

# 天弘创业板指数型发起式证券投资基金

## 2017年第三季度报告

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:2017年10月26日

**1.1 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。

基金管理人天弘基金管理有限公司根据中国证监会规定,于2017年10月25日发布了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证基金投资者不存在虚假记载、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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失。

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。

本报告期内基金无申购或赎回情况。

本报告期内基金无申购或赎回情况。



注:1.本基金合同于2016年7月8日生效。  
2.本报告期末,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。

**4.1 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时间	证券从业年限	说明
张宇法	本基金基金经理	2017年04月	15年	男,软件工程师。历任华夏基金管理有限公司金融工程部高级经理,2014年2月加盟本公司,历任研究员、基金经理助理。

注:1.上述任职日期为基金管理人对外披露的任职日期。  
2.证券从业的含义参照行业协会《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**

本基金按照法律法规及基金合同的约定进行运作,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和建立一套公平交易和公平信息披露平台,保证投资组合公平的投资资讯,公平对待不同投资组合,禁止在不同投资组合之间进行利益输送为目的的投资交易活动;在证券投资组合投资决策和构建过程中,严格执行投资决策程序,实行集中交易管理和公平交易配置制度;建立不同投资组合投资决策的评估和反馈制度,保证不同投资组合之间的公平交易;同时,在交易执行过程中,加强投资决策执行的监督和执行力度,建立有效的异常交易行为日常监控和评估体系等。

报告期内,公司公平交易程序严格执行,未出现异常情形;此外,同一基金公平交易制度执行情况良好,未出现异常情形。

公司对旗下各投资组合的交易行为进行监控分析,对各投资组合不同时间窗口(1日、3日、5日)内的同向交易的价格溢价率溢价率进行了检测,未发现违反公平交易制度的异常交易。

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公平交易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,公平对待投资者,制定《异常交易监控和报告办法》,可能影响市场价格的,可能涉嫌不公平交易、可能涉嫌利益输送等与异常交易和交易价格异常的情形进行界定,采取相应的监控、分析和控制措施。

报告期内,严格执行同一基金不同投资组合之间的同日反向交易,严格禁止可能不公平交易和利益输送的同日反向交易;对于非公平交易事项,以公司名义进行的前一市场,由非公平交易的申购方部分以反向申购和赎回,保证不同投资组合公平交易制度,本基金不存在有异常交易行为。

本基金报告期内未发现同一基金不同投资组合之间在同一交易日内进行反向交易及其他可能影响公平交易和利益输送的行为。

4.4 报告期内本基金运作过程中严格恪守基金合同,坚持稳定的指数化投资策略,对指数基金采取策略跟踪与主动化调整相结合的方式。

报告期内,本基金在运作过程中严格恪守基金合同,坚持稳定的指数化投资策略,对指数基金采取策略跟踪与主动化调整相结合的方式。

2017年三季度,国内证券市场整体平稳运行,整体市场波动幅度较大,但不具风险和不同行业的股票走势差异较大,创业板指数走势整体平稳且反弹,报告期内本基金跟踪误差的主要来源是申购赎回,成分股权重和长期停牌股票的影响,由于申购赎回、成分股权重和长期停牌等因素引起组合调整,在操作过程中恪守合同第一原则,同时,在合同范围内,结合市场环境进行主动化调整,应用指数化跟踪和主动化调整相结合的方式,最大限度减少跟踪误差,力争投资策略与跟踪指数保持一致,努力为投资者提供一个良好的指数投资工具。

4.5 报告期内基金的投资策略和业绩表现

截至2017年9月30日,天弘创业板指数发起式基金份额净值为0.7410元,天弘创业板指数发起式OC份额净值为0.7385元,报告期内基金份额增长率及创业板指数涨跌幅分别为19.1%,天弘创业板指数发起式OC份额净值为0.7385元,报告期内基金份额增长率及创业板指数涨跌幅分别为19.1%,天弘创业板指数发起式OC份额净值为0.7385元,报告期内基金份额增长率及创业板指数涨跌幅分别为19.1%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期末基金管理人无追偿到期债务。

4. 管理人主要宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

三季度,在非金融企业特别是国有企业资产负债率未明显改善的情况下,经济杠杆尤其是国有企业资产负债率将继续维持高位,预计制造业投资增速仍将保持低位,近期期间的预期政策对地产行业不利,货币政策稳健增长和稳健;财政支出及资金需求稳定,基建投资预计将有回落,消费方面,社会消费品零售增速为平稳,若宽松的财政政策,预计难以大幅回升,整体来看,各项政策预期都有利于经济长期健康发展的,但短期看市场企稳回升的要素尚不充分,同时市场也有不少不利因素,全球主要经济体的持续复苏仍将保持向好趋势,持续推高的政策预期和稳增长预期低通胀和通缩,即将召开的十九大将可能进一步改善开放注入新的活力,市场上仍存不少结构性机会。

**5.1 报告期末基金资产组合情况**

序号	项目	金额	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	5,361,818,274.10	80.40
2	固定收益投资	5,361,818,274.10	80.40
3	固定收益投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
6	其他资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	40,960,703.07	0.60
8	其他资产	15,689,079.01	0.24
9	合计	5,398,466,056.05	100.00

**5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合**

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	-	-
C	制造业	7,228,507.28	1.28
D	电力、热力、燃气及生产供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,321,606.00	0.41
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	2,300,604.00	0.41
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	12,796.00	0.00
S	综合	-	-
合计	合计	11,869,409.28	2.11

**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**

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	300066	福乐股份	1,744,000	27,534,790.43	6.66
2	300048	东方国信	1,386,122	18,979,627.26	3.36
3	300138	蓝晓科技	356,173	14,977,267.00	2.65
4	300104	乐视网	1,206,804	14,150,206.88	2.57
5	300124	汇川技术	482,464	13,943,209.60	2.47
6	300070	碧水源	698,950	12,588,089.50	2.23
7	300072	三钢闽光	468,104	12,420,309.28	2.23
8	300499	三钢闽光	409,572	12,294,478.28	2.18
9	300028	航嘉	649,566	12,143,147.42	2.13
10	300003	乐视网	420,115	9,028,271.36	1.60

**5.4 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指期货投资明细**

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	3000463	迈迪生物	92,800	2,376,800.00	0.42
2	300075	数字政通	110,500	2,321,005.00	0.41
3	300284	苏交科	115,100	2,306,404.00	0.41
4	300236	福瑞泰	165,300	2,298,231.00	0.41
5	300022	华灿光电	128,400	2,292,692.00	0.41

**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**

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	000000	民生银行	69,878	528,341.56	0.09
2	000001	格力电器	12,380	697,869.00	0.13
3	000002	万科A	18,931	468,103.28	0.08
4	000128	农业银行	76,790	448,749.00	0.08
5	000887	伊泰煤炭	16,308	464,070.00	0.08

**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五名权证投资明细**

本基金本报告期末未持有权证。

**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。

**5.8 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贵金属投资明细**

本基金本报告期末未持有贵金属。

**5.9 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衍生品投资明细**

本基金本报告期末未持有衍生品。

**5.10 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境外证券投资明细**

本基金本报告期末未持有境外投资。

**5.11 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。

**5.12 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。

**5.13 投资组合报告附注**

5.13.1 报告期内本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12个月内受到公开谴责、通报批评, 均符合基金投资备选库选择要求之的规定。

5.13.2 报告期内本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12个月内受到公开谴责、通报批评, 均符合基金投资备选库选择要求之的规定。

5.13.3 报告期内本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12个月内受到公开谴责、通报批评, 均符合基金投资备选库选择要求之的规定。

5.13.4 报告期内本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12个月内受到公开谴责、通报批评, 均符合基金投资备选库选择要求之的规定。

5.13.5 报告期内本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12个月内受到公开谴责、通报批评, 均符合基金投资备选库选择要求之的规定。

5.13.6 报告期内本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12个月内受到公开谴责、通报批评, 均符合基金投资备选库选择要求之的规定。

5.13.7 报告期内本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12个月内受到公开谴责、通报批评, 均符合基金投资备选库选择要求之的规定。

5.13.8 报告期内本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12个月内受到公开谴责、通报批评, 均符合基金投资备选库选择要求之的规定。

5.13.9 报告期内本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12个月内受到公开谴责、通报批评, 均符合基金投资备选库选择要求之的规定。

5.13.10 报告期内本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12个月内受到公开谴责、通报批评, 均符合基金投资备选库选择要求之的规定。

5.13.11 报告期内本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12个月内受到公开谴责、通报批评, 均符合基金投资备选库选择要求之的规定。

5.13.12 报告期内本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12个月内受到公开谴责、通报批评, 均符合基金投资备选库选择要求之的规定。

5.13.13 报告期内本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12个月内受到公开谴责、通报批评, 均符合基金投资备选库选择要求之的规定。

5.13.14 报告期内本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12个月内受到公开谴责、通报批评, 均符合基金投资备选库选择要求之的规定。

5.13.15 报告期内本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12个月内受到公开谴责、通报批评, 均符合基金投资备选库选择要求之的规定。

5.13.16 报告期内本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12个月内受到公开谴责、通报批评, 均符合基金投资备选库选择要求之的规定。

5.13.17 报告期内本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12个月内受到公开谴责、通报批评, 均符合基金投资备选库选择要求之的规定。

5.13.18 报告期内本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12个月内受到公开谴责、通报批评, 均符合基金投资备选库选择要求之的规定。

5.13.19 报告期内本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12个月内受到公开谴责、通报批评, 均符合基金投资备选库选择要求之的规定。

5.13.20 报告期内本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12个月内受到公开谴责、通报批评, 均符合基金投资备选库选择要求之的规定。

5.13.21 报告期内本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12个月内受到公开谴责、通报批评, 均符合基金投资备选库选择要求之的规定。

5.13.22 报告期内本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12个月内受到公开谴责、通报批评, 均符合基金投资备选库选择要求之的规定。

5.13.23 报告期内本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12个月内受到公开谴责、通报批评, 均符合基金投资备选库选择要求之的规定。

5.13.24 报告期内本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12个月内受到公开谴责、通报批评, 均符合基金投资备选库选择要求之的规定。

5.13.25 报告期内本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12个月内受到公开谴责、通报批评, 均符合基金投资备选库选择要求之的规定。

5.13.26 报告期内本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12个月内受到公开谴责、通报批评, 均符合基金投资备选库选择要求之的规定。

5.13.27 报告期内本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12个月内受到公开谴责、通报批评, 均符合基金投资备选库选择要求之的规定。

5.13.28 报告期内本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12个月内受到公开谴责、通报批评, 均符合基金投资备选库选择要求之的规定。

5.13.29 报告期内本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12个月内受到公开谴责、通报批评, 均符合基金投资备选库选择要求之的规定。

5.13.30 报告期内本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12个月内受到公开谴责、通报批评, 均符合基金投资备选库选择要求之的规定。

5.13.31 报告期内本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12个月内受到公开谴责、通报批评, 均符合基金投资备选库选择要求之的规定。

5.13.32 报告期内本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12个月内受到公开谴责、通报批评, 均符合基金投资备选库选择要求之的规定。

5.13.33 报告期内本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12个月内受到公开谴责、通报批评, 均符合基金投资备选库选择要求之的规定。

5.13.34 报告期内本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12个月内受到公开谴责、通报批评, 均符合基金投资备选库选择要求之的规定。

5.13.35 报告期内本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12个月内受到公开谴责、通报批评, 均符合基金投资备选库选择要求之的规定。

5.13.36 报告期内本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12个月内受到公开谴责、通报批评, 均符合基金投资备选库选择要求之的规定。

5.13.37 报告期内本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12个月内受到公开谴责、通报批评, 均符合基金投资备选库选择要求之的规定。

5.13.38 报告期内本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12个月内受到公开谴责、通报批评, 均符合基金投资备选库选择要求之的规定。

5.13.39 报告期内本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12个月内受到公开谴责、通报批评, 均符合基金投资备选库选择要求之的规定。

5.13.40 报告期内本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12个月内受到公开谴责、通报批评, 均符合基金投资备选库选择要求之的规定。

5.13.41 报告期内本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12个月内受到公开谴责、通报批评, 均符合基金投资备选库选择要求之的规定。

5.13.42 报告期内本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12个月内受到公开谴责、通报批评, 均符合基金投资备选库选择要求之的规定。

5.13.43 报告期内本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12个月内受到公开谴责、通报批评, 均符合基金投资备选库选择要求之的规定。

5.13.44 报告期内本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12个月内受到公开谴责、通报批评, 均符合基金投资备选库选择要求之的规定。

5.13.45 报告期内本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12个月内受到公开谴责、通报批评, 均符合基金投资备选库选择要求之的规定。

5.13.46 报告期内本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12个月内受到公开谴责、通报批评, 均符合基金投资备选库选择要求之的规定。

5.13.47 报告期内本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12个月内受到公开谴责、通报批评, 均符合基金投资备选库选择要求之的规定。

5.13.48 报告期内本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12个月内受到公开谴责、通报批评, 均符合基金投资备选库选择要求之的规定。

5.13.49 报告期内本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12个月内受到公开谴责、通报批评, 均符合基金投资备选库选择要求之的规定。

5.13.50 报告期内本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12个月内受到公开谴责、通报批评, 均符合基金投资备选库选择要求之的规定。

5.13.51 报告期内本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12个月内受到公开谴责、通报批评, 均符合基金投资备选库选择要求之的规定。

5.13.52 报告期内本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12个月内受到公开谴责、通报批评, 均符合基金投资备选库选择要求之的规定。

5.13.53 报告期内本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12个月内受到公开谴责、通报批评, 均符合基金投资备选库选择要求之的规定。

5.13.54 报告期内本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12个月内受到公开谴责、通报批评, 均符合基金投资备选库选择要求之的规定。

5.13.55 报告期内本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12个月内受到公开谴责、通报批评, 均符合基金投资备选库选择要求之的规定。

5.13.56 报告期内本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12个月内受到公开谴责、通报批评, 均符合基金投资备选库选择要求之的规定。

5.13.57 报告期内本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12个月内受到公开谴责、通报批评, 均符合基金投资备选库选择要求之的规定。

5.13.58 报告期内本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12个月内受到公开谴责、通报批评, 均符合基金投资备选库选择要求之的规定。

5.13.59 报告期内本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12个月内受到公开谴责、通报批评, 均符合基金投资备选库选择要求之的规定。

5.13.60 报告期内本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12个月内受到公开谴责、通报批评, 均符合基金投资备选库选择要求之的规定。

5.13.61 报告期内本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12个月内受到公开谴责、通报批评, 均符合基金投资备选库选择要求之的规定。

5.13.62 报告期内本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12个月内受到公开谴责、通报批评, 均符合基金投资备选库选择要求之的规定。

5.13.63 报告期内本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12个月内受到公开谴责、通报批评, 均符合基金投资备选库选择要求之的规定。

5.13.64 报告期内本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12个月内受到公开谴责、通报批评, 均符合基金投资备选库选择要求之的规定。

5.13.65 报告期内本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12个月内受到公开谴责、通报批评, 均符合基金投资备选库选择要求之的规定。

5.13.66 报告期内本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12个月内受到公开谴责、通报批评, 均符合基金投资备选库选择要求之的规定。

5.13.67 报告期内本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12个月内受到公开谴责、通报批评, 均符合基金投资备选库选择要求之的规定。

5.13.68 报告期内本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12个月内受到公开谴责、通报批评, 均符合基金投资备选库选择要求之的规定。

5.13.69 报告期内本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12个月内受到公开谴责、通报批评, 均符合基金投资备选库选择要求之的规定。

5.13.70 报告期内本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12个月内受到公开谴责、通报批评, 均符合基金投资备选库选择要求之的规定。