填列）	-7,826,773.23	-7,826,773.23
本期末	14,408,757.35	14,408,757.35

7.4.7.9.2 天弘量化驱动股票C

金额单位：人民币元

项目 (天弘量化驱动股票C)	本期2019年01月01日至2019年08月11日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	15,255,126.47	15,255,126.47
本期申购	37,978,530.98	37,978,530.98
本期赎回（以“-”号填列）	-14,091,668.67	-14,091,668.67
本期末	39,141,988.78	39,141,988.78

注：申购含转换转入份额；赎回含转换转出份额。

7.4.7.10 未分配利润

7.4.7.10.1 天弘量化驱动股票A

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-5,334,825.93	-884,165.15	-6,218,991.08
本期利润	1,789,815.13	-182,781.56	1,607,033.57
本期基金份额交易产生的变动数	655,998.76	-99,110.77	556,887.99
其中：基金申购款	-1,174,311.16	2,995.12	-1,171,316.04
基金赎回款	1,830,309.92	-102,105.89	1,728,204.03
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-2,889,012.04	-1,166,057.48	-4,055,069.52

7.4.7.10.2 天弘量化驱动股票C

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-4,824,971.46	-790,188.51	-5,615,159.97
本期利润	1,416,310.95	-1,225,498.34	190,812.61
本期基金份额交易产生的变动数	-4,815,299.17	-1,151,159.70	-5,966,458.87
其中：基金申购款	-8,119,433.82	-1,140,514.01	-9,259,947.83
基金赎回款	3,304,134.65	-10,645.69	3,293,488.96
本期已分配利润	-	-	-
本期末	-8,223,959.68	-3,166,846.55	-11,390,806.23

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2019年01月01日 至2019年08月11日	上年度可比期间2018年01月 18日至2018年12月31日
活期存款利息收入	17,900.72	65,438.72
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	1,171.92	4,689.28
其他	417.80	2,041.81
合计	19,490.44	72,169.81

7.4.7.12 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年 08月11日	上年度可比期间 2018年01月18日至2018年 12月31日
卖出股票成交总额	85,615,638.85	299,685,785.61
减：卖出股票成本总额	82,263,883.74	304,482,195.03
买卖股票差价收入	3,351,755.11	-4,796,409.42

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期及上年度可比期间未取得债券投资收益。

7.4.7.13.2 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间未取得资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间未取得衍生工具投资收益。

7.4.7.15 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019 年08月11日	上年度可比期间 2018年01月18日至2018 年12月31日
股票投资产生的股利收益	376,843.87	401,646.44
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	376,843.87	401,646.44

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2019年01月01日至2019年08 月11日	上年度可比期间 2018年01月18日至2018年12 月31日
1. 交易性金融资产	-1,408,279.90	-10,341,628.50
——股票投资	-1,408,279.90	-10,341,628.50
——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	-1,408,279.90	-10,341,628.50

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年	上年度可比期间 2018年01月18日至2018年
----	-------------------------	------------------------------

	08月11日	12月31日
基金赎回费收入	43,919.96	409,418.02
基金转换费收入	543.71	16,921.53
合计	44,463.67	426,339.55

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年 08月11日	上年度可比期间 2018年01月18日至2018年 12月31日
交易所市场交易费用	169,464.35	564,905.02
银行间市场交易费用	-	-
合计	169,464.35	564,905.02

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年 08月11日	上年度可比期间 2018年01月18日至2018年 12月31日
审计费用	36,656.74	57,205.54
信息披露费	57,806.78	275,342.51
证券出借违约金	-	-
指数使用费	-	886.20
合计	94,463.52	333,434.25

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 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。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

《天弘量化驱动股票型证券投资基金基金合同》自2019年8月12日失效，《天弘中证500指数增强型证券投资基金基金合同》于同日起生效，本基金于2019年8月12日转型为天弘中证500指数增强型证券投资基金。

7.4.9 关联方关系

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
招商证券股份有限公司	基金托管人、基金销售机构
浙江蚂蚁小微金融服务集团股份有限公司	基金管理人的股东
天津信托有限责任公司	基金管理人的股东
内蒙古君正能源化工集团股份有限公司	基金管理人的股东
芜湖高新投资有限公司	基金管理人的股东
新疆天瑞博丰股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
新疆天惠新盟股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
新疆天阜恒基股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
新疆天聚宸兴股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
天弘创新资产管理有限公司	基金管理人的全资子公司

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。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

7.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年01月01日至2019年08 月11日		上年度可比期间 2018年01月18日至2018年12 月31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
招商证券股份有限公司	63,452,7	34.18%	117,822,	21.22%

	88.41		232.55	
--	-------	--	--------	--

7.4.10.1.2 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。

7.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2019年01月01日至2019年08月11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
招商证券股份有限公司	14,676.03	21.78%	-	-
关联方名称	上年度可比期间 2018年01月18日至2018年12月31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
招商证券股份有限公司	27,254.06	12.62%	10,042.79	35.28%

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。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年08月11日	上年度可比期间 2018年01月18日至2018年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	244,724.99	599,110.09
其中：支付销售机构的客户维护费	51,643.72	117,488.81

注： 1. 支付基金管理人天弘基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值 1.50%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 1.50% / 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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019 年08月11日	上年度可比期间 2018年01月18日至2018 年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	40,787.46	99,851.65

注：支付基金托管人招商证券股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值0.25%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 0.25%/当年天数。

7.4.10.2.3 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 2019年01月01日至2019年08月11日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	天弘量化驱动股票A	天弘量化驱动股票C	合计
天弘基金管理 有限公司	-	19,980.08	19,980.08
招商证券股份 有限公司	-	3.12	3.12
合计	-	19,983.20	19,983.20
获得销售服务 费的各关联方 名称	上年度可比期间 2018年01月18日至2018年12月31日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	天弘量化驱动股票A	天弘量化驱动股票C	合计

天弘基金管理 有限公司	-	66,225.23	66,225.23
合计	-	66,225.23	66,225.23

注：1、支付C类基金份额销售机构的销售服务费按前一日C类基金份额的基金资产净值0.40%的年费率计提，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。销售服务费的计算公式为：日销售服务费=前一日C类基金份额基金资产净值 X 0.40% / 当年天数。

2、本基金A类份额不收取销售服务费。

7.4.10.3 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。

7.4.10.4 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

本基金本报告期内及上年度可比期间转融通证券出借业务未发生重大关联交易事项。

7.4.10.5 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.5.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

天弘量化驱动股票A

份额单位：份

项目	本期 2019年01月01日至2019年08 月11日	上年度可比期间 2018年01月18日至2018年12 月31日
基金合同生效日（2018 年01月18日）持有的基 金份额	-	5,000,000.00
报告期初持有的基金份 额	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	-	-

报告期末持有的基金份额	5,000,000.00	5,000,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	34.70%	29.03%

天弘量化驱动股票C

份额单位：份

项目	本期 2019年01月01日至2019年08 月11日	上年度可比期间 2018年01月18日至2018年12 月31日
基金合同生效日（2018年01月18日）持有的基金份额	-	5,000,000.00
报告期初持有的基金份额	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	-	-
报告期末持有的基金份额	5,000,000.00	5,000,000.00
报告期末持有的基金份额占基金总份额比例	12.77%	32.78%

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 A、C类各自级别的份额总额计算。

7.4.10.5.2 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。

7.4.10.6 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 2019年01月01日至2019年08月11日		上年度可比期间 2018年01月18日至2018年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
招商证券股份有限公司	2,215,534.33	17,900.72	1,546,218.74	65,438.72

注：本基金的银行存款由本基金托管人招商证券股份有限公司保管，存放在具有基金托管资格的交通银行股份有限公司，按银行同业利率或约定利率计息。

7.4.10.7 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。

7.4.10.8 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。

7.4.11 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。

7.4.12 期末（2019年08月11日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 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

7.4.12.1.1 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
300787	海能实业	2019-08-08	2019-08-15	新股未上市	27.33	27.33	274	7,488.42	7,488.42	-

7.4.12.2 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	股票	停牌	停牌	期末	复牌	复牌	数量（股）	期末成本总额	期末估值总额	备注
----	----	----	----	----	----	----	-------	--------	--------	----

代 码	名 称	日 期	原 因	估 值 单 价	日 期	开 盘 单 价				
000 029	深 深 房 A	201 6-0 9-1 4	重 大 资 产 重 组	10. 97	-	-	6,704	78,333.49	73,542.88	-

注：本基金截至2019年08月11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。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2019年08月11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。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2019年08月11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。

7.4.12.4 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。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金为股票型基金，属于较高风险、较高收益预期的基金品种，其风险收益预期高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金投资的金融工具主要包括权益类和固定收益类金融工具等。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在有效控制风险的前提下获取高于业绩比较基准的投资收益。

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。

7.4.13.2 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招商证券股份有限公司开立于具有基金托管人资格的交通银行股份有限公司的托管账户，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。

于2019年08月11日，本基金无债券投资(2018年12月31日：同)。

7.4.13.3 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2019年08月11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。

7.4.13.3.1 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7.4.12。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%。于2019年08月11日，本基金持有的流动性受限资产的估值占基金资产净值的比例为0.21%。

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。于2019年08月11日，本基金组合资产中7个工作日可变现资产的账面价值超过经确认的当日净赎回金额。

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。

7.4.13.4 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。

7.4.13.4.1 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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2019年08月11日资产	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

天弘中证 500 指数增强型证券投资基金（原天弘量化驱动股票型
证券投资基金转型）2019 年年度报告

银行存款	2,215,534.33	-	-	-	2,215,534.33
结算备付金	181,216.75	-	-	1,001.00	182,217.75
存出保证金	29,968.78	-	-	-	29,968.78
交易性金融资产	-	-	-	35,805,843.04	35,805,843.04
应收证券清算款	-	-	-	20,366.36	20,366.36
应收利息	-	-	-	5,704.33	5,704.33
应收申购款	-	-	-	38,048.74	38,048.74
资产总计	2,426,719.86	-	-	35,870,963.47	38,297,683.33
负债					
应付赎回款	-	-	-	55,300.20	55,300.20
应付管理人报酬	-	-	-	17,619.49	17,619.49
应付托管费	-	-	-	2,936.58	2,936.58
应付销售服务费	-	-	-	3,416.64	3,416.64
应付交易费用	-	-	-	19,016.86	19,016.86
其他负债	-	-	-	94,523.18	94,523.18
负债总计	-	-	-	192,812.95	192,812.95
利率敏感度缺口	2,426,719.86	-	-	35,678,150.52	38,104,870.38
上年度	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

天弘中证 500 指数增强型证券投资基金（原天弘量化驱动股票型
证券投资基金转型）2019 年年度报告

末2018 年12月3 1日					
资产					
银行存 款	1,546,218.74	-	-	-	1,546,218.74
结算备 付金	133,992.22	-	-	-	133,992.22
存出保 证金	72,253.39	-	-	-	72,253.39
交易性 金融资 产	-	-	-	19,257,000.69	19,257,000.69
应收利 息	-	-	-	842.01	842.01
应收申 购款	-	-	-	64,264.43	64,264.43
资产总 计	1,752,464.35	-	-	19,322,107.13	21,074,571.48
负债					
应付赎 回款	-	-	-	28,902.18	28,902.18
应付管 理人报 酬	-	-	-	26,739.89	26,739.89
应付托 管费	-	-	-	4,456.63	4,456.63
应付销 售服务 费	-	-	-	3,296.50	3,296.50
应付交 易费用	-	-	-	28,468.15	28,468.15
其他负 债	-	-	-	340,010.69	340,010.69
负债总 计	-	-	-	431,874.04	431,874.04
利率敏 感度缺	1,752,464.35	-	-	18,890,233.09	20,642,697.44

口					
---	--	--	--	--	--

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。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2019年08月11日，本基金未持有交易性债券投资（2018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（2018年12月31日：同）。

7.4.13.4.2 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。

7.4.13.4.3 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或银行间同业市场上市交易的股票和债券，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。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金股票投资占基金资产的比例不低于基金资产的80%，投资于权证的比例不超过基金资产净值的3%，现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，其中，现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。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。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2019年08月11日		上年度末 2018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	35,805,843.04	93.97	19,257,000.69	93.29
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	35,805,843.04	93.97	19,257,000.69	93.29

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注7.4.1)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 2019年08月11日	上年度末 2018年12月31日
	业绩比较基准(附注7.4.1)上升5%	2,001,147.60	1,066,028.03
	业绩比较基准(附注7.4.1)下降5%	-2,001,147.60	-1,066,028.03

7.4.14 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2019年08月11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35,724,811.74元，属于第二层次的余额为81,031.30元，无属于第三层次的余额(2018年12月31日：第一层次18,875,457.01元，第二层次381,543.68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2019年08月11日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2018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。

§ 8 投资组合报告(转型后)

8.1 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	149,549,267.62	93.37
	其中：股票	149,549,267.62	93.37
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	9,783,020.57	6.11
8	其他各项资产	828,230.85	0.52
9	合计	160,160,519.04	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 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	-	-
B	采矿业	5,440,295.00	3.45
C	制造业	69,590,352.00	44.12
D	电力、热力、燃气及水生 产和供应业	3,682,332.00	2.33
E	建筑业	1,321,868.00	0.84
F	批发和零售业	8,362,821.00	5.30
G	交通运输、仓储和邮政业	6,727,720.00	4.27
H	住宿和餐饮业	66,033.00	0.04
I	信息传输、软件和信息技 术服务业	12,040,052.00	7.63
J	金融业	3,660,319.38	2.32
K	房地产业	7,044,032.00	4.47
L	租赁和商务服务业	812,725.00	0.52
M	科学研究和技术服务业	368,277.00	0.23
N	水利、环境和公共设施管 理业	3,024,409.00	1.92
O	居民服务、修理和其他服	-	-

	务业		
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,019,665.00	0.65
R	文化、体育和娱乐业	7,105,229.00	4.50
S	综合	2,023,627.00	1.28
	合计	132,289,756.38	83.87

8.2.2 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	1,470,208.00	0.93
B	采矿业	120,280.00	0.08
C	制造业	10,872,798.82	6.89
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	32,004.16	0.02
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	717,042.00	0.45
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	932,537.00	0.59
J	金融业	2,995,980.00	1.90
K	房地产业	73,542.88	0.05
L	租赁和商务服务业	20,042.00	0.01
M	科学研究和技术服务业	18,498.34	0.01
N	水利、环境和公共设施管理业	6,578.04	0.00
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	17,259,511.24	10.94

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

8.3 期末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

8.3.1 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	600745	闻泰科技	36,400	3,367,000.00	2.13
2	002385	大北农	663,300	3,303,234.00	2.09
3	601872	招商轮船	385,500	3,184,230.00	2.02
4	002065	东华软件	273,700	2,824,584.00	1.79
5	000729	燕京啤酒	422,100	2,752,092.00	1.74
6	300251	光线传媒	226,000	2,666,800.00	1.69
7	600307	酒钢宏兴	1,284,000	2,645,040.00	1.68
8	002414	高德红外	125,150	2,628,150.00	1.67
9	300072	三聚环保	415,200	2,624,064.00	1.66
10	000807	云铝股份	507,200	2,607,008.00	1.65
11	600664	哈药股份	680,600	2,579,474.00	1.64
12	600565	迪马股份	710,300	2,542,874.00	1.61
13	601200	上海环境	226,500	2,514,150.00	1.59
14	600312	平高电气	382,600	2,471,596.00	1.57
15	002064	华峰氨纶	391,100	2,444,375.00	1.55
16	600373	中文传媒	175,300	2,385,833.00	1.51
17	600339	中油工程	651,400	2,208,246.00	1.40
18	600751	海航科技	752,700	2,205,411.00	1.40
19	603712	七一二	87,300	2,110,914.00	1.34

20	600728	佳都科技	224,400	2,104,872.00	1.33
21	002366	台海核电	290,100	2,019,096.00	1.28
22	600729	重庆百货	66,600	1,988,010.00	1.26
23	600567	山鹰纸业	520,900	1,963,793.00	1.24
24	000778	新兴铸管	464,500	1,936,965.00	1.23
25	000028	国药一致	40,900	1,855,224.00	1.18
26	300253	卫宁健康	123,400	1,848,532.00	1.17
27	600584	长电科技	83,100	1,826,538.00	1.16
28	002013	中航机电	259,400	1,800,236.00	1.14
29	600266	城建发展	219,100	1,774,710.00	1.13
30	002028	思源电气	127,300	1,752,921.00	1.11
31	002266	浙富控股	416,400	1,715,568.00	1.09
32	601958	金钼股份	202,300	1,620,423.00	1.03
33	002128	露天煤业	186,100	1,611,626.00	1.02
34	600582	天地科技	499,300	1,592,767.00	1.01
35	000543	皖能电力	340,500	1,579,920.00	1.00
36	002268	卫 士 通	60,100	1,549,979.00	0.98
37	600673	东阳光	149,200	1,527,808.00	0.97
38	002603	以岭药业	118,000	1,466,740.00	0.93
39	002701	奥瑞金	329,900	1,454,859.00	0.92
40	600125	铁龙物流	239,400	1,431,612.00	0.91
41	002709	天赐材料	68,400	1,415,880.00	0.90
42	600536	中国软件	19,200	1,376,448.00	0.87
43	601128	常熟银行	138,800	1,264,468.00	0.80
44	002583	海能达	144,300	1,213,563.00	0.77
45	002233	塔牌集团	96,000	1,209,600.00	0.77
46	000686	东北证券	127,900	1,189,470.00	0.75
47	600779	水井坊	22,600	1,169,550.00	0.74
48	603885	吉祥航空	77,800	1,167,000.00	0.74
49	300182	捷成股份	333,200	1,162,868.00	0.74
50	300296	利亚德	150,800	1,156,636.00	0.73

51	601966	玲珑轮胎	46,100	1,057,073.00	0.67
52	002191	劲嘉股份	89,300	1,018,913.00	0.65
53	000600	建投能源	204,700	1,000,983.00	0.63
54	300014	亿纬锂能	19,700	988,152.00	0.63
55	600500	中化国际	185,700	984,210.00	0.62
56	600026	中远海能	148,100	944,878.00	0.60
57	600380	健康元	90,400	935,640.00	0.59
58	600064	南京高科	93,800	914,550.00	0.58
59	600094	大名城	152,200	890,370.00	0.56
60	000690	宝新能源	155,700	879,705.00	0.56
61	600466	蓝光发展	116,600	859,342.00	0.54
62	000025	特力A	39,200	831,040.00	0.53
63	600699	均胜电子	45,100	807,290.00	0.51
64	000513	丽珠集团	22,650	763,305.00	0.48
65	300134	大富科技	48,500	747,870.00	0.47
66	002049	紫光国微	14,400	732,096.00	0.46
67	601615	明阳智能	56,600	696,180.00	0.44
68	601611	中国核建	95,600	681,628.00	0.43
69	600820	隧道股份	106,000	640,240.00	0.41
70	000878	云南铜业	46,800	639,288.00	0.41
71	600316	洪都航空	45,600	594,168.00	0.38
72	603882	金域医学	11,300	578,786.00	0.37
73	000750	国海证券	102,607	547,921.38	0.35
74	000997	新大陆	33,100	525,628.00	0.33
75	002075	沙钢股份	84,200	524,566.00	0.33
76	000967	盈峰环境	82,700	510,259.00	0.32
77	600521	华海药业	29,500	509,170.00	0.32
78	002507	涪陵榨菜	18,800	502,524.00	0.32
79	000009	中国宝安	80,100	495,819.00	0.31
80	300315	掌趣科技	78,100	481,877.00	0.31
81	603233	大参林	8,900	465,025.00	0.29

82	600763	通策医疗	4,300	440,879.00	0.28
83	600901	江苏租赁	69,200	437,344.00	0.28
84	002544	杰赛科技	30,800	419,496.00	0.27
85	601801	皖新传媒	74,500	408,260.00	0.26
86	002353	杰瑞股份	10,600	391,776.00	0.25
87	600060	海信视像	34,500	374,325.00	0.24
88	300012	华测检测	24,700	368,277.00	0.23
89	600704	物产中大	68,300	358,575.00	0.23
90	300058	蓝色光标	61,000	344,650.00	0.22
91	002368	太极股份	8,700	338,604.00	0.21
92	002439	启明星辰	9,800	331,240.00	0.21
93	300529	健帆生物	4,300	308,912.00	0.20
94	300133	华策影视	41,300	305,620.00	0.19
95	600161	天坛生物	10,500	293,370.00	0.19
96	600143	金发科技	38,100	277,368.00	0.18
97	002048	宁波华翔	17,200	265,912.00	0.17
98	002340	格林美	53,500	260,545.00	0.17
99	603883	老百姓	3,900	249,912.00	0.16
100	600058	五矿发展	30,200	242,204.00	0.15
101	603444	吉比特	800	238,792.00	0.15
102	002440	闰土股份	20,900	234,080.00	0.15
103	000066	中国长城	14,900	231,844.00	0.15
104	000883	湖北能源	50,800	211,836.00	0.13
105	601717	郑煤机	32,700	211,569.00	0.13
106	600486	扬农化工	2,800	192,164.00	0.12
107	002127	南极电商	17,400	189,834.00	0.12
108	000547	航天发展	18,500	189,070.00	0.12
109	000061	农产品	33,000	184,470.00	0.12
110	600862	中航高科	16,100	177,422.00	0.11
111	000681	视觉中国	10,200	175,848.00	0.11
112	600908	无锡银行	31,100	172,605.00	0.11

113	300207	欣旺达	8,800	171,776.00	0.11
114	300009	安科生物	10,700	161,463.00	0.10
115	600166	福田汽车	73,000	152,570.00	0.10
116	002463	沪电股份	6,700	148,807.00	0.09
117	600216	浙江医药	10,300	137,505.00	0.09
118	000970	中科三环	11,100	119,325.00	0.08
119	002273	水晶光电	5,800	93,728.00	0.06
120	600811	东方集团	25,900	87,024.00	0.06
121	601799	星宇股份	900	85,482.00	0.05
122	002640	跨境通	9,000	69,480.00	0.04
123	600754	锦江酒店	2,300	66,033.00	0.04
124	600138	中青旅	5,200	65,520.00	0.04
125	600158	中体产业	6,200	62,186.00	0.04
126	002690	美亚光电	1,500	58,650.00	0.04
127	000766	通化金马	8,600	56,244.00	0.04
128	000877	天山股份	4,200	49,770.00	0.03
129	000528	柳 工	6,900	47,886.00	0.03
130	603650	彤程新材	2,500	43,550.00	0.03
131	600388	龙净环保	4,000	39,000.00	0.02
132	600291	西水股份	4,100	36,859.00	0.02
133	600967	内蒙一机	3,100	32,953.00	0.02
134	600415	小商品城	7,300	28,251.00	0.02
135	300308	中际旭创	400	20,860.00	0.01
136	002110	三钢闽光	1,800	16,848.00	0.01
137	603858	步长制药	600	12,372.00	0.01
138	600511	国药股份	400	10,916.00	0.01
139	002948	青岛银行	1,800	10,692.00	0.01
140	000685	中山公用	1,200	9,888.00	0.01
141	600392	盛和资源	400	3,628.00	0.00
142	600557	康缘药业	100	1,474.00	0.00
143	600643	爱建集团	100	960.00	0.00

8.3.2 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	601788	光大证券	186,400	2,441,840.00	1.55
2	600063	皖维高新	493,500	1,934,520.00	1.23
3	603160	汇顶科技	6,100	1,258,430.00	0.80
4	002869	金溢科技	18,300	1,195,539.00	0.76
5	300498	温氏股份	35,300	1,186,080.00	0.75
6	600764	中国海防	38,500	1,095,710.00	0.69
7	600731	湖南海利	129,700	936,434.00	0.59
8	300552	万集科技	10,400	877,760.00	0.56
9	603501	韦尔股份	6,000	860,400.00	0.55
10	600993	马应龙	36,200	633,138.00	0.40
11	002876	三利谱	12,000	585,600.00	0.37
12	600958	东方证券	51,500	554,140.00	0.35
13	000708	中信特钢	19,000	435,670.00	0.28
14	002367	康力电梯	45,800	364,110.00	0.23
15	000895	双汇发展	11,700	339,651.00	0.22
16	002714	牧原股份	3,200	284,128.00	0.18
17	603063	禾望电气	29,100	271,794.00	0.17
18	300080	易成新能	50,800	267,208.00	0.17
19	300417	南华仪器	5,400	227,610.00	0.14
20	600346	恒力石化	13,900	223,512.00	0.14
21	688123	聚辰股份	3,330	193,539.60	0.12
22	002483	润邦股份	45,000	190,800.00	0.12
23	603660	苏州科达	13,600	149,600.00	0.09
24	300483	沃施股份	3,100	120,280.00	0.08

25	002485	希努尔	17,100	117,819.00	0.07
26	000019	深粮控股	13,800	83,904.00	0.05
27	688081	兴图新科	2,628	74,135.88	0.05
28	000029	深深房 A	6,704	73,542.88	0.05
29	600050	中国联通	9,300	54,777.00	0.03
30	603053	成都燃气	1,648	32,004.16	0.02
31	300806	斯迪克	666	26,693.28	0.02
32	300809	华辰装备	982	26,592.56	0.02
33	300787	海能实业	274	25,835.46	0.02
34	002972	科安达	1,075	21,532.25	0.01
35	000796	凯撒旅业	2,200	20,042.00	0.01
36	300564	筑博设计	497	18,498.34	0.01
37	603109	神驰机电	684	18,105.48	0.01
38	603995	甬金股份	578	15,698.48	0.01
39	300709	精研科技	100	9,765.00	0.01
40	002973	侨银环保	1,146	6,578.04	-
41	603530	神马电力	321	6,493.83	-

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例 (%)
1	600745	闻泰科技	4,139,819.94	2.62
2	002916	深南电路	3,770,811.00	2.39
3	603444	吉比特	3,664,983.00	2.32
4	002385	大北农	3,625,630.00	2.30
5	603501	韦尔股份	3,623,568.44	2.30
6	300498	温氏股份	3,598,657.00	2.28
7	000750	国海证券	3,535,600.13	2.24
8	600312	平高电气	3,430,284.00	2.17

9	000878	云南铜业	3,390,571.35	2.15
10	600141	兴发集团	3,364,026.44	2.13
11	002065	东华软件	3,314,304.00	2.10
12	601872	招商轮船	3,248,975.56	2.06
13	600582	天地科技	3,206,945.00	2.03
14	000988	华工科技	3,168,965.80	2.01
15	000543	皖能电力	3,087,275.00	1.96
16	603160	汇顶科技	3,033,565.00	1.92
17	002049	紫光国微	2,947,702.55	1.87
18	000513	丽珠集团	2,859,443.61	1.81
19	000729	燕京啤酒	2,837,179.00	1.80
20	300296	利亚德	2,817,354.00	1.79

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。

8.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	603444	吉比特	3,926,357.00	2.49
2	002916	深南电路	3,816,320.00	2.42
3	000988	华工科技	3,413,388.52	2.16
4	600141	兴发集团	3,387,979.33	2.15
5	000878	云南铜业	3,382,479.00	2.14
6	002368	太极股份	3,235,991.00	2.05
7	000750	国海证券	3,229,745.00	2.05
8	002129	中环股份	3,077,206.00	1.95
9	000401	冀东水泥	2,913,299.00	1.85
10	603501	韦尔股份	2,899,749.95	1.84
11	600486	扬农化工	2,697,064.00	1.71
12	600717	天津港	2,604,784.48	1.65

13	000513	丽珠集团	2,497,061.73	1.58
14	002463	沪电股份	2,441,836.00	1.55
15	002157	正邦科技	2,429,732.00	1.54
16	000732	泰禾集团	2,383,640.99	1.51
17	600985	淮北矿业	2,237,398.86	1.42
18	002242	九阳股份	2,228,033.88	1.41
19	600528	中铁工业	2,200,023.00	1.39
20	300296	利亚德	2,192,051.00	1.39

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。

8.4.3 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	366,991,990.76
卖出股票收入（成交）总额	266,933,560.16

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。

8.5 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。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 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。

8.11 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	99,444.82
2	应收证券清算款	236,815.57
3	应收股利	—
4	应收利息	4,894.15
5	应收申购款	487,076.31
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	828,230.85

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

8.12.5.1 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。

8.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末积极投资前五名股票不存在流通受限情况。

8.12.6 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 投资组合报告（转型前）

8.1 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	35,805,843.04	93.49
	其中：股票	35,805,843.04	93.49
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
4	贵金属投资	—	—
5	金融衍生品投资	—	—
6	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
7	银行存款和结算备付金合计	2,397,752.08	6.26
8	其他各项资产	94,088.21	0.25
9	合计	38,297,683.33	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例 (%)
A	农、林、牧、渔业	1,004,266.00	2.64
B	采矿业	1,579,888.00	4.15
C	制造业	19,572,855.41	51.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	754,296.00	1.98
E	建筑业	746,157.00	1.96

F	批发和零售业	1,428,772.15	3.75
G	交通运输、仓储和邮政业	1,428,614.00	3.75
H	住宿和餐饮业	241,116.00	0.63
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,815,038.00	7.39
J	金融业	1,617,928.00	4.25
K	房地产业	1,963,106.48	5.15
L	租赁和商务服务业	652,455.00	1.71
M	科学研究和技术服务业	117,810.00	0.31
N	水利、环境和公共设施管理业	-	-
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	708,560.00	1.86
Q	卫生和社会工作	117,676.00	0.31
R	文化、体育和娱乐业	361,083.00	0.95
S	综合	696,222.00	1.83
	合计	35,805,843.04	93.97

8.3 期末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	002195	二三四五	235,700	773,096.00	2.03
2	600699	均胜电子	53,600	752,008.00	1.97
3	002607	中公教育	52,100	708,560.00	1.86
4	600169	太原重工	288,100	677,035.00	1.78
5	601958	金钼股份	98,500	666,845.00	1.75
6	000301	东方盛虹	132,900	663,171.00	1.74
7	002051	中工国际	65,400	659,886.00	1.73
8	000031	大悦城	101,600	655,320.00	1.72

9	002414	高德红外	36,950	645,147.00	1.69
10	600312	平高电气	88,800	623,376.00	1.64
11	000401	冀东水泥	39,600	617,760.00	1.62
12	601100	恒立液压	21,400	591,068.00	1.55
13	002402	和而泰	67,152	588,923.04	1.55
14	600026	中远海能	99,500	583,070.00	1.53
15	002672	东江环保	59,500	559,895.00	1.47
16	600380	健康元	68,000	549,440.00	1.44
17	002299	圣农发展	18,900	546,021.00	1.43
18	000600	建投能源	91,200	531,696.00	1.40
19	600755	厦门国贸	70,965	518,754.15	1.36
20	600673	东阳光	66,400	499,992.00	1.31
21	002092	中泰化学	67,400	494,042.00	1.30
22	600143	金发科技	93,700	480,681.00	1.26
23	300130	新国都	32,700	478,728.00	1.26
24	601615	明阳智能	46,900	469,938.00	1.23
25	002815	崇达技术	26,300	461,828.00	1.21
26	002458	益生股份	18,500	458,245.00	1.20
27	002745	木林森	45,100	437,019.00	1.15
28	600895	张江高科	27,200	426,224.00	1.12
29	002797	第一创业	76,700	424,918.00	1.12
30	002368	太极股份	16,200	417,960.00	1.10
31	300418	昆仑万维	34,500	409,860.00	1.08
32	600879	航天电子	67,700	399,430.00	1.05
33	002129	中环股份	36,300	392,040.00	1.03
34	600325	华发股份	55,100	381,292.00	1.00
35	601231	环旭电子	31,700	367,403.00	0.96
36	002440	闰土股份	34,900	365,752.00	0.96
37	000959	首钢股份	109,700	364,204.00	0.96
38	600745	闻泰科技	9,600	364,128.00	0.96
39	601005	重庆钢铁	193,000	355,120.00	0.93

40	000630	铜陵有色	158,200	351,204.00	0.92
41	002064	华峰氨纶	64,400	343,896.00	0.90
42	002920	德赛西威	14,600	338,866.00	0.89
43	600779	水井坊	7,600	336,452.00	0.88
44	600125	铁龙物流	52,100	308,953.00	0.81
45	603816	顾家家居	10,480	299,623.20	0.79
46	000783	长江证券	42,800	294,464.00	0.77
47	600872	中炬高新	7,300	289,810.00	0.76
48	000661	长春高新	800	275,320.00	0.72
49	601808	中海油服	28,300	274,793.00	0.72
50	002489	浙江永强	88,900	272,034.00	0.71
51	002028	思源电气	27,200	268,192.00	0.70
52	002603	以岭药业	25,300	255,277.00	0.67
53	002399	海普瑞	13,300	252,035.00	0.66
54	002152	广电运通	39,100	246,721.00	0.65
55	002251	步步高	33,500	245,890.00	0.65
56	600329	中新药业	18,300	235,338.00	0.62
57	601872	招商轮船	59,500	233,835.00	0.61
58	002093	国脉科技	24,300	230,364.00	0.60
59	000932	华菱钢铁	54,160	223,680.80	0.59
60	002110	三钢闽光	27,450	220,423.50	0.58
61	600064	南京高科	24,100	212,321.00	0.56
62	300168	万达信息	22,100	210,613.00	0.55
63	002434	万里扬	34,600	201,026.00	0.53
64	603355	莱克电气	10,400	198,432.00	0.52
65	600536	中国软件	4,000	196,520.00	0.52
66	000009	中国宝安	46,500	196,230.00	0.51
67	300058	蓝色光标	39,900	190,722.00	0.50
68	000513	丽珠集团	7,550	186,485.00	0.49
69	601333	广深铁路	60,700	185,135.00	0.49
70	600079	人福医药	19,100	181,450.00	0.48

71	600373	中文传媒	15,500	181,040.00	0.48
72	002465	海格通信	20,300	175,189.00	0.46
73	600138	中青旅	15,600	174,720.00	0.46
74	603233	大参林	3,300	172,029.00	0.45
75	603309	维力医疗	10,600	164,512.00	0.43
76	600643	爱建集团	19,400	161,796.00	0.42
77	601336	新华保险	3,200	159,584.00	0.42
78	600985	淮北矿业	15,600	156,936.00	0.41
79	600809	山西汾酒	2,400	154,800.00	0.41
80	600754	锦江酒店	6,300	146,916.00	0.39
81	000061	农产品	30,300	144,531.00	0.38
82	300134	大富科技	9,800	140,238.00	0.37
83	600958	东方证券	14,100	138,603.00	0.36
84	601555	东吴证券	15,600	137,904.00	0.36
85	002221	东华能源	17,700	135,405.00	0.36
86	601699	潞安环能	16,300	133,660.00	0.35
87	000983	西山煤电	21,900	133,152.00	0.35
88	600008	首创股份	38,700	126,162.00	0.33
89	002818	富森美	11,000	124,410.00	0.33
90	300529	健帆生物	2,000	123,400.00	0.32
91	000937	冀中能源	35,900	122,060.00	0.32
92	000028	国药一致	2,900	118,610.00	0.31
93	601229	上海银行	13,100	118,424.00	0.31
94	600887	伊利股份	4,300	117,820.00	0.31
95	600645	中源协和	6,600	117,810.00	0.31
96	300244	迪安诊断	5,200	117,676.00	0.31
97	600037	歌华有线	13,000	116,480.00	0.31
98	600563	法拉电子	2,800	113,960.00	0.30
99	300182	捷成股份	32,400	110,160.00	0.29
100	002191	劲嘉股份	10,000	107,900.00	0.28
101	600316	洪都航空	7,000	101,430.00	0.27

102	300086	康芝药业	20,700	99,774.00	0.26
103	601607	上海医药	5,700	98,097.00	0.26
104	600258	首旅酒店	6,000	94,200.00	0.25
105	600298	安琪酵母	3,500	94,150.00	0.25
106	002208	合肥城建	13,420	93,000.60	0.24
107	600489	中金黄金	9,300	92,442.00	0.24
108	600522	中天科技	11,500	92,230.00	0.24
109	002491	通鼎互联	13,400	87,770.00	0.23
110	002670	国盛金控	8,700	87,261.00	0.23
111	600820	隧道股份	14,900	86,271.00	0.23
112	000732	泰禾集团	13,400	85,760.00	0.23
113	002078	太阳纸业	12,600	85,680.00	0.22
114	300383	光环新网	4,600	85,422.00	0.22
115	600062	华润双鹤	6,900	85,008.00	0.22
116	600633	浙数文化	9,300	82,119.00	0.22
117	603515	欧普照明	2,800	78,764.00	0.21
118	000623	吉林敖东	5,100	77,979.00	0.20
119	600801	华新水泥	4,160	77,084.80	0.20
120	000029	深深房 A	6,704	73,542.88	0.19
121	002189	中光学	3,700	72,557.00	0.19
122	000729	燕京啤酒	12,500	72,000.00	0.19
123	603000	人民网	4,700	70,829.00	0.19
124	002281	光迅科技	2,600	68,250.00	0.18
125	600967	内蒙一机	6,500	67,990.00	0.18
126	603444	吉比特	300	64,050.00	0.17
127	600827	百联股份	7,100	61,983.00	0.16
128	000878	云南铜业	6,200	61,256.00	0.16
129	601326	秦港股份	19,800	59,994.00	0.16
130	600163	中闽能源	16,600	59,262.00	0.16
131	603486	科沃斯	2,200	54,120.00	0.14
132	600350	山东高速	11,400	52,212.00	0.14

133	601928	凤凰传媒	6,700	51,523.00	0.14
134	300166	东方国信	4,700	50,525.00	0.13
135	300021	大禹节水	10,300	49,955.00	0.13
136	600166	福田汽车	24,900	48,804.00	0.13
137	002594	比亚迪	900	45,891.00	0.12
138	300253	卫宁健康	3,300	44,748.00	0.12
139	300295	三六五网	3,800	41,914.00	0.11
140	600864	哈投股份	6,600	41,646.00	0.11
141	601179	中国西电	11,400	38,874.00	0.10
142	000547	航天发展	4,000	37,280.00	0.10
143	300003	乐普医疗	1,500	36,030.00	0.09
144	000615	京汉股份	7,800	35,646.00	0.09
145	002916	深南电路	300	34,650.00	0.09
146	000685	中山公用	4,300	33,153.00	0.09
147	600729	重庆百货	1,200	31,740.00	0.08
147	600908	无锡银行	6,000	31,740.00	0.08
149	600418	江淮汽车	5,700	26,961.00	0.07
150	300207	欣旺达	2,200	25,366.00	0.07
151	000858	五粮液	200	23,604.00	0.06
152	002727	一心堂	1,000	23,350.00	0.06
153	002371	北方华创	400	22,836.00	0.06
154	600845	宝信软件	700	20,538.00	0.05
155	600053	九鼎投资	1,000	20,530.00	0.05
156	600648	外高桥	1,100	19,734.00	0.05
157	601865	福莱特	2,200	18,920.00	0.05
158	601019	山东出版	2,700	18,360.00	0.05
159	002707	众信旅游	3,600	18,072.00	0.05
160	603766	隆鑫通用	4,900	17,003.00	0.04
161	600580	卧龙电驱	1,800	14,238.00	0.04
162	603115	海星股份	936	13,721.76	0.04
163	603501	韦尔股份	200	13,020.00	0.03

164	300091	金通灵	3,400	12,376.00	0.03
165	002960	青鸟消防	308	7,690.76	0.02
166	300787	海能实业	274	7,488.42	0.02
167	002030	达安基因	600	5,892.00	0.02
168	600106	重庆路桥	1,900	5,415.00	0.01
169	002755	奥赛康	500	5,340.00	0.01
170	600260	凯乐科技	300	4,857.00	0.01
171	000598	兴蓉环境	900	4,023.00	0.01
172	603530	神马电力	321	4,022.13	0.01
173	002640	跨境通	500	3,180.00	0.01
174	600282	南钢股份	1,000	2,990.00	0.01
175	601311	骆驼股份	300	2,730.00	0.01
176	002302	西部建设	200	2,052.00	0.01
177	300274	阳光电源	200	2,000.00	0.01
178	002839	张家港行	200	1,058.00	0.00

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	000031	大悦城	1,084,139.00	5.25
2	000401	冀东水泥	988,201.00	4.79
3	002195	二三四五	970,642.00	4.70
4	000600	建投能源	966,073.00	4.68
5	002299	圣农发展	938,213.00	4.55
6	600312	平高电气	894,491.00	4.33
7	600699	均胜电子	863,903.00	4.19
8	002414	高德红外	822,009.00	3.98
9	002129	中环股份	798,974.00	3.87

10	600169	太原重工	757,665.00	3.67
11	002920	德赛西威	739,202.00	3.58
12	601231	环旭电子	737,005.00	3.57
13	002607	中公教育	734,331.00	3.56
14	002051	中工国际	718,951.00	3.48
15	000301	东方盛虹	713,827.00	3.46
16	002028	思源电气	708,423.00	3.43
17	002368	太极股份	689,096.00	3.34
18	002745	木林森	684,189.00	3.31
19	601100	恒立液压	674,466.00	3.27
20	600026	中远海能	673,760.00	3.26
21	002672	东江环保	668,371.00	3.24
22	601958	金钼股份	648,919.00	3.14
23	002402	和而泰	618,405.08	3.00
24	300133	华策影视	615,287.00	2.98
25	000959	首钢股份	601,420.00	2.91
26	600380	健康元	595,153.00	2.88
27	002797	第一创业	591,768.00	2.87
28	600755	厦门国贸	590,474.55	2.86
29	002458	益生股份	579,877.00	2.81
30	600655	豫园股份	571,517.00	2.77
31	600673	东阳光	567,696.00	2.75
32	002463	沪电股份	566,193.00	2.74
33	600325	华发股份	539,487.00	2.61
34	002064	华峰氨纶	531,771.00	2.58
35	600872	中炬高新	528,871.00	2.56
36	600598	北大荒	526,857.00	2.55
37	002440	闰土股份	521,441.00	2.53
38	300130	新国都	513,753.20	2.49
39	300498	温氏股份	510,810.00	2.47
40	002371	北方华创	510,477.00	2.47

41	000778	新兴铸管	504,071.00	2.44
42	601615	明阳智能	503,166.00	2.44
43	000596	古井贡酒	496,838.00	2.41
44	600879	航天电子	493,159.00	2.39
45	600895	张江高科	483,279.00	2.34
46	300058	蓝色光标	475,978.00	2.31
47	000656	金科股份	472,741.00	2.29
48	600600	青岛啤酒	469,249.00	2.27
49	600079	人福医药	463,234.00	2.24
50	600143	金发科技	462,362.00	2.24
51	300347	泰格医药	459,974.68	2.23
52	300244	迪安诊断	457,844.00	2.22
53	000783	长江证券	450,058.00	2.18
54	300418	昆仑万维	448,232.00	2.17
55	000615	京汉股份	446,663.00	2.16
56	601229	上海银行	445,961.00	2.16
57	600125	铁龙物流	444,919.00	2.16
58	002092	中泰化学	444,223.00	2.15
59	000027	深圳能源	443,715.00	2.15
60	600820	隧道股份	442,102.00	2.14
61	002280	联络互动	436,163.00	2.11
62	000630	铜陵有色	432,711.00	2.10
63	000090	天健集团	431,747.00	2.09
64	600094	大名城	427,019.93	2.07
65	000006	深振业 A	426,658.00	2.07
66	600409	三友化工	426,568.00	2.07
67	600729	重庆百货	422,073.00	2.04
68	300168	万达信息	417,405.71	2.02
69	002701	奥瑞金	415,567.00	2.01
70	600062	华润双鹤	414,269.00	2.01

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。

8.4.2 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	000596	古井贡酒	706,204.00	3.42
2	600094	大名城	667,256.33	3.23
3	300498	温氏股份	632,926.00	3.07
4	300133	华策影视	615,458.00	2.98
5	000656	金科股份	615,212.00	2.98
6	002280	联络互动	583,930.00	2.83
7	600598	北大荒	575,117.00	2.79
8	600600	青岛啤酒	561,232.00	2.72
9	000778	新兴铸管	557,537.00	2.70
10	002463	沪电股份	540,407.00	2.62
11	002129	中环股份	507,781.00	2.46
12	000988	华工科技	492,561.00	2.39
13	600655	豫园股份	492,398.88	2.39
14	002056	横店东磁	487,572.39	2.36
15	300347	泰格医药	485,038.00	2.35
16	002030	达安基因	471,109.90	2.28
17	002299	圣农发展	469,110.00	2.27
18	002028	思源电气	468,422.00	2.27
19	000060	中金岭南	458,509.00	2.22
20	600580	卧龙电驱	457,112.00	2.21
21	002371	北方华创	455,370.00	2.21
22	600729	重庆百货	451,016.40	2.18
23	600039	四川路桥	447,888.00	2.17
24	000738	航发控制	444,206.00	2.15

25	002920	德赛西威	441,248.00	2.14
26	600216	浙江医药	440,156.00	2.13
27	000027	深圳能源	436,335.00	2.11
28	603712	七一二	431,211.00	2.09
29	000970	中科三环	421,681.00	2.04
30	002444	巨星科技	418,130.64	2.03
31	601099	太平洋	415,697.00	2.01
32	600388	龙净环保	414,103.00	2.01

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。

8.4.3 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	100,221,005.99
卖出股票收入（成交）总额	85,615,638.85

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。

8.5 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。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 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。

8.11 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	29,968.78
2	应收证券清算款	20,366.36
3	应收股利	—
4	应收利息	5,704.33
5	应收申购款	38,048.74
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	94,088.21

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

8.12.6 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。

§9 基金份额持有人信息(转型后)

9.1 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5 00指 数增 强A	9,908	11,323.01	74,247,358.12	66.18 0%	37,941,005.95	33.82 0%
天弘 中证5 00指 数增 强C	9,361	8,325.01	51,110,312.75	65.58 0%	26,820,112.37	34.42 0%
合计	19,269	9,866.56	125,357,670.87	65.94 0%	64,761,118.32	34.06 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A、C类分级基金，比例的分母采用A、C类各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用A、C类分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

9.2 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500指数 增强A	863,965.00	0.77%
	天弘中证500指数 增强C	64,080.36	0.08%
	合计	928,045.36	0.49%

9.3 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500指数增强A	50~100
	天弘中证500指数增强C	0
	合计	50~100
本基金基金经理持有本开放式基金	天弘中证500指数增强A	0
	天弘中证500指数增强C	0
	合计	0

§ 9 基金份额持有人信息(转型前)

9.1 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
天弘量化驱动股票A	3,833	3,759.13	5,000,000.00	34.700%	9,408,757.35	65.300%
天弘量化驱动股票C	2,380	16,446.21	26,250,057.15	67.060%	12,891,931.63	32.940%
合计	6,213	8,619.14	31,250,057.15	58.360%	22,300,688.98	41.640%

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A、C类分级基金，比例的分母采用A、C类各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用A、C类分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

9.2 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	天弘量化驱动股票A	75,508.16	0.52%
	天弘量化驱动股票C	50,398.95	0.13%
	合计	125,907.11	0.24%

9.3 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	天弘量化驱动股票A	0
	天弘量化驱动股票C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	天弘量化驱动股票A	0
	天弘量化驱动股票C	0
	合计	0

§ 10 开放式基金份额变动(转型后)

单位：份

	天弘中证500指数增强A	天弘中证500指数增强C
基金合同生效日(2019年08月12日)基金份额总额	14,408,757.35	39,141,988.78
基金合同生效日起至报告期期末	117,589,773.75	94,209,828.32

基金总申购份额		
减：基金合同生效日起至报告期 期末基金总赎回份额	19,810,167.03	55,421,391.98
基金合同生效日起至报告期期末 基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	112,188,364.07	77,930,425.12

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

2、总申购份额含转换转入份额；总赎回份额含转换转出份额。

§ 10 开放式基金份额变动(转型前)

单位：份

	天弘量化驱动股票A	天弘量化驱动股票C
基金合同生效日(2018年01月18 日)基金份额总额	19,649,870.98	84,513,574.58
本报告期期初基金份额总额	17,221,722.02	15,255,126.47
本报告期基金总申购份额	5,013,808.56	37,978,530.98
减：本报告期基金总赎回份额	7,826,773.23	14,091,668.67
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	14,408,757.35	39,141,988.78

注：总申购份额含转换转入份额；总赎回份额含转换转出份额。

§ 11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内，基金管理人根据法律法规及《基金合同》相关规定以通讯方式召开基金份额持有人大会，会议审议通过《关于天弘量化驱动股票型证券投资基金转型有关事项的议案》。根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的有关规定，基金份额持有人决定的事项自表决通过之日起生效。本基金管理人已将表决通过的事项报中国证监会备案。自2019年8月12日起，原《天弘量化驱动股票型证券投资基金基金合同》、《天

弘量化驱动股票型证券投资基金托管协议》失效，《天弘中证500指数增强型证券投资基金基金合同》、《天弘中证500指数增强型证券投资基金托管协议》同日起生效。

11.2 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

本报告期内基金管理人于2019年10月15日披露《天弘基金管理有限公司高级管理人员变更公告》，胡晓明先生任职公司董事长，同时井贤栋先生不再担任公司董事长。

2019年4月9日，本基金托管人招商证券股份有限公司聘任易卫东担任托管部总经理，秦湘不再担任托管部总经理。

2019年7月15日，因个人离职原因，本基金托管人招商证券股份有限公司免去郭杰托管部副总经理职务。

11.3 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。

11.4 基金投资策略的改变

天弘量化驱动股票型证券投资基金转型为天弘中证500指数增强型证券投资基金，在投资目标、投资范围、投资策略、投资限制、业绩比较基准、风险收益特征等内容均有所调整。调整后的上述内容可查阅本基金管理人在指定媒介披露的《天弘中证500指数增强型证券投资基金基金合同》中的相关约定。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金应向普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）支付服务费40,000.00元。截至本报告期末，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）已为本基金提供审计服务4年7个月。

11.6 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。

转型后

报告期2019年08月12日 - 2019年12月31日

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商 名称	交 易	股票交易		应支付该券商的佣金		备 注
		成交金额	占当期股	佣金	占当期佣	

	单 元 数 量		票成交总 额的比例		金总量的 比例	
海通 证券	1	—	—	—	—	—
华泰 证券	1	—	—	—	—	—
天风 证券	1	—	—	—	—	—
兴业 证券	1	122,829,267.71	19.40%	52,978.88	27.73%	—
西藏 东方 财富 证券	2	—	—	—	—	—
光大 证券	2	100,013,218.07	15.79%	43,142.68	22.58%	—
招商 证券	5	410,372,459.25	64.81%	94,924.22	49.69%	—

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，其中包括招商证券上海交易单元1个。

4、本基金报告期内停止租用交易单元：无。

转型前

报告期2019年01月01日 - 2019年08月11日

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

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	
海通 证券	1	—	—	—	—	—
华泰 证券	1	—	—	—	—	—
天风 证券	1	—	—	—	—	—
兴业 证券	1	104,878,108.71	56.48%	45,234.76	67.13%	—
西藏 东方 财富 证券	2	—	—	—	—	—
光大 证券	2	17,345,352.17	9.34%	7,473.77	11.09%	—
招商 证券	4	63,463,908.41	34.18%	14,676.03	21.78%	—

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：2个，其中包括招商证券上海交易单元1个、招商

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。

11.8 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	天弘量化驱动股票型证券投资基金2018年第4季度报告	中国证监会指定媒介	2019-01-22
2	天弘基金管理有限公司关于增加中信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、定投及转换业务的公告	中国证监会指定媒介	2019-02-27
3	天弘基金管理有限公司关于增加中信证券（山东）有限责任公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投及转换业务的公告	中国证监会指定媒介	2019-02-27
4	天弘基金管理有限公司关于增加中信期货有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投及转换业务的公告	中国证监会指定媒介	2019-02-27
5	天弘量化驱动股票型证券投资基金招募说明书（更新）摘要	中国证监会指定媒介	2019-03-04
6	天弘量化驱动股票型证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会指定媒介	2019-03-04
7	天弘量化驱动股票型证券投资基金2018年年度报告摘要	中国证监会指定媒介	2019-03-27
8	天弘量化驱动股票型证券投资基金2018年年度报告	中国证监会指定媒介	2019-03-27
9	天弘基金管理有限公司关于变更官方APP名称的公告	中国证监会指定媒介	2019-03-28

10	天弘量化驱动股票型证券投资基金2019年第1季度报告	中国证监会指定媒介	2019-04-19
11	天弘基金管理有限公司关于增加西藏东方财富股份有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、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	2019-04-29
12	天弘基金管理有限公司关于旗下基金在浙江金观诚基金销售有限公司暂停办理相关销售业务的公告	中国证监会指定媒介	2019-05-06
13	天弘基金管理有限公司关于在网上直销交易系统开通中国银行快捷支付业务并实施申购费率优惠的公告	中国证监会指定媒介	2019-05-07
14	天弘基金管理有限公司关于增加江苏汇林保大基金销售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	2019-05-10
15	天弘基金管理有限公司关于提醒投资者及时提供或更新身份信息公告的公告	中国证监会指定媒介	2019-05-30
16	天弘基金管理有限公司关于官网交易系统维护的通知	中国证监会指定媒介	2019-06-14
17	天弘基金管理有限公司关于官网交易系统维护的通知	中国证监会指定媒介	2019-06-21
18	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金可投资于科创板股票的公告	中国证监会指定媒介	2019-06-21
19	天弘基金管理有限公司关于	中国证监会指定媒介	2019-06-24

	增加玄元保险代理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		
20	天弘基金管理有限公司关于旗下基金在网上直销交易系统的中国银行直连渠道开展申购补差费优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2019-06-25
21	天弘基金管理有限公司旗下基金2019年6月28日基金资产净值公告	中国证监会指定媒介	2019-06-28
22	天弘基金管理有限公司旗下基金2019年6月30日基金资产净值公告	中国证监会指定媒介	2019-06-30
23	天弘基金管理有限公司关于以通讯方式召开天弘量化驱动股票型证券投资基金基金份额持有人大会的公告	中国证监会指定媒介	2019-07-09
24	天弘基金管理有限公司关于以通讯方式召开天弘量化驱动股票型证券投资基金基金份额持有人大会的第一次提示性公告	中国证监会指定媒介	2019-07-10
25	天弘基金管理有限公司关于以通讯方式召开天弘量化驱动股票型证券投资基金基金份额持有人大会的第二次提示性公告	中国证监会指定媒介	2019-07-11
26	天弘量化驱动股票型证券投资基金2019年第2季度报告	中国证监会指定媒介	2019-07-16
27	天弘基金管理有限公司关于在网上直销交易系统开通中国农业银行快捷支付业务并	中国证监会指定媒介	2019-07-31

	实施相关费率优惠的公告		
28	天弘基金管理有限公司关于天弘中证500指数增强型证券投资基金开放日常申购、赎回、定期定额投资及转换业务的公告	中国证监会指定媒介	2019-08-12
29	天弘基金管理有限公司关于天弘量化驱动股票型证券投资基金基金份额持有人大会决议生效的公告	中国证监会指定媒介	2019-08-12
30	天弘中证500指数增强型证券投资基金招募说明书	中国证监会指定媒介	2019-08-12
31	天弘中证500指数增强型证券投资基金托管协议	中国证监会指定媒介	2019-08-12
32	天弘中证500指数增强型证券投资基金基金合同摘要	中国证监会指定媒介	2019-08-12
33	天弘中证500指数增强型证券投资基金基金合同	中国证监会指定媒介	2019-08-12
34	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金在海通证券股份有限公司开通定投、转换业务以及参加其申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2019-08-16
35	天弘基金管理有限公司关于在网上直销交易系统开通“汇收付”支付业务并实施相关费率优惠的公告	中国证监会指定媒介	2019-08-20
36	天弘基金管理有限公司关于调整天弘中证500指数增强型证券投资基金基金经理的公告	中国证监会指定媒介	2019-08-24
37	天弘量化驱动股票型证券投资基金 2019年半年度报告	中国证监会指定媒介	2019-08-24

38	天弘量化驱动股票型证券投资基金 2019年半年度报告摘要	中国证监会指定媒介	2019-08-24
39	天弘基金管理有限公司关于在网上直销交易系统开通中国建设银行快捷支付业务并实施相关费率优惠的公告	中国证监会指定媒介	2019-08-29
40	天弘基金管理有限公司关于增加江苏苏州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	2019-09-11
41	天弘基金管理有限公司高级管理人员变更公告	中国证监会指定媒介	2019-10-15
42	天弘基金管理有限公司关于在网上直销交易系统开通中国工商银行快捷支付业务并实施相关费率优惠的公告	中国证监会指定媒介	2019-10-15
43	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	2019-10-25
44	天弘中证500指数增强型证券投资基金2019年第3季度报告	中国证监会指定媒介	2019-10-25
45	天弘基金管理有限公司关于旗下基金在直销渠道开展基金转换申购补差费优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2019-11-22
46	天弘基金管理有限公司关于增加中国人寿保险股份有限公司为旗下部分基金销售机构并相应开通认购、申购、赎回、定投及转换业务的公告	中国证监会指定媒介	2019-11-27

47	天弘中证500指数增强型证 券投资基金 托管协议	中国证监会指定媒介	2019-12-28
48	天弘中证500指数增强型证 券投资基金 基金合同	中国证监会指定媒介	2019-12-28
49	天弘基金管理有限公司关于 在网上直销交易系统开通中 国光大银行股份有限公司快 捷支付业务并实施相关费率 优惠的公告	中国证监会指定媒介	2019-12-31
50	天弘中证500指数增强型证 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

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

12.1 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	20190101-2019071 7, 20191114-201912 31	10, 000, 000. 0 0	69, 247, 35 8. 12	-	79, 24 7, 358. 12	41. 6 8%
	2	20190517-20190911	-	13, 294, 33 6. 61	-	13, 29 4, 336. 61	6. 99%
	3	20190927-2019110 4, 20191106	-	27, 688, 86 8. 39	-	27, 68 8, 868. 39	14. 5 6%
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。

12.2 影响投资者决策的其他重要信息

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

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

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

13.2 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

13.3 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
二〇二〇年四月二十四日