天弘金明灵活配置混合型证券投资基金

2017 第二季度 报告

2017年6月30日

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7月21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。
基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年7月20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4月1日起至2017年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	天弘金明混合
基金主代码	003666
基金运作方式	契约型、开放式
基金合同生效日	2017年3月9日
报告期末基金份额总额	960,392,226.49份
投资目标	本基金力求通过资产配置和灵活运用多种投资策略，把握市场机会，在严格控制风险的前提下获取高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金采取灵活资产配置，主动投资管理的投资模式。在投资策略上，本基金从两个层次进行，首先是进行大类资产配置，在一定程度上尽可能地降低证券市场的系统性风险，把握市场波动中产生的投资机会；其次是采取自下而上的分析方法，从定量和定性两个方面，通过深入的基本面研究分析，精选具有良好投资价值的个股和个券，构建股票组合和债券组合。
业绩比较基准	50%×沪深300指数收益率+50%×中证综合债指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于中等风险、中等收益预期的基金品种，其风险收益预期高于货币市场基金和债券型基金，低于股票型基金。
基金管理人	天弘基金管理有限公司
基金托管人	招商证券股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标
3.1.1 主要财务指标_本期

单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2017年4月1日-2017年6月30日）
1.本期已实现收益	23,917,801.76
2.本期利润	28,487,318.10
3.加权平均基金份额本期利润	0.0277
4.期末基金资产净值	988,681,815.73
5.期末基金份额净值	1.0295

3.1.2 主要财务指标_上期

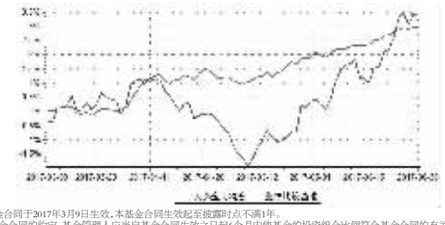
单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2017年3月9日-2017年3月31日）
1.本期已实现收益	1,300,331.66
2.本期利润	510,786.91
3.加权平均基金份额本期利润	0.0006
4.期末基金资产净值	932,899,870.14
5.期末基金份额净值	1.0008

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2017年3月9日生效，截止2017年3月31日本基金合同生效不足两个月，按照基金法的规定，未编制当期季度报告。本基金在本报告期内，单独列示按露基金合同生效起至上个季度末的财务指标。
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	2.87%	0.12%	3.16%	0.32%	-0.29%	-0.20%

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：1、本基金合同于2017年3月9日生效，本基金合同生效起至披露时点不满1年。
2、按照本基金合同的约定，基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。本基金的建仓期为2017年3月9日-2017年9月8日，截止本报告期末本基金仍处于建仓期。

§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		
姜晓丽	本基金基金经理。	2017年3月	-	8年	女，经济学硕士，历任本公司债券研究员兼债券交易员；北大本期人保险有限公司债券研究员兼交易员；本公司固定收益研究员、基金经理助理等。
钱文成	本基金基金经理。	2017年3月	-	11年	男，理学硕士，2007年8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年二季度，经济增长表现仍然较好，下游需求走势平稳；通胀方面PPI于2月见顶之后开始快速回落，而CPI由于食品价格表现低迷，整体维持低位，通胀担忧显著缓解，政策面方面，4月银监会连续发文，对银行监管加强，中央政治局会议更是将金融安全提到国家安全层面，引发市场对监管政策的极度担忧，但此后监管协调成为重点，市场过度悲观预期逐步修正，资金面方面，整体呈现前紧后松态势。债市方面，4、5月份在政策收紧、央行提高政策利率等利空下，呈现大幅下跌态势，此后6月由于悲观预期修正出现明显反弹。
本基金在报告期内，主要以稳健的风格进行操作，保持了一定的债券和股票仓位，同时参与股票一级市场的机会。
4.5 报告期内基金的业绩表现
截至2017年6月30日，本基金份额净值为1.0295元，本报告期份额净值增长率2.87%，同期业绩比较基准增长率3.16%。
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年三季度，我们认为后续经济增长将逐步小幅放缓，但是下行幅度和速度可能不及市场预期，也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，资金利率中枢向不会出现大幅下行，政策面方面，货币政策中性稳健立场不变，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，但是鉴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，积极把握债券和股票市场的机会，继续为投资人贡献稳健正收益。

§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)	占基金资产的比例（%）
1	权益投资	22,633,468.56	2.29
	其中：股票	22,633,468.56	2.29
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	940,718,400.00	95.02
	其中：债券	940,718,400.00	95.02
	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	12,000,000.00	1.21
	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	1,826,519.80	0.18
8	其他各项资产	12,889,462.77	1.30
9	合计	990,067,851.13	100.00

5.2 报告期末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	-	-
C	制造业	11,957,222.56	1.21
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	-	-
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	-	-
J	金融业	10,676,246.00	1.08
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	-	-
R	文化、体育和娱乐业	-	-
S	综合	-	-
	合计	22,633,468.56	2.29

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

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	000921	海信科龙	680,300	11,707,963.00	1.18
2	600643	爱建集团	712,700	10,676,246.00	1.08
3	603043	广州酒家	1,810	45,738.70	0.00
4	300666	江丰电子	2,276	43,448.84	0.00
5	603335	迪生力	2,230	24,864.50	0.00
6	002879	长缆科技	1,313	23,660.26	0.00
7	002881	美格智能	989	22,608.54	0.00
8	603679	华体科技	809	21,438.50	0.00
9	603938	三孚股份	1,246	20,932.80	0.00
10	002882	金龙羽	2,966	18,389.20	0.00

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	14,983,500.00	1.52
2	央行票据	-	-
3	金融债券	107,436,000.00	10.87
	其中：政策性金融债	107,436,000.00	10.87
4	企业债券	127,462,500.00	12.89
5	企业短期融资券	520,580,000.00	52.65
6	中期票据	-	-
7	可转债	2,101,400.00	0.21
8	同业存单	168,155,000.00	17.01
9	其他	-	-
10	合计	940,718,400.00	95.15

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	占基金资产净值比例（%）
1	111711195	17平安银行CD195	900,000	89,001,000.00	9.00
2	111717098	17光大银行CD098	600,000	59,370,000.00	6.00
3	011698931	16华邦建设SCP001	500,000	50,135,000.00	5.07
4	011762024	17天士力SCP002	500,000	50,125,000.00	5.07
5	041759010	17浦东土地CP001	500,000	50,105,000.00	5.07

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 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

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	118,158.78
2	应收证券清算款	1,262,989.81
3	应收股利	-
4	应收利息	10,891,156.39
5	应收申购款	617,157.79
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	12,889,462.77

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

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例（%）	流通受限情况说明
1	600643	爱建集团	10,676,246.00	1.08	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	932,189,321.40
报告期期间基金总申购份额	128,517,558.16
减：报告期期间基金总赎回份额	100,314,653.07
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	960,392,226.49

§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	2017/4/1-2017/6/30	450,017,000.00	-	-	450,017,000.00	46.86%
	2	2017/4/1-2017/6/30	299,699,300.70	-	-	299,699,300.70	31.21%
产品持有风险							
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金明灵活配置混合型证券投资基金募集的文件
2、天弘金明灵活配置混合型证券投资基金基金合同
3、天弘金明灵活配置混合型证券投资基金托管协议
4、天弘金明灵活配置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
二〇一七年七月二十一日

英大现金宝货币市场基金

2017 第二季度 报告

2017年6月30日

基金管理人：英大基金管理有限公司
基金托管人：中国建设银行股份有限公司
报告送出日期：2017年7月21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。
基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年7月18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4月1日起至6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	英大现金宝货币
场内简称	-
交易代码	000912
前端交易代码	-
后端交易代码	-
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年12月10日
报告期末基金份额总额	441,161,036.40份
投资目标	本基金投资于固定收益类资产，在有效控制投资组合风险的前提下力争获取高于业绩比较基准的投资收益，追求长期稳定的投资回报。
投资策略	本基金投资策略将结合现金需求安排和货币市场利率预测，在保证基金资产安全性和流动性的基础上，获取较高的收益。
业绩比较基准	同期7天通知存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为货币市场基金，属于证券投资基金中的低风险品种，其预期收益和预期风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。
基金管理人	英大基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

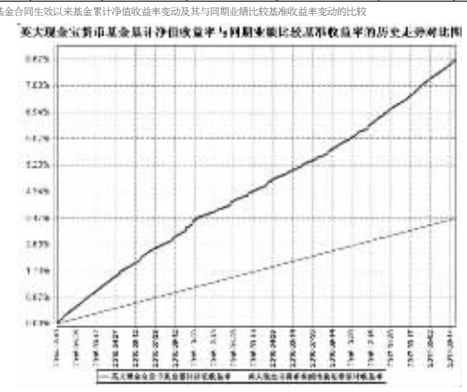
单位：人民币元

主要财务指标	报告期（2017年4月1日 - 2017年6月30日）
1. 本期已实现收益	4,639,345.89
2. 本期利润	4,639,345.89
3. 期末基金资产净值	441,161,036.40

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，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，由于货币市场基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。
3.2 基金净值表现
3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.9493%	0.0035%	0.3366%	0.0000%	0.6127%	0.0035%

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率与其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



§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		
易棋坤	本基金基金经理	2017年3月2日	-	-	北京大学理学学士，5年以上证券从业经历，2011年4月至2013年8月就职于睿诚投资咨询（上海）有限公司，任衍生品交易员。2013年10月加入英大基金管理有限公司，历任公司交易管理部交易员和交易管理部副总经理（主持工作）。
张琳娜	-	2014年12月10日	-	9	对外经济贸易大学金融学硕士，9年基金从业经历，先后任巨胤民基金管理有限公司集中交易部交易员、副总经理等职务。2012年3月加入英大基金管理有限公司，曾任公司交易管理部副总经理（主持工作），现任固定收益部总经理。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明
在本报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金法》和其他相关法律法规的规定以及《英大现金宝货币市场基金基金合同》、《英大现金宝货币市场基金招募说明书》的约定，以取信于市场、取信于社会投资公众为宗旨，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产。本基金管理人通过不断完善法人治理结构和内部控制制度，加强内部管理，规范基金运作。本报告期内，基金运作合法合规，没有发生损害基金份额持有人利益的行为。
4.3 公平交易专项说明
4.3.1 公平交易制度的执行情况
报告期内，本基金管理人严格按照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及《英大基金管理有限公司公平交易管理办法》的规定，从研究分析、投资决策、交易执行、事后监控等环节严格把关，通过公司新上线的公平交易系统监测和人工复核等方式在各个环节严格控制交易公平执行，未发现不同投资组合之间存在非公平交易的情况。
4.3.2 异常交易行为的专项说明
报告期内，本基金不存在参与交易所公开竞价同日反向交易或交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情况，且不存在其他可能导致非公平交易和利益输送的异常交易行为。
4.4 报告期内基金投资策略和运作分析
2017年二季度监管去杠杆政策持续发酵，央行呵护资金市场利率稳定意图明显，货币政策中性偏紧但边际宽松，资金面呈现前紧后松的走势，在月末、季末等紧张性时点资金价格波动进一步加大，现券市场短端收益率先上后下，整体上行幅度在25bp左右，其中国股存单收益率最高上行到5%，具有较好的配置价值，随后有所回落。
本基金二季度调整了持仓结构，提升了债券配置比例，增加了短融和存单的占比，降低了政策性金融债和回购占比，保持流动性的同时，收益较为稳定。
4.5 报告期内基金的业绩表现
截至报告期末，本基金本报告期的份额净值收益率为0.9493%，同期业绩比较基准收益率为0.3366%。
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，本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万的情形。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额（元）	占基金总资产的比例（%）
1	固定收益投资	388,811,570.56	74.52
	其中：债券	388,811,570.56	74.52
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	119,007,858.51	22.81
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	11,175,714.22	2.14
4	其他资产	2,730,189.89	0.52
5	合计	521,725,333.18	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值的比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	12.47	
	其中：买断式回购融资	-	
序号	项目	金额（元）	占基金资产净值的比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	79,999,760.00	18.13
	其中：买断式回购融资	-	-

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

序号	发生日期	融资余额占基金资产净值比例（%）	原因	调整期
1	2017年6月14日	20.14	应付赎回	1天

5.3 基金投资组合平均剩余期限
5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	64
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	72
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	52

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明
5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例（%）	各期限负债占基金资产净值的比例（%）
1	30天以内	43.09	18.13
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	22.55	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	33.86	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-120天	2.27	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)-397天（含）	15.88	-
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		117.64	18.13

5.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明
注：本基金本报告期内投资组合平均剩余存续期未超过240天。
5.5 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	摊余成本（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	50,062,898.82	11.35
	其中：政策性金融债	50,062,898.82	11.35
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	160,026,240.94	36.27
6	中期票据	-	-
7	同业存单	178,722,430.80	40.51
8	其他	-	-
9	合计	388,811,570.56	88.13
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

5.6 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排序的前十名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	债券数量（张）	摊余成本(元)	占基金资产净值比例（%）
1	150201	15国开01	300,000	30,089,136.97	6.82
2	011756013	17中航租赁SCP001	300,000	30,000,935.95	6.80
3	011698568	16同方SCP005	300,000	29,999,542.80	6.80
4	111719021	17恒丰银行CD021	300,000	29,821,172.86	6.76
5	011697010	16铁建SCP006	200,000	20,054,471.66	4.55
6	111796473	17天津农村商业银行CD138	200,000	19,938,368.85	4.52
7	111711210	17平安银行CD210	200,000	19,860,773.09	4.50
8	111719156	17恒丰银行CD156	200,000	19,859,322.04	4.50
9	150207	15国开07	100,000	10,037,009.68	2.28
10	011758034	17广州金融SCP001	100,000	10,000,023.31	2.27

5.7 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25%(含)-0.5%间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	0.1130%
报告期内偏离度的最低值	-0.0107%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0252%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明
注：本基金本报告期内负偏离度的绝对值未达到0.25%。
报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明
注：本基金本报告期内正偏离度的绝对值未达到0.5%。
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十名资产支持证券投资明细
注：本基金本报告期末未持有资产支持证券。
5.9 投资组合报告附注
5.9.1 其他资产构成

序号	名称	金额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	2,582,857.88
4	应收申购款	147,332.01
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	2,730,189.89

5.9.2 投资组合报告附注的其他文字描述部分
-

§6 开放式基金份额变动

单位：份

报告期期初基金份额总额	480,903,045.13
报告期期间基金总申购份额	139,341,327.90
报告期期间基金总赎回份额	179,083,336.63
报告期期末基金份额总额	441,161,036.40

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
注：本报告期末基金管理人未持有本基金份额

§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	2017.4.1-2017.6.30	203,294,170.19	1,906,492.01	0.00	205,200,662.20	46.51
产品持有风险							
-							

8.2 影响投资者决策的其他重要信息
无。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录
中国证监会批准英大现金宝货币市场基金设立的文件
《英大现金宝货币市场基金基金合同》
《英大现金宝货币市场基金托管协议》
基金管理人业务资格批件和营业执照
报告期内基金管理人在指定报刊上披露的各项公告
9.2 存放地点
基金管理人和/或基金托管人住所
9.3 查阅方式
投资者可到基金管理人的住所及网站或基金托管人的住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：http://www.ydamc.com/

英大基金管理有限公司
2017年7月21日

天弘中证电子指数型发起式证券投资基金

2017 第二季度 报告

2017年6月30日

基金管理人：天弘基金管理有限公司
基金托管人：海通证券股份有限公司
报告送出日期：2017年07月21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。
基金托管人海通证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年07月20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04月01日起至2017年06月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	天弘中证电子
基金主代码	001617
基金运作方式	契约型开放式，发起式
基金合同生效日	2015年07月29日
报告期末基金份额总额	26,966,620.68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法的指数的方法，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跟踪误差的前提下，力争获取与标的指数相匹配的投资收益。
业绩比较基准	本基金投资组合的业绩比较基准为：中证电子指数收益率×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	海通证券股份有限公司
下属分级基金的基金简称	天弘中证电子A	天弘中证电子C
下属分级基金的交易代码	001617	001618
报告期末下属分级基金的份额总额	7,748,438.98份	19,218,181.70份

§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04月01日-2017年06月30日）	
	天弘中证电子A	天弘中证电子C
1.本期已实现收益	72,154.88	292,385.60
2.本期利润	302,245.97	207,792.89
3.加权平均基金份额本期利润	0.0421	0.0051
4.期末基金资产净值	7,192,691.56	17,742,993.84
5.期末基金份额净值	0.9283	0.9232

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