



天弘中证800指数型发起式证券投资基金

2018年第四季度报告

基金管理人：天弘基金管理有限公司 基金托管人：广发证券股份有限公司 报告送出日期：2019年1月22日	
1.1 重要提示	
基金管理人的董事会及董事承诺本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。 基金托管人广发证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2019年1月18日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。 基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则履行受托职责，本报告不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏。 本基金的过往业绩并不预示其未来表现，投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。 本报告中财务资料未经审计。	
本报告自2018年10月31日起至2019年12月31日止。	
2 基金产品概况	
基金名称	天弘中证800指数型发起式证券投资基金
基金代码	001030
基金运作方式	契约型发起式、开放式
基金合同生效日期	2016年07月14日
基金管理人	天弘基金管理有限公司
基金托管人	广发证券股份有限公司
投资目标	本基金投资于证券市场中的股票资产，追求跟踪标的指数的投资收益，实现与标的指数的长期一致性的投资收益。
投资策略	本基金采用自上而下和自下而上的方法，进行股票投资决策。股票投资组合的构建主要参照标的指数的成份股以及权重进行构建，并参照标的指数的成份股及其权重的变动进行相应调整，以跟踪标的指数的变动。本基金在严格控制跟踪误差的前提下，力争获得与标的指数的相近收益。
业绩比较基准	中证800指数收益率×95%+银行活期存款利率（税后）×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金，属于较高风险/较高收益的投资品种，其预期收益及风险水平高于混合基金、债券型基金和货币市场基金。
基金管理人	天弘基金管理有限公司
基金托管人	广发证券股份有限公司
本基金的投资范围	中证800指数成份股及备选成份股
本基金的投资范围	中证800指数成份股及备选成份股

3.1 主要财务指标	
单位：人民币元	
主要财务指标	报告期末2018年10月31日
1.本期已实现收益	1,498,309.54
2.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
3.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
4.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
5.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
6.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
7.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
8.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
9.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
10.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
11.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
12.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
13.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
14.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
15.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
16.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
17.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
18.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
19.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
20.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
21.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
22.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
23.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
24.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
25.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
26.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
27.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
28.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
29.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
30.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
31.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
32.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
33.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
34.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
35.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
36.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
37.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
38.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
39.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
40.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
41.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
42.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
43.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
44.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
45.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
46.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
47.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
48.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
49.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
50.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
51.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
52.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
53.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
54.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
55.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
56.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
57.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
58.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
59.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
60.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
61.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
62.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
63.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
64.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
65.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
66.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
67.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
68.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
69.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
70.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
71.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
72.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
73.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
74.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
75.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
76.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
77.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
78.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
79.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
80.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
81.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
82.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
83.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
84.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
85.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
86.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
87.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
88.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
89.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
90.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
91.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
92.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
93.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
94.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
95.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
96.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
97.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
98.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
99.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61
100.本期公允价值变动收益	-7,472,432.61

过去三个月	-11.42%	1.54%	-11.09%	1.57%	0.05%	-0.04%
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较						
图 1 基金合同生效以来基金累计净值增长率变动图			图 2 基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较			
						

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

4.1 基金经理（或基金经理小组）简介 54 管理人报告