天弘中证500指数型发起式证券投资基金 2016年年度报告摘要

基金管理人:天弘基金管理有限公司
基金托管人:国泰君安证券股份有限公司
送出日期:2017年3月30日

§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。

基金托管人国泰君安证券股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年3月28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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2016年1月1日起至2016年12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	天弘中证500
基金主代码	000962
基金运作方式	契约型开放式、发起式
基金合同生效日	2015年1月20日
基金管理人	天弘基金管理有限公司
基金托管人	国泰君安证券股份有限公司
报告期末基金份额总额	588,058,121.23份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	紧密跟踪标的指数,追求跟踪偏离度和跟踪误差的最小化,实现与标的指数表现相一致的长期投资收益。
投资策略	本基金采用完全复制标的指数的方法,进行被动指数化投资。股票投资组合的构建主要按照标的指数的成份股组成及其权重来拟合复制标的指数,并根据标的指数成份股及其权重的变动而进行相应调整,以复制和跟踪标的指数。本基金在严格控制基金的日均跟踪偏离度和年跟踪误差的前提下,力争获取与标的指数相似的投资收益。
业绩比较基准	本基金投资组合的业绩比较基准为:中证500指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。
风险收益特征	本基金为股票型基金,属于较高预期风险、较高预期收益的证券投资基金品种,其预期风险与预期收益高于混合型基金、债券型基金与货币市场基金。

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	国泰君安证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	童建林	王健
	联系电话	022-83310208	021-38676252
	电子邮箱	service@thfund.com.cn	wangj222@gtjas.com
客户服务电话		4007109999	95521
传真		022-83865569	021-38677819

2.4 信息披露方式

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

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2016年	2015年1月20日-2015年12月31日
本期已实现收益	-93,875,520.74	-113,636,777.48
本期利润	-78,644,272.89	-145,681,873.69
加权平均基金份额本期利润	-0.1152	-0.2864
本期基金份额净值增长率	-16.42%	21.02%
3.1.2 期末数据和指标	2016年末	2015年末
期末可供分配基金份额利润	-0.3147	-0.1866
期末基金资产净值	594,817,658.43	654,915,385.08
期末基金份额净值	1.0115	1.2102

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、本基金《基金合同》自2015年1月20日起生效。

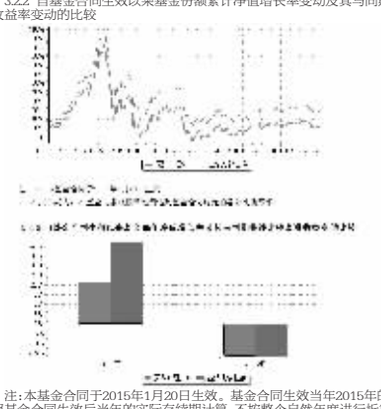
3.2 基金净值表现

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

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	-1.40%	0.77%	-0.95%	0.78%	-0.45%	-0.01%
过去六个月	1.55%	0.85%	2.21%	0.88%	-0.66%	-0.03%
过去一年	-16.42%	1.83%	-16.77%	1.81%	0.35%	0.02%
自基金合同生效日起至今(2015年01月20日-2016年12月31日)	1.15%	2.37%	18.43%	2.30%	-17.28%	0.07%

注:本基金投资组合的业绩比较基准为:中证500指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×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。本基金投资于股票的资产比例不低于基金资产的90%,投资于中证500指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的80%;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。

3.2.2 自基金合同生效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



注:本基金合同于2015年1月20日生效。基金合同生效当年2015年的净值增长率按照基金合同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

本基金自基金合同生效以来无利润分配情况,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2016年12月31日,本基金管理人共管理53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、天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金、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、天弘安康养老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)、天弘瑞利分级债券型证券投资基金、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、天弘增益宝货币市场基金、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、天弘普惠养老保本混合型证券投资基金、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、天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金、天弘中证医药100指数型发起式证券投资基金、天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金、天弘中证全指运输指数型发起式证券投资基金、天弘中证移动互联网指数型发起式证券投资基金、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、天弘创业板指数型发起式证券投资基金、天弘中证高端装备制造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100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、天弘中证环保产业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、天弘中证休闲娱乐指数型发起式证券投资基金、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、天弘沪证运宝货币市场基金、天弘鑫安宝保本混合型证券投资基金、天弘裕利灵活配置混合型证券投资基金、天弘乐享保本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、天弘安盈灵活配置混合型证券投资基金、天弘喜利灵活配置混合型证券投资基金、天弘信利债券型证券投资基金、天弘聚利灵活配置混合型证券投资基金、天弘金利灵活配置混合型证券投资基金。

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		
李蕊炜	本基金基金经理。	2015年1月	2016年2月	10年	男,理学硕士。历任亚洲证券有限责任公司股票分析师、Ophedge investment services运营分析师。2007年加盟本公司,历任本公司交易员、行业研究员、高级研究员、股票研究部副总经理、基金经理助理等。
刘冬	本基金基金经理。	2016年2月	-	10年	男,经济学硕士。2007年7月至2008年10月在长江证券股份有限公司研究部任宏观策略研究员。2008年11月加盟本公司,历任本公司投资部固定收益研究员、宏观策略研究员、基金经理助理等。

注:1、上述任职日期为基金合同生效日或本基金管理人对外披露的任职日期。

2、上述离任日期为本基金管理人对外披露的离任日期。

3、证券从业的含义遵从行业协会《证券从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

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,通过交易系统中的公平交易程序,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

本基金跟踪的标的指数为中证500指数,基金业绩比较基准为:中证500指数收益率×95%+人民币活期存款税后利率×5%。中证500指数综合反映沪深证券市场内小市值公司的整体状况,天弘中证500基金自2015年1月20日成立以来,采取了对指数的被动复制策略及适当的替代优化策略,将年化跟踪误差和日均跟踪偏离度控制在了基金合同约定的范围之内。

市场方面,2016年初受人民币短期贬值、资本流出压力加大及监管措施实施等原因,A股市场经历了一波较大幅度的调整,之后随着人民币汇率逐步企稳、央行积极投放货币、市场监管措施调整等因素影响,A股逐步企稳并保持基本平稳运行状态至年末。

本基金在运作过程中严格遵守基金合同,坚持既定的指数化投资策略,对指数基金操作采取被动复制与组合优化相结合的方式。本基金跟踪误差的主要来源是申购赎回与成分股停牌因素,当由于申赎变动、指数成分股权重调整等原因引发组合调整时,在操作过程中坚守合规第一、风控第一的前提下,结合市场趋势预判,应用指数复制和其他合理方法构建和优化基金投资组合,在遇到巨额申购资金在途不可用情形时会适当配置中证500股指期货,最大限度降低冲击成本和减少跟踪误差,使本基金与所跟踪指数的市场表现尽量一致,努力为投资者提供一个良好的指数投资工具。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2016年12月31日,本基金份额净值为1.0115元,本报告期份额净值增长率-16.42%,同期业绩比较基准增长率-16.77%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

2016年的经济基本面,在库存回补与需求温和回暖共同作用下出现平稳的态势,总体并有小幅回升;终端需求主要受地产、汽车以及基建等拉动比较明显,经济增长的结构方面仍然是传统模式为主,结构调整带来的经济回升不明显,地产、汽车的政策相对16年不那么宽松的情况下,2017年的终端需求多少会受到一些影响,且结构调整的效果也比较缓慢;因此,2017年总体的政策环境还是以偏稳为主,根据经济、通胀的强弱会辅以动态调整,经济总体情况还是比较平稳,资本市场总体上存在机会。

4.6 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估值业务的高级管理人员、督察长、研究总监及监察稽核部负责人组成。

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、风险管理人员、监察稽核人员及基金运营人员组成。

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银行和会计师事务所。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。

4.7 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。

4.8 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

本报告期内本基金管理人无应说明预警信息。

§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

本报告期内,国泰君安证券股份有限公司(以下称"本托管人")在天弘中证500指数型发起式证券投资基金(以下称"本基金")的托管过程中,严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,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应尽的义务。

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

本报告期内,本托管人根据《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本基金管理人的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真的复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。

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

本报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告(注:财务会计报告中的"金融工具风险及管理"部分未在托管人复核范围内)、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

§6 审计报告

本报告期本基金财务会计报告经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计,该所出具了"无保留意见的审计报告",且在审计报告中无强调事项。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:天弘中证500指数型发起式证券投资基金

报告截止日:2016年12月31日

单位:人民币元

资?产	附注号	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
资?产:			
银行存款		25,340,482.06	45,896,001.68
结算备付金		10,539,913.07	5,179,154.66
存出保证金		2,179,983.83	1,603,692.13
交易性金融资产		560,852,589.94	606,416,681.36
其中:股票投资		560,852,589.94	606,416,681.36
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		-	-
买入返售金融资产		-	-
应收证券清算款		-	523,134.51
应收利息		15,977.69	21,505.09
应收股利		-	-
应收申购款		2,530,831.87	1,143,431.91
递延所得税资产		-	-
其他资产		-	-
资产总计		601,459,778.46	660,783,601.34
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
负?债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		297,071.35	39,364.82
应付赎回款		5,399,277.25	5,034,272.33
应付管理人报酬		247,963.75	291,053.09
应付托管费		49,592.75	58,210.60
应付销售服务费		-	-
应付交易费用		242,577.43	83,782.44
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债		405,637.50	361,532.98
负债合计		6,642,120.03	5,868,216.26
所有者权益:			
实收基金		588,058,121.23	541,157,410.82
未分配利润		6,759,537.20	113,757,974.26
所有者权益合计		594,817,658.43	654,915,385.08
负债和所有者权益总计		601,459,778.46	660,783,601.34

注:注:1、报告截止日2016年12月31日,基金份额净值1.0115元,基金份额总额588,058,121.23份;

2、本财务报表的比较期间为2015年1月20日(基金合同生效日)至2015年12月31日。

7.2 利润表

会计主体:天弘中证500指数型发起式证券投资基金

本报告期:2016年1月1日至2016年12月31日

单位:人民币元

项?目	附注号	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月20日至2015年12月31日
一、收入		-71,209,347.02	-138,729,937.47
1.利息收入		998,792.83	1,269,363.46
其中:存款利息收入		998,792.83	786,689.49
债券利息收入		-	482,673.97
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		-87,439,387.70	-107,954,204.72
其中:股票投资收益		-90,241,689.07	-111,983,256.24
基金投资收益			
债券投资收益		-	-57,000.00
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益		-1,731,200.00	-
股利收益		4,533,501.37	4,086,051.52
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)		15,231,247.85	-32,045,096.21
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)			
5.其他收入(损失以"-"号填列)		-	-
减:二、费用		7,434,925.87	6,951,936.22
1、管理人报酬		3,417,190.50	3,076,222.09
2、托管费		683,438.10	615,244.40
3、销售服务费		-	-
4、交易费用		2,786,978.95	2,801,573.70
5、利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6、其他费用		547,318.32	458,896.03
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		-78,644,272.89	-145,681,873.69
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		-78,644,272.89	-145,681,873.69

注: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。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月20日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	3,417,190.50	3,076,222.09
其中:支付销售机构的客户维护费	424,395.21	23,394.47

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0.5%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X0.5%/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。7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月20日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	683,438.10	615,244.40

注:支付基金托管人国泰君安证券股份有限公司的托管费按前一日基金资产净值0.1%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X0.1%/当年天数。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月20日至2015年12月31日
基金合同生效日(2015年1月20日)持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
期初持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	10,000,000.00	10,000,000.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.70%	1.85%

注:期间申购/买入总份额含转换转入份额,期间赎回/卖出总份额含转换转出份额。

7.4.8.4.2 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

于本基金本报告期末及上年度末除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

7.4.8.5 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 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月20日至2015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
国泰君安证券活期存款	25,340,482.06	875,689.51	45,896,001.68	699,143.42

注:本基金的银行存款存放在具有基金托管资格的中国工商银行股份有限公司,按银行同业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.8.7 其他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无其他关联交易事项。

7.4.9 期末(2016年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期未无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.9.2 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(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额
000563	陕国投A	2016-10-14	重大资产重组	7.48	2017-01-18	6.73	298,100	1,836,411.11	2,229,788.00
002602	世纪华通	2016-12-15	重大事项	46.89	2017-01-09	50.00	44,604	1,478,455.26	2,091,481.56
601168	西部矿业	2016-12-19	重大资产重组	7.83		-	255,800	1,855,695.52	2,002,914.00
000887	中鼎股份	2016-11-18	重大资产重组	25.94	2017-02-15	23.99	76,200	1,787,790.42	1,976,628.00
000547	航天发展	2016-04-19	重大资产重组	15.36	2017-01-03	16.90	123,330	3,104,680.58	1,894,348.80
300088	长信科技	2016-09-12	重大资产重组	15.80		-	113,900	1,541,769.01	1,799,620.00
000748	长城信息	2016-11-01	重大资产重组	20.31		-	88,080	1,876,028.70	1,788,904.80
600687	刚泰控股	2016-07-25	重大资产重组	16.42	2017-01-18	16.38	106,500	1,727,236.76	1,748,730.00
600673	东阳光科	2016-11-16	重大资产重组	7.29		-	225,700	1,524,532.68	1,645,353.00
600655	豫园商城	2016-12-20	重大事项未公告	11.42		-	142,029	1,694,510.09	1,621,971.18
002400	省广股份	2016-11-28	重大事项	13.79		-	117,590	1,789,532.64	1,621,566.10
000050	深天马A	2016-09-12	重大资产重组	18.82	2017-03-23	20.70	79,300	1,499,255.20	1,492,426.00
002491	通鼎互联	2016-12-22	重大事项	15.54	2017-01-03	15.89	95,170	1,553,131.80	1,478,941.80
600151	航天机电	2016-11-11	重大资产重组	10.97		-	122,300	1,354,950.75	1,341,631.00
000697	炼石有色	2016-11-17	重大资产重组	23.51		-	56,500	1,318,007.31	1,328,315.00
600161	天坛生物	2016-12-06	重大资产重组	39.40	2017-03-24	43.34	32,368	1,220,145.53	1,275,299.20
002440	闰土股份	2016-10-21	重大资产重组	16.34	2017-01-12	15.22	77,700	1,289,507.65	1,269,618.00
600645	中源协和	2016-12-13	重大资产重组	26.80		-	43,751	1,612,856.32	1,172,526.80
000727	华东科技	2016-11-17	重大资产重组	3.37	2017-02-15	3.47	344,700	1,157,191.88	1,161,639.00
000829	天音控股	2016-09-29	重大事项	11.28		-	100,503	1,335,190.48	1,133,673.84
600171	上海贝岭	2016-12-14	重大事项未公告	14.05	2017-02-16	14.90	76,099	1,179,116.53	1,069,190.95
601005	重庆钢铁	2016-06-02	重大资产重组	2.52		-	422,600	1,385,176.12	1,064,952.00
002635	安洁科技	2016-11-08	重大资产重组	36.40	2017-02-08	33.50	26,628	838,533.17	969,259.20
002025	航天电器	2016-09-12	重大资产重组	25.20		-	36,546	851,088.74	920,959.20
002396	星网锐捷	2016-09-12	重大事项未公告	19.70	2017-02-21	18.35	45,749	927,304.52	901,255.30
600537	亿晶光电	2016-12-27	重大事项未公告	7.43	2017-01-13	8.17	116,224	898,730.13	863,544.32
002727	一心堂	2016-12-28	重大事项	21.20	2017-01-05	21.66	37,030	821,629.03	785,036.00
600859	王府井	2016-09-27	重大资产重组	16.28		-	47,830	824,651.86	778,672.40
002681	奋达科技	2016-12-19	重大资产重组	12.93		-	53,760	777,511.41	695,116.80
000693	ST华泽	2016-03-01	重大事项	12.50		-	49,788	1,135,492.48	622,350.00
603555	贵人鸟	2016-12-12	重大资产重组	30.76		-	17,464	481,414.45	537,192.64
603169	兰石重装	2016-11-24	重大资产重组	13.36	2017-03-21	14.32	39,301	519,027.18	525,061.36
002745	木林森	2016-07-18	重大资产重组	36.49		-	14,100	451,297.46	514,509.00
600551	时代出版	2016-11-28	重大资产重组	20.32		-	25,121	492,816.18	510,458.72

注:1.本基金截至2016年12月31日止持有以上因公布的重大事项或重大资产重组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。

2. 根据长城信息产业股份有限公司(以下简称"长城信息")于2016年10月25日公布的《关于中国长城计算机深圳股份有限公司换股合并公司事宜的提示性公告》和中国长城计算机深圳股份有限公司(以下简称"长城电脑")于2017年1月20日公布的《中国长城计算机深圳股份有限公司换股合并长城信息产业股份有限公司及重大资产置换和发行股份购买资产并募集配套资金暨关联交易报告书(修订稿)》,长城电脑将向长城信息全体股东发行A股股票,以换股比例1:0.5424取得长城信息股东持有的长城信息全部股票,吸收合并长城信息;长城信息自2016年11月1日起连续停牌。换股合并后新增的长城电脑股票于2017年1月18日上市流通,当日开盘单价为10.63元。长城信息人民币普通股股票自2017年1月18日起终止上市并摘牌。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2016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。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2016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。

7.4.10 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2016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518,019,655.97元,属于第二层次的余额为42,832,933.97元,无属于第三层次的余额。(2015年12月31日:第一层次538,369,843.39元,第二层次68,046,837.97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

对于证券交易所上市的股票,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的公允价