

# 天弘中证证券保险指数型发起式证券投资基金招募说明书(更新)摘要

3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序前十名股票投资明细

3.1 期末指数投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

金额单位：人民币元					
序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	601318	中国平安	229,700	7,306,767.00	14.19
2	600030	中信证券	297,901	5,302,637.80	10.30
3	600837	海通证券	314,500	4,494,206.00	8.73
4	601601	中国太保	119,852	3,143,717.96	6.11
5	601688	华泰证券	128,533	2,199,199.63	4.27
6	600999	招商证券	114,500	2,048,405.00	3.98
7	000776	广发证券	114,200	1,909,424.00	3.71
8	601777	兴业证券	211,620	1,860,139.80	3.61
9	601628	中国人寿	65,200	1,556,672.00	3.02
10	000166	中国人寿	173,400	1,541,526.00	2.99

3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

金额单位：人民币元					
序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	600282	赛福天	596	3,665.74	0.01

4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

6 按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有股指期货。

10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

11 投资组合报告附注

11.1 本报告期末未发现投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查,未发现在报告期内受到公开谴责、处罚。

11.2 年内买入的投资的前十名股票,均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

11.3 其他资产构成

单位：人民币元		
序号	名称	金额
1	存出保证金	18,711.54
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	-
4	应收股利	-
5	应收申购款	2,020.09
6	其他应收款	1,007,349.28
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	1,029,080.91

11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末持有处于转股期的可转换债券。

11.5 报告期末前十名股票中存存在流通受限情况的说明

11.5.1 期末指数投资前十名股票中不存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末投资前十名股票不存在受流通受限情况。

11.5.2 期末积极投资前五名股票中不存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末持有前五名股票。

11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

## 十二、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金财产,但不保证基金一定盈利,也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在做出投资决策前请仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金合同生效日为2015年6月30日,基金业绩数据截至2016年9月31日。

基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

天弘中证证券保险C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率偏差②	业绩比较基准收益③	业绩比较基准标准差④	①-③	②-④
2015/6/30-2016/12/31	-14.45%	3.25%	-10.90%	3.42%	-3.65%	-0.17%
2016/1/1-2016/3/31	-12.92%	3.07%	-13.00%	3.13%	0.08%	-0.06%
自基金合同生效日(2015/6/30)-2016/3/31	-25.70%	3.18%	-22.48%	3.32%	-3.22%	-0.14%

天弘中证证券保险C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率偏差②	业绩比较基准收益③	业绩比较基准标准差④	①-③	②-④
2015/6/30-2015/12/31	-14.61%	3.25%	-10.90%	3.42%	-3.71%	-0.17%
2016/1/1-2016/3/31	-12.99%	3.07%	-13.00%	3.13%	0.01%	-0.06%
自基金合同生效日(2015/6/30)-2016/3/31	-25.70%	3.18%	-22.48%	3.32%	-3.22%	-0.14%

天弘中证证券保险C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率偏差②	业绩比较基准收益③	业绩比较基准标准差④	①-③	②-④
2015/6/30-2015/12/31	-14.61%	3.25%	-10.90%	3.42%	-3.71%	-0.17%
2016/1/1-2016/3/31	-12.99%	3.07%	-13.00%	3.13%	0.01%	-0.06%
自基金合同生效日(2015/6/30)-2016/3/31	-25.70%	3.18%	-22.48%	3.32%	-3.22%	-0.14%

天弘中证证券保险C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率偏差②	业绩比较基准收益③	业绩比较基准标准差④	①-③	②-④
2015/6/30-2015/12/31	-14.61%	3.25%	-10.90%	3.42%	-3.71%	-0.17%
2016/1/1-2016/3/31	-12.99%	3.07%	-13.00%	3.13%	0.01%	-0.06%
自基金合同生效日(2015/6/30)-2016/3/31	-25.70%	3.18%	-22.48%	3.32%	-3.22%	-0.14%

天弘中证证券保险C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率偏差②	业绩比较基准收益③	业绩比较基准标准差④	①-③	②-④
2015/6/30-2015/12/31	-14.61%	3.25%	-10.90%	3.42%	-3.71%	-0.17%
2016/1/1-2016/3/31	-12.99%	3.07%	-13.00%	3.13%	0.01%	-0.06%
自基金合同生效日(2015/6/30)-2016/3/31	-25.70%	3.18%	-22.48%	3.32%	-3.22%	-0.14%

天弘中证证券保险C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率偏差②	业绩比较基准收益③	业绩比较基准标准差④	①-③	②-④
2015/6/30-2015/12/31	-14.61%	3.25%	-10.90%	3.42%	-3.71%	-0.17%
2016/1/1-2016/3/31	-12.99%	3.07%	-13.00%	3.13%	0.01%	-0.06%
自基金合同生效日(2015/6/30)-2016/3/31	-25.70%	3.18%	-22.48%	3.32%	-3.22%	-0.14%

天弘中证证券保险C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率偏差②	业绩比较基准收益③	业绩比较基准标准差④	①-③	②-④
2015/6/30-2015/12/31	-14.61%	3.25%	-10.90%	3.42%	-3.71%	-0.17%
2016/1/1-2016/3/31	-12.99%	3.07%	-13.00%	3.13%	0.01%	-0.06%
自基金合同生效日(2015/6/30)-2016/3/31	-25.70%	3.18%	-22.48%	3.32%	-3.22%	-0.14%

天弘中证证券保险C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率偏差②	业绩比较基准收益③	业绩比较基准标准差④	①-③	②-④
2015/6/30-2015/12/31	-14.61%	3.25%	-10.90%	3.42%	-3.71%	-0.17%
2016/1/1-2016/3/31	-12.99%	3.07%	-13.00%	3.13%	0.01%	-0.06%
自基金合同生效日(2015/6/30)-2016/3/31	-25.70%	3.18%	-22.48%	3.32%	-3.22%	-0.14%

天弘中证证券保险C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率偏差②	业绩比较基准收益③	业绩比较基准标准差④	①-③	②-④
2015/6/30-2015/12/31	-14.61%	3.25%	-10.90%	3.42%	-3.71%	-0.17%
2016/1/1-2016/3/31	-12.99%	3.07%	-13.00%	3.13%	0.01%	-0.06%
自基金合同生效日(2015/6/30)-2016/3/31	-25.70%	3.18%	-22.48%	3.32%	-3.22%	-0.14%

天弘中证证券保险C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率偏差②	业绩比较基准收益③	业绩比较基准标准差④	①-③	②-④
2015/6/30-2015/12/31	-14.61%	3.25%	-10.90%	3.42%	-3.71%	-0.17%
2016/1/1-2016/3/31	-12.99%	3.07%	-13.00%	3.13%	0.01%	-0.06%
自基金合同生效日(2015/6/30)-2016/3/31	-25.70%	3.18%	-22.48%	3.32%	-3.22%	-0.14%

天弘中证证券保险C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率偏差②	业绩比较基准收益③	业绩比较基准标准差④	①-③	②-④
2015/6/30-2015/12/31	-14.61%	3.25%	-10.90%	3.42%	-3.71%	-0.17%
2016/1/1-2016/3/31	-12.99%	3.07%	-13.00%	3.13%	0.01%	-0.06%
自基金合同生效日(2015/6/30)-2016/3/31	-25.70%	3.18%	-22.48%	3.32%	-3.22%	-0.14%

天弘中证证券保险C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率偏差②	业绩比较基准收益③	业绩比较基准标准差④	①-③	②-④
2015/6/30-2015/12/31	-14.61%	3.25%	-10.90%	3.42%	-3.71%	-0.17%
2016/1/1-2016/3/31	-12.99%	3.07%	-13.00%	3.13%	0.01%	-0.06%
自基金合同生效日(2015/6/30)-2016/3/31	-25.70%	3.18%	-22.48%	3.32%	-3.22%	-0.14%

天弘中证证券保险C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率偏差②	业绩比较基准收益③	业绩比较基准标准差④	①-③	②-④
2015/6/30-2015/12/31	-14.61%	3.25%	-10.90%	3.42%	-3.71%	-0.17%
2016/1/1-2016/3/31	-12.99%	3.07%	-13.00%	3.13%	0.01%	-0.06%
自基金合同生效日(2015/6/30)-2016/3/31	-25.70%	3.18%	-22.48%	3.32%	-3.22%	-0.14%

天弘中证证券保险C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率偏差②	业绩比较基准收益③	业绩比较基准标准差④	①-③	②-④
2015/6/30-2015/12/31	-14.61%	3.25%	-10.90%	3.42%	-3.71%	-0.17%
2016/1/1-2016/3/31	-12.99%	3.07%	-13.00%	3.13%	0.01%	-0.06%
自基金合同生效日(2015/6/30)-2016/3/31	-25.70%	3.18%	-22.48%	3.32%	-3.22%	-0.14%

天弘中证证券保险C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率偏差②	业绩比较基准收益③	业绩比较基准标准差④	①-③	②-④
2015/6/30-2015/12/31	-14.61%	3.25%	-10.90%	3.42%	-3.71%	-0.17%
2016/1/1-2016/3/31	-12.99%	3.07%	-13.00%	3.13%	0.01%	-0.06%
自基金合同生效日(2015/6/30)-2016/3/31	-25.70%	3.18%	-22.48%	3.32%	-3.22%	-0.14%

天弘中证证券保险C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率偏差②	业绩比较基准收益③	业绩比较基准标准差④	①-③	②-④
2015/6/30-2015/12/31	-14.61%	3.25%	-10.90%	3.42%	-3.71%	-0.17%
2016/1/1-2016/3/31	-12.99%	3.07%	-13.00%	3.13%	0.01%	-0.06%
自基金合同生效日(2015/6/30)-2016/3/31	-25.70%	3.18%	-22.48%	3.32%	-3.22%	-0.14%

天弘中证证券保险C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率偏差②	业绩比较基准收益③	业绩比较基准标准差④	①-③	②-④
2015/6/30-2015/12/31	-14.61%	3.25%	-10.90%	3.42%	-3.71%	-0.17%
2016/1/1-2016/3/31	-12.99%	3.07%	-13.00%	3.13%	0.01%	-0.06%
自基金合同生效日(2015/6/30)-2016/3/31	-25.70%	3.18%	-22.48%	3.32%	-3.22%	-0.14%

天弘中证证券保险C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率偏差②	业绩比较基准收益③	业绩比较基准标准差④	①-③	②-④
2015/6/30-2015/12/31	-14.61%	3.25%	-10.90%	3.42%	-3.71%	-0.17%
2016/1/1-2016/3/31	-12.99%	3.07%	-13.00%	3.13%	0.01%	-0.06%
自基金合同生效日(2015/6/30)-2016/3/31	-25.70%	3.18%	-22.48%	3.32%	-3.22%	-0.14%

天弘中证证券保险C

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率偏差②	业绩比较基准收益③	业绩比较基准标准差④	①-③	②-④
2015/6/30-2015/12/31	-14.61%	3.25%	-10.90%	3.42%	-3.71%	-0.17%
2016/1/1-2016/3/31	-12.99%	3.07%	-13.00%	3.13%	0.01%	-0.06%
自基金合同生效日(2015/6/30)-2016/3/31	-25.70%	3.18%	-22.48%	3.32%	-3.22%	-0.14%

</