

天弘沪深300指数型发起式证券投资基金

[2017] 第一季度报告

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
报告送出日期:2017年4月22日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事及重理财经理本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其中内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。
本基金的管理人为天弘基金管理有限公司，于2017年4月10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、误导性陈述或重大遗漏，并不承担个别及连带责任。
基金管理人的董事不参与其表决权。投票有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读基金的招募说明书。
本报告期自2017年1月1日起至2017年3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 天弘沪深300
基金主代码 000991
基金运作方式 灵活的开放式,发起式
基金合同生效日 2016/01/20日
报告期末基金资产总额 984,302,400.79元

投资目标 追求长期资本增值，实现基金资产的长期稳定的回报率的最大化，实现与标的指数表现相一致的回报。

投资策略 本基金将完全复制指数的方法，通过被动地指数化投资，跟踪并复制标的指数，从而在扣除相关费用后的剩余收益上尽可能地超越标的指数的平均回报率和长期回报率的前提下，力争获取与标的指数相似的回报率。

业绩比较基准 沪深300指数收益率×90%+银行活期存款利率(税后)×10%

风险收益特征 本基金为股票型基金，属于股票型基金，较高预期收益的股票型基金品种，其预期风险和预期收益均高于货币市场基金、债券型基金与货币市场基金。

基金管理人 天弘基金管理有限公司
基金托管人 招商证券股份有限公司

§ 3 主要财务指标

单位:人民币元
主要财务指标 报告期(2017年01月01日-2017年03月31日)
1.本期已实现收益 6,540,324.32
2.本期利润 34,436,115.63
3.加权平均基金份额本期利润 0.0126
4.期末基金份额净值 907.928,662.62
5.期末基金份额 1,004,650
注:1.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，本期利润为期初至报告期末的已实现收益减去期间费用后的余额。
2.基金利润自成立以来的各期回报比例如下表所示。

3.2.1 前十名股票投资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(元) 占基金资产净值比例(%)
1 000018 中国平安 832,149 30,797,034.89 3.01
2 001616 兴业银行 1,024,000 36,006,524.00 3.56
3 000008 招商银行 104,253 15,417,630.01 1.51
4 000016 民生银行 1,016,029 15,288,229.00 1.51
5 000019 商业银行 36,531 14,486,873.16 1.44
6 001321 交通银行 2,110,430 13,140,016.28 1.43
7 000001 中国银行 369,476 11,712,389.20 1.45
8 000033 中国银行 346,562 11,607,214.00 1.42
9 000002 中国银行 630,219 10,911,807.02 1.36
10 000001 中国银行 1,191,300 10,666,560.00 1.02

3.2.2 日基金份额发生以来基金累计净值增长变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

注:1.基金成立于2016年1月20日生效。
2.报告期内，本基金的各期回报比如下表所示。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人(或基金经理小组)简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期间 证券从业年限 说明
刘冬 本基金基金经理 2016/01/20日 - 11年 刘冬先生,硕士,2009年7月至2010年10月任汇添富基金管理有限公司研究部研究员,2010年11月加入本公司,历任行业研究员、基金经理助理、基金经理,现任基金经理,基金经理助理。

2.本基金从成立之日起至今未更换过基金经理,基金经理从本公司离职后,由刘冬先生接替。

3.本基金尚未正式任命基金经理。

4.2 财务人员对本基金的尽职情况说明

4.3 公平交易制度的执行情况

4.4 信息披露制度的执行情况

4.5 基金投资组合的重大关联交易情况

4.6 投资组合的重大关联交易说明

4.7 管理人对宏观经济的分析

4.8 管理人对证券市场的总体评价

4.9 管理人对宏观经济的分析

4.10 管理人对证券市场的总体评价

4.11 管理人对宏观经济的分析

4.12 管理人对证券市场的总体评价

4.13 公平交易制度的执行情况

4.14 信息披露制度的执行情况

4.15 基金投资组合的重大关联交易情况

4.16 投资组合的重大关联交易说明

4.17 管理人对宏观经济的分析

4.18 管理人对证券市场的总体评价

4.19 管理人对宏观经济的分析

4.20 管理人对证券市场的总体评价

4.21 管理人对宏观经济的分析

4.22 管理人对证券市场的总体评价

4.23 公平交易制度的执行情况

4.24 信息披露制度的执行情况

4.25 基金投资组合的重大关联交易情况

4.26 投资组合的重大关联交易说明

4.27 管理人对宏观经济的分析

4.28 管理人对证券市场的总体评价

4.29 管理人对宏观经济的分析

4.30 投资组合的重大关联交易说明

4.31 管理人对宏观经济的分析

4.32 管理人对证券市场的总体评价

4.33 公平交易制度的执行情况

4.34 信息披露制度的执行情况

4.35 基金投资组合的重大关联交易情况

4.36 投资组合的重大关联交易说明

4.37 管理人对宏观经济的分析

4.38 管理人对证券市场的总体评价

4.39 管理人对宏观经济的分析

4.40 投资组合的重大关联交易说明

4.41 管理人对宏观经济的分析

4.42 管理人对证券市场的总体评价

4.43 公平交易制度的执行情况

4.44 信息披露制度的执行情况

4.45 基金投资组合的重大关联交易情况

4.46 投资组合的重大关联交易说明

4.47 管理人对宏观经济的分析

4.48 管理人对证券市场的总体评价

4.49 管理人对宏观经济的分析

4.50 投资组合的重大关联交易说明

4.51 管理人对宏观经济的分析

4.52 管理人对证券市场的总体评价

4.53 公平交易制度的执行情况

4.54 信息披露制度的执行情况

4.55 基金投资组合的重大关联交易情况

4.56 投资组合的重大关联交易说明

4.57 管理人对宏观经济的分析

4.58 管理人对证券市场的总体评价

4.59 管理人对宏观经济的分析

4.60 投资组合的重大关联交易说明

4.61 管理人对宏观经济的分析

4.62 管理人对证券市场的总体评价

4.63 公平交易制度的执行情况

4.64 信息披露制度的执行情况

4.65 基金投资组合的重大关联交易情况

4.66 投资组合的重大关联交易说明

4.67 管理人对宏观经济的分析

4.68 管理人对证券市场的总体评价

4.69 管理人对宏观经济的分析

4.70 投资组合的重大关联交易说明

4.71 管理人对宏观经济的分析

4.72 管理人对证券市场的总体评价

4.73 公平交易制度的执行情况

4.74 信息披露制度的执行情况

4.75 基金投资组合的重大关联交易情况

4.76 投资组合的重大关联交易说明

4.77 管理人对宏观经济的分析

4.78 管理人对证券市场的总体评价

4.79 管理人对宏观经济的分析

4.80 投资组合的重大关联交易说明

4.81 管理人对宏观经济的分析

4.82 管理人对证券市场的总体评价

4.83 公平交易制度的执行情况

4.84 信息披露制度的执行情况

4.85 基金投资组合的重大关联交易情况

4.86 投资组合的重大关联交易说明

4.87 管理人对宏观经济的分析

4.88 管理人对证券市场的总体评价

4.89 管理人对宏观经济的分析

4.90 投资组合的重大关联交易说明

4.91 管理人对宏观经济的分析

4.92 管理人对证券市场的总体评价

4.93 公平交易制度的执行情况

4.94 信息披露制度的执行情况

4.95 基金投资组合的重大关联交易情况

4.96 投资组合的重大关联交易说明

4.97 管理人对宏观经济的分析

4.98 管理人对证券市场的总体评价

4.99 管理人对宏观经济的分析

4.10 投资组合的重大关联交易说明

4.11 管理人对宏观经济的分析

4.12 管理人对证券市场的总体评价

4.13 公平交易制度的执行情况

4.14 信息披露制度的执行情况

4.15 基金投资组合的重大关联交易情况

4.16 投资组合的重大关联交易说明

4.17 管理人对宏观经济的分析

4.18 管理人对证券市场的总体评价

4.19 管理人对宏观经济的分析

4.20 投资组合的重大关联交易说明

4.21 管理人对宏观经济的分析

4.22 管理人对证券市场的总体评价

4.23 公平交易制度的执行情况

4.24 信息披露制度的执行情况

4.25 基金投资组合的重大关联交易情况

4.26 投资组合的重大关联交易说明

4.27 管理人对宏观经济的分析

4.28 管理人对证券市场的总体评价

4.29 管理人对宏观经济的分析