天弘丰利债券型证券投资基金(LOF)

2017年第三季度报告

2017年9月30日

基金管理人:天弘基金管理有限公司
基金托管人:中国邮政储蓄银行股份有限公司
报告送出日期:2017年10月26日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年10月25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。

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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自2017年7月1日起至2017年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	天弘丰利债券(LOF)
场内简称	天弘丰利
基金主代码	164208
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年11月23日
报告期末基金份额总额	373,569,191.59份
投资目标	本基金在追求基金资产稳定增值的基础上,力求获得高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金通过对宏观经济、利率走势、资金供求、信用风险状况、证券市场走势等方面的分析和预测,采取自上而下和自下而上相结合的投资策略,构建和调整固定收益证券投资组合并适度参与新股投资,力求实现风险与收益的优化平衡。
业绩比较基准	中债综合指数
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中较低风险的基金品种,其风险收益预期高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。
基金管理人	天弘基金管理有限公司
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2017年7月1日-2017年9月30日)
1.本期已实现收益	3,848,279.14
2.本期利润	4,065,084.25
3.加权平均基金份额本期利润	0.0106
4.期末基金资产净值	426,789,347.95
5.期末基金份额净值	1.1425

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,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、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。

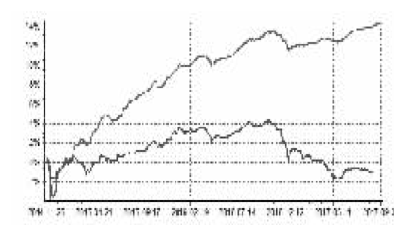
3、本基金合同自2011年11月23日起生效。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	0.95%	0.02%	-0.15%	0.03%	1.10%	-0.01%

3.2.2 自基金转型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2011年11月23日生效,2014年11月24日本基金自动转换为上市开放式基金(LOF),基金名称变更为"天弘丰利债券型证券投资基金(LOF)"。

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。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈钢	本基金基金经理;本公司副总经理、固定收益总监。	2011年11月	—	15年	男,工商管理硕士。历任华龙证券公司固定收益部高级经理;北京宸星投资管理公司投资经理;兴业证券公司债券总部研究部经理;银华基金管理有限公司机构理财部高级经理;中国人寿资产管理有限公司固定收益部高级投资经理等。
柴文婷	本基金基金经理。	2017年4月	—	6年	女,金融学硕士。历任嘉实基金管理有限公司行业研究员,2012年10月加盟本公司,历任研究员、交易员。

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、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。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 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。

4.3.2 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2017年3季度,经济增长略有放缓,但市场对经济增长的预期分歧较大;通胀方面,PPI由于基数相对平缓、工业品价格反弹导致同比增速出现反弹,阶段性对通胀预期形成扰动,但CPI整体仍维持低位。政策面方面,第五次金融工作会议召开,重点提出了做好新时期金融工作的四项原则:回归本源、优化结构、强化监管和市场导向,以及对今后一个时期金融改革发展提出三大任务:服务实体经济、防控金融风险和深化金融改革,会议奠定了未来金融工作的基本方针。资金面方面,整体呈现紧平衡态势。债市方面,7月份走出震荡行情,8月份有所下跌,9月份再现季末行情。

本基金在报告期内,积极根据市场情况变化调整组合配置情况,整体维持稳健的操作风格,为客户创造了较高的稳健收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2017年9月30日,本基金份额净值为1.1425元,本报告期份额净值增长率0.95%,同期业绩比较基准增长率-0.15%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内本基金管理人无应说明预警信息。

4.7 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2017年4季度,我们认为经济增长将在地产和基建下滑的压力出现一定程度的放缓,但年内仍将维持不差的水平,可能仍不足以触发政策立场的迅速转向。资金面方面,脉冲式收紧仍将出现,资金利率中枢尚不会出现大幅下行,紧平衡态势仍将持续。政策面方面,货币政策中性稳健立场未变,加强监管、维护国家金融安全的立场也不会改变。对应到债市来看,由于基本面后续将有一定下行压力,未来收益率也有一定的下行空间,但是暂难以形成趋势性机会。

投资策略上,本基金将密切跟踪宏观经济形势,及时调整组合策略,同时信用风险暴露阶段,细心甄别个券,降低组合信用风险,继续为投资者赚取稳健收益。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	—	—
	其中:股票	—	—
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	444,019,116.20	97.35
	其中:债券	444,019,116.20	97.35
	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	2,448,122.51	0.54
8	其他资产	9,628,279.05	2.11
9	合计	456,095,517.76	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.3 报告期末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

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	29,957,000.00	7.02
	其中:政策性金融债	29,957,000.00	7.02
4	企业债券	234,306,116.20	54.90
5	企业短期融资券	110,237,000.00	25.83
6	中期票据	20,064,000.00	4.70
7	可转债(含可交换债)	—	—
8	同业存单	49,455,000.00	11.59
9	其他	—	—
10	合计	444,019,116.20	104.04

5.5 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

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111709361	17浦发银行CD361	500,000	49,455,000.00	11.59
2	011752038	17川交投SCP003	300,000	30,075,000.00	7.05
3	122752	PR大丰港	600,000	30,066,000.00	7.04
4	011751090	17苏国信SCP014	300,000	30,039,000.00	7.04
5	011762058	17大北农SCP003	300,000	30,033,000.00	7.04

5.6 报告期末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。

5.7 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。

5.8 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。

5.9 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。

5.10 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 本基金本报告期末未持有股票,故不存在所投资的前十名股票中超出基金合同规定之备选股票库的情况。

5.11.3 其他资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	27,522.41
2	应收证券清算款	200,000.00
3	应收股利	—
4	应收利息	9,334,431.93
5	应收申购款	66,324.71
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	9,628,279.05

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	375,475,304.48
报告期期间基金总申购份额	107,345,579.78
减:报告期期间基金总赎回份额	109,251,692.67
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	—
报告期期末基金份额总额	373,569,191.59

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。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	71,003,730.00
报告期期间买入/申购总份额	—
报告期期间卖出/赎回总份额	—
报告期期末管理人持有的本基金份额	71,003,730.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	19.01

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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	2017/07/01-2017/09/30	98,361,306.89	—	—	98,361,306.89	26.33%
机构	2	2017/07/01-2017/09/30	88,230,104.11	—	—	88,230,104.11	23.62%
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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本季度报告截止日至报告批准送出日之间,本基金基金经理柴文婷女士于2017年10月9日起休产假,由刘洋女士代为履行基金经理职责,共同管理本基金的其他基金经理正常履职。具体信息请参见基金管理人于2017年9月29日在指定媒介披露的《关于代为履行基金经理职责的公告》。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准天弘丰利分级债券型证券投资基金募集的文件

2、天弘丰利分级债券型证券投资基金基金合同

3、天弘丰利分级债券型证券投资基金托管协议

4、天弘丰利债券型证券投资基金(LOF)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

9.2 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

9.3 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
二〇一七年十月二十六日

天弘乐享保本混合型证券投资基金

2017年第三季度报告

2017年9月30日

基金管理人:天弘基金管理有限公司
基金托管人:中信银行股份有限公司
报告送出日期:2017年10月26日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年10月25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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2017年7月1日起至2017年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	天弘乐享保本混合
基金主代码	002432
基金运作方式	契约型开放式,以定期开放的方式运作
基金合同生效日	2016年3月9日
报告期末基金份额总额	963,029,109.41份
投资目标	在严格控制风险的前提下,本基金通过股票与债券等资产的合理配置,综合运用投资组合保险策略,力求为基金份额持有人获取超过业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金将采用恒定比例组合保本策略(CPPI,Constant Proportion Portfolio Insurance),对资产配置建立和运用数量化的分析模型,动态地监控和调整本基金在稳健资产与风险资产上的投资比例,确保投资者的投资本金的安全性。同时,本基金通过积极稳健的选择当时机和精选个股进行投资,争取为基金资产获取更高的投资回报。具体而言,本基金的投资策略包括大类资产配置策略、稳健资产投资策略和风险资产投资策略。
业绩比较基准	三年期银行定期存款利率(税后)+2.00%
风险收益特征	本基金为保本混合型基金,属于证券投资基金中的中低风险品种,其预期风险和预期收益低于股票型基金和非保本的混合型基金,高于货币市场基金和债券型基金。
基金管理人	天弘基金管理有限公司
基金托管人	中信银行股份有限公司
基金保证人	重庆三峡担保集团股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2017年7月1日-2017年9月30日)
1.本期已实现收益	8,863,659.79
2.本期利润	6,155,165.07
3.加权平均基金份额本期利润	0.0064
4.期末基金资产净值	995,354,935.27
5.期末基金份额净值	1.0336

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,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、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。

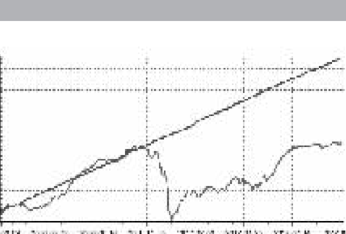
3、本基金合同于2016年3月9日生效。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	0.62%	0.03%	1.14%	0.01%	-0.52%	0.02%

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



注:1、本基金合同于2016年3月9日生效。

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。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈钢	本基金基金经理;本公司副总经理、固定收益总监。	2016年3月	—	15年	男,工商管理硕士。历任华龙证券公司固定收益部高级经理;北京宸星投资管理公司投资经理;兴业证券公司债券总部研究部经理;银华基金管理有限公司机构理财部高级经理;中国人寿资产管理有限公司固定收益部高级投资经理等。
钱文成	本基金基金经理。	2016年3月	—	11年	男,理学硕士。2007年5月加盟本公司,历任本公司行业研究员、高级研究员、策略研究员、研究主管助理、研究部副主管、研究副总监、研究总监、股票投资部副总经理、基金经理助理等。

注:1、上述任职日期为基金合同生效日。

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。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 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。

4.3.2 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2017年3季度,经济增长略有放缓,但市场对经济增长的预期分歧较大;通胀方面,PPI由于基数相对平缓、工业品价格反弹导致同比增速出现反弹,阶段性对通胀预期形成扰动,但CPI整体仍维持低位。政策面方面,第五次金融工作会议召开,重点提出了做好新时期金融工作的四项原则:回归本源、优化结构、强化监管和市场导向,以及对今后一个时期金融改革发展提出三大任务:服务实体经济、防控金融风险和深化金融改革,会议奠定了未来金融工作的基本方针。资金面方面,整体呈现紧平衡态势。债市方面,7月份走出震荡行情,8月份有所下跌,9月份再现季末行情。

本基金在报告期内,总体以债券仓位为主,以稳健风格进行投资,同时根据对股市判断严格控制权益仓位进行投资,充分把握和参与权益市场的机会,为客户创造了较高的稳健收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2017年9月30日,本基金份额净值为1.0336元,本报告期份额净值增长率0.62%,同期业绩比较基准增长率1.14%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内本基金管理人无应说明预警信息。

4.7 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2017年4季度,我们认为经济增长将在地产和基建下滑的压力出现一定程度的放缓,但年内仍将维持不差的水平,可能仍不足以触发政策立场的迅速转向。资金面方面,脉冲式收紧仍将出现,资金利率中枢尚不会出现大幅下行,紧平衡态势仍将持续。政策面方面,货币政策中性稳健立场未变,加强监管、维护国家金融安全的立场也不会改变。对应到债市来看,由于基本面后续将有一定下行压力,未来收益率也有一定的下行空间,但是暂难以形成趋势性机会。

投资策略上,本基金将继续以债券仓位为主,采取短久期和中低杠杆水平运作,同时适当精选个股参与二级市场的机会,继续为客户贡献稳健正收益。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	—	—
	其中:股票	—	—
2	基金投资	—	—
3	固定收益投资	1,559,087,171.00	97.85
	其中:债券	1,559,087,171.00	97.85
	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	22,140,399.74	1.39
8	其他资产	12,141,585.24	0.76
9	合计	1,593,369,155.98	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.3 报告期末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

本基金本报告期末未持有股票。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	19,856,171.00	1.99
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中:政策性金融债	—	—
4	企业债券	435,703,000.00	43.77
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	227,447,000.00	22.85
7	可转债	—	—
8	同业存单	876,081,000.00	88.02
9	其他	—	—
10	合计	1,559,087,171.00	156.64

5.5 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

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	111716199	17上海银行CD199	1,900,000	187,929,000.00	18.88
2	111711402	17平安银行CD402	1,900,000	185,820,000.00	18.67
3	111717219	17光大银行CD219	1,900,000	185,820,000.00	18.67
4	111710493	17兴业银行CD493	1,600,000	158,256,000.00	15.90
5	111715342	17民生银行CD342	1,600,000	158,256,000.00	15.90

5.6 报告期末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。

5.7 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。

5.8 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。

5.9 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。

5.10 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 本基金本报告期末未持有股票,故不存在所投资的前十名股票中超出基金合同规定之备选股票库的情况。

5.11.3 其他资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	29,480.05
2	应收证券清算款	177,310.01
3	应收股利	—
4	应收利息	11,934,795.18
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	12,141,585.24

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	963,029,109.41
报告期期间基金总申购份额	—
减:报告期期间基金总赎回份额	—
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	—
报告期期末基金份额总额	963,029,109.41

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期末有基金管理人运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 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	2017/07/01-2017/09/30	290,069,600.24	-	-	290,069,600.24	30.12%
机构	2	2017/07/01-2017/09/30	200,004,000.02	-	-	200,004,000.02	20.77%
机构	3	2017/07/01-2017/09/30	300,006,000.02	-	-	300,006,000.02	31.15%
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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内,本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录

1、中国证监会批准天弘乐享保本混合型证券投资基金募集的文件

2、天弘乐享保本混合型证券投资基金基金合同

3、天弘乐享保本混合型证券投资基金托管协议

4、天弘乐享保本混合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

9.2 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

9.3 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
二〇一七年十月二十六日

天弘中证500指数型发起式证券投资基金

2017年第三季度报告

2017年09月30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
报告送出日期:2017年10月26日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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10月25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。

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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自2017年7月1日起至2017年9月30日止。

§2 基金产品概况

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01月20日
报告期末基金份额总额	605,232,963.39份
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	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。
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

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

金额单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2017年07月01日-2017年09月30日)
1.本期已实现收益	3,698,404.25
2.本期利润	44,591,350.09
3.加权平均基金份额本期利润	0.0738
4.期末基金资产净值	650,059,990.99
5.期末基金份额净值	1.0741

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,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2、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。

3、本基金合同自2015年1月20日起生效。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	7.50%	0.89%	7.20%	0.89%	0.30%	0.00%

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

注:1、本基金合同于2015年1月20日生效。

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。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
张子法	本基金基金经理。	2017年04月	—	15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。

注:1、上述任职日期为本基金管理人对外披露的任职日期。

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。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 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。

4.3.2 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 报告期内基金的投资策略和运作分析

报告期内,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。

2017年3季度,国内证券市场平稳运行,波动率仍维持较低水平,基于对国内经济及证券市场的乐观预期,本基金仓位维持在业绩比较基准的水平。报告期内本基金跟踪误差的来源主要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,结合市场趋势预判与量化分析,应用指数复制和其他合理方法优化组合结构。在遇到巨额资金在途不可用等特殊情形时会适当配置中证500股指期货加以套保,最大限度降低冲击成本和减少跟踪误差,力争投资回报与所跟踪指数保持一致,努力为投资者提供一个良好的指数投资工具。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2017年9月30日,本基金份额净值为1.0741元,本报告期份额净值增长率7.50%,同期业绩比较基准增长率为7.20%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期内本基金管理人无应说明预警信息。

4.7 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

4季度,在非金融企业特别是国有企业资产负债率仍未明显改善的情况下,经济去杠杆尤其是国有企业去杠杆将继续推进,货币政策预计仍保持稳健,短期内难见明显的宽松。投资方面,环保限产政策对制造业有一定的负面影响,预计制造业投资增速仍将保持较低水平;近期加码的限售限购政策也对房地产行业不利,房地产投资较高增长难以维持;财政支出及信贷资金增速受限,基建投资预计将有所回落。消费方面,社会消费品零售增速较为平稳,若无新的政策支持,预计难以大幅回升。整体来看,各项改革和调控措施是有利于国内经济长期健康发展的,但短期来看市场出现全局性机会的要素尚显不充分,同时市场也有不少积极因素,全球主要经济体的持续复苏将使出口保持向好趋势,持续推进的简政放权和减税降费将降低企业成本和税负,即将召开的十九大将为中国经济进一步改革开放注入新的活力,市场上仍有不少结构性机会。

§5 投资组合报告

5.1 报告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	609,524,395.06	91.52
	其中:股票	609,524,395.06	91.52
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	51,202,876.56	7.69
8	其他资产	5,260,350.00	0.79
9	合计	665,987,621.62	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末(指数投资)按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

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	7,619,101.53	1.17
B	采矿业	19,742,375.28	3.04
C	制造业	383,171,069.54	58.94
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	19,161,163.94	2.95
E	建筑业	14,144,375.11	2.18
F	批发和零售业	32,416,944.72	4.99
G	交通运输、仓储和邮政业	16,135,547.81	2.48
H	住宿和餐饮业	709,640.00	0.11
I	信息传输、软件和信息技术服务业	40,717,482.00	6.26
J	金融业	9,332,875.92	1.44
K	房地产业	34,818,118.24	5.36
L	租赁和商务服务业	9,974,228.86	1.53
M	科学研究和技术服务业	1,660,221.78	0.26
N	水利、环境和公共设施管理业	5,173,019.95	0.80
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	559,945.89	0.09
Q	卫生和社会工作	1,183,793.40	0.18
R	文化、体育和娱乐业	6,444,469.31	0.99
S	综合	2,791,238.54	0.43
	合计	605,755,611.82	93.18

5.2.2 报告期末(积极投资)按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

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	622,350.00	0.10
C	制造业	2,917,707.36	0.45
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	26,385.45	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	25,571.91	0.00
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	17,468.03	0.00
J	金融业	—	—
K	房地产业	—	—
L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	—	—
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	—	—
Q	卫生和社会工作	115,299.99	0.02
R	文化、体育和娱乐业	44,000.50	0.01
S	综合	—	—
	合计	3,768,783.24	0.58

注:由于指数成份股调整,上表所列示股票中,百利电气(证券代码:600468)、*ST华泽(证券代码:000693)、深圳惠程(证券代码:002168)被调出成份股后停牌,故以积极投资股票列示(下同)。

5.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的股票投资明细

5.3.1 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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002460	赣锋锂业	74,300	6,486,390.00	1.00
2	601012	隆基股份	169,094	4,983,200.18	0.77
3	300136	信维通信	110,930	4,659,060.00	0.72
4	600487	亨通光电	134,448	4,625,011.20	0.71
5	600516	方大炭素	145,400	4,441,970.00	0.68
6	603799	华友钴业	41,700	3,814,299.00	0.59
7	600525	长园集团	185,797	3,697,360.30	0.57
8	002340	格林美	376,944	3,264,335.04	0.50
9	002405	四维图新	126,688	3,245,746.56	0.50
10	600219	南山铝业	783,400	3,125,766.00	0.48

5.3.2 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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002168	深圳惠程	117,700	1,999,723.00	0.31
2	000693	*ST华泽	49,788	622,350.00	0.10
3	600468	百利电气	52,620	342,030.00	0.05
4	603882	金域医学	2,763	115,299.99	0.02
5	603106	恒银金融	2,786	84,025.76	0.01

5.4 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。

5.5 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。

5.6 报告期末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。

5.7 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。

5.8 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。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

金额单位:人民币元

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IC1710	IC1710	6	7,892,640.00	-77,456.00	本基金组合中持有少量的基准指数的股指期货多头合约,主要原因是基金流动性新规在2017年10月1日起执行,期货保证金将不再属于现金部分,而本基金经常遇到来自代销渠道大额资金的申购,而这个申购资金在次交易日是不可用的,为了降低跟踪风险,需要进行股指期货交易,即在次交易日用部分可用资金买入基准指数的股指期货多头合约进行部分仓位套保。本基金进行股指期货交易的目的不是投机或收益增强,完全是为了降低跟踪偏离而进行的部分仓位的套保功能,并且股票仓位+期货仓位严格遵守基金合同要求和公司风控规定,不会对基金产生额外风险。
公允价值变动总额合计(元)					-77,456.00
股指期货投资本期收益(元)					1,283,136.00
股指期货投资本期公允价值变动(元)					-290,336.00

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本指数基金的股指期货买入套保主要为应对基金组合申购的资金未到位造成基金组合的股票仓位过低的风险,股指期货在买入时总持仓量采用双限制策略,一是限制基金组合中总的股指期货持仓量不能超过向中金所申请并获批的套保总量;二是限制基金组合持有的股指期货合约价值占基金净资产的比例不能超过95%减去基金组合中股票仓位。并在股指期货的交易过程中严格遵守基金合同的约束和中金所的规定。

根据本基金的基金合同、投资范围、投资目标、投资策略以及对市场走势研判的基础上,结合基金日常的申购赎回情况,制定套期保值交易的合理期限。套期保值的期限一般不超过股指期货当前的最近到期日合约,即次季合约。按照交易月份相近的原则,综合考虑并动态跟踪不同到期日的期货合约的流动性、价差状况和展期风险等因素,选择合适月份的期货合约进行开仓和展期交易来实现远期套保的目的。另外对于交割月的股指期货,通常情况下,最晚在合约交割日进行平仓,尽量避免进行交割。

在未来的股指期货交易过程中,本基金将严格遵守《证券投资基金参与股指期货交易指引》,以及中国金融期货交易所颁布的《中国金融期货交易所交易规则》、《中国金融期货交易所套期保值与套利交易管理办法》等相关规定,以套期保值为主要目的参与股指期货,严格控制交易中的各种风险。

5.10 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 本报告编制日前一年内,在本基金投资的前十名证券发行主体中,江西赣锋锂业股份有限公司于2017年7月3日、2017年7月6日收到深圳证券交易所下发的监管函。具体内容,敬请投资者参见上述公司的相关公告。

对该股票的投资决策程序说明:本基金为被动跟踪指数基金。根据本基金《基金合同》等相关规定,为更好地跟踪标的指数和控制跟踪误差,故按照成份股权重配置该证券,符合法律法规、基金合同和公司内部投资决策程序的相关规定。

5.11.2 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。

5.11.3 其他资产构成

金额单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	2,264,951.35
2	应收证券清算款	246,591.60
3	应收股利	—
4	应收利息	19,648.56
5	应收申购款	2,729,158.49
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	5,260,350.00

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

5.11.5.1 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。

5.11.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002168	深圳惠程	1,999,723.00	0.31	重大资产重组
2	000693	*ST华泽	622,350.00	0.10	重大事项
3	600468	百利电气	342,030.00	0.05	重大资产重组

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

报告期期初基金份额总额	686,989,277.98
报告期期间基金总申购份额	509,810,584.63
减:报告期期间基金总赎回份额	591,566,899.22
报告期期间基金拆分变动份额(份额减少以"-"填列)	—
报告期期末基金份额总额	605,232,963.39

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。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	10,000,000.00
报告期期间买入/申购总份额	—
报告期期间卖出/赎回总份额	—
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,000,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	1.65

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

单位:份

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	1.65%	10,000,000.00	1.65%	三年
基金管理人高级管理人员	—	—	—	—	—
基金经理等人员	—	—	—	—	—
基金管理人股东	—	—	—	—	—
其他	—	—	—	—	—
合计	10,000,000.00	1.65%	10,000,000.00	1.65%	

§9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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

本报告期内,本基金未出现单一投资者持有基金份额比例达到或超过本基金总份额20%的情况。

9.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内,本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

§10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

1、中国证监会批准天弘中证500指数型发起式证券投资基金募集的文件

2、天弘中证500指数型发起式证券投资基金基金合同

3、天弘中证500指数型发起式证券投资基金托管协议

4、天弘中证500指数型发起式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

10.2 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

10.3 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
二〇一七年十月二十六日