# 天弘现金管家货币市场基金

## 2017 半年度 报告摘要

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:中国邮政储蓄银行股份有限公司**
**送出日期:2017年8月28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。本半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8月24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及其更新。

本半年度报告摘要摘自半年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读半年度报告正文。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2017年1月1日起至2017年6月30日止。

### §2 基金简介

2.1 基金基本情况

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| 基金简称 | 天弘现金管家货币 | | | | |
| 基金主代码 | 420006 | | | | |
| 基金运作方式 | 契约型开放式 | | | | |
| 基金合同生效日 | 2012年6月20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 | | | | |
| 报告期末基金份额总额 | 9,389,057,526.00份 | | | | |
| 基金合同存续期 | 不定期 | | | | |
| 下属分级基金的基金简称 | 天弘现金管家货币A类 | 天弘现金管家货币B类 | 天弘现金管家货币C类 | 天弘现金管家货币D类 | 天弘现金管家货币E类 |
| 下属分级基金的交易代码 | 420006 | 420106 | 000832 | 001251 | 002847 |
| 报告期末下属分级基金的份额总额 | 214,453,563.64份 | 7,883,116,313.35份 | 580,284,233.15份 | 298,392,580.68份 | 412,810,835.18份 |

2.2 基金产品说明

| | |
|---|---|
| 投资目标 | 在保持基金资产的低风险和高流动性的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。 |
| 投资策略 | 本基金根据对短期利率变动的预测,采用投资组合平均剩余期限控制下的主动性投资策略,利用定性分析和定量分析方法,通过对短期金融工具的积极投资,在控制风险和保证流动性的基础上,力争获得稳定的当期收益。 |
| 业绩比较基准 | 同期七天通知存款利率(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,其预期收益和风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。 |

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 | 中国邮政储蓄银行股份有限公司 |
| 信息披露负责人 | 姓名 | 童建林 | 田东辉 |
| | 联系电话 | 022-83310208 | 010-68858113 |
| | 电子邮箱 | service@thfund.com.cn | tiandonghui@psbc.com |
| 客户服务电话 | | 4007109999 | 95580 |
| 传真 | | 022-83865569 | 010-68858120 |

2.4 信息披露方式

| | |
|---|---|
| 登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址 | www.thfund.com.cn |
| 基金半年度报告备置地点 | 基金管理人及基金托管人的办公地址 |

### §3 主要财务指标和基金净值表现

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 | 报告期(2017年1月1日-2017年6月30日) | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | 天弘现金管家货币A类 | 天弘现金管家货币B类 | 天弘现金管家货币C类 | 天弘现金管家货币D类 | 天弘现金管家货币E类 |
| 本期已实现收益 | 2,548,511.14 | 138,027,957.18 | 10,036,472.67 | 5,074,583.24 | 1,079,331.08 |
| 本期利润 | 2,548,511.14 | 138,027,957.18 | 10,036,472.67 | 5,074,583.24 | 1,079,331.08 |
| 本期净值收益率 | 1.7435% | 1.8643% | 1.7683% | 1.7433% | 1.7447% |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 报告期末(2017年6月30日) | | | | |
| 期末基金资产净值 | 214,453,563.64 | 7,883,116,313.35 | 580,284,233.15 | 298,392,580.68 | 412,810,835.18 |
| 期末基金份额净值 | 1.0000 | 1.0000 | 1.0000 | 1.0000 | 1.0000 |

注:1、本基金无持有人认购或交易基金的各项费用。

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、本基金的利润分配是按日结转份额。

4、本基金于2014年10月15日起增加天弘现金管家货币C类基金份额,于2015年5月5日起增加天弘现金管家货币D类基金份额,于2016年7月14日起增加天弘现金管家货币E类基金份额。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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

(1)天弘现金管家货币A类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(A级) | 份额净值收益率① | 份额净值收益率标准差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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去一个月 | 0.3143% | 0.0016% | 0.1126% | 0.0000% | 0.2017% | 0.0016% |
| 过去三个月 | 0.9034% | 0.0013% | 0.3418% | 0.0000% | 0.5616% | 0.0013% |
| 过去六个月 | 1.7435% | 0.0013% | 0.6810% | 0.0000% | 1.0625% | 0.0013% |
| 过去一年 | 2.9333% | 0.0033% | 1.3781% | 0.0000% | 1.5552% | 0.0033% |
| 过去三年 | 9.4040% | 0.0060% | 4.1955% | 0.0000% | 5.2085% | 0.0060% |
| 自基金合同生效日起至今(2012年06月20日-2017年06月30日) | 18.0602% | 0.0069% | 7.1333% | 0.0000% | 10.9269% | 0.0069% |

(2)天弘现金管家货币B类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(B级) | 份额净值收益率① | 份额净值收益率标准差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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去一个月 | 0.3340% | 0.0016% | 0.1126% | 0.0000% | 0.2214% | 0.0016% |
| 过去三个月 | 0.9636% | 0.0013% | 0.3418% | 0.0000% | 0.6218% | 0.0013% |
| 过去六个月 | 1.8643% | 0.0013% | 0.6810% | 0.0000% | 1.1833% | 0.0013% |
| 过去一年 | 3.1823% | 0.0032% | 1.3781% | 0.0000% | 1.8042% | 0.0032% |
| 过去三年 | 10.1979% | 0.0060% | 4.1955% | 0.0000% | 6.0024% | 0.0060% |
| 自基金合同生效日起至今(2012年06月20日-2017年06月30日) | 19.4975% | 0.0069% | 7.1333% | 0.0000% | 12.3642% | 0.0069% |

(3)天弘现金管家货币C类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(C级) | 份额净值收益率① | 份额净值收益率标准差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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去一个月 | 0.3183% | 0.0016% | 0.1126% | 0.0000% | 0.2057% | 0.0016% |
| 过去三个月 | 0.9158% | 0.0013% | 0.3418% | 0.0000% | 0.5740% | 0.0013% |
| 过去六个月 | 1.7683% | 0.0013% | 0.6810% | 0.0000% | 1.0873% | 0.0013% |
| 过去一年 | 2.9867% | 0.0032% | 1.3781% | 0.0000% | 1.6086% | 0.0032% |
| 自C级份额生效日起至今(2014年10月15日-2017年06月30日) | 8.4166% | 0.0056% | 3.7627% | 0.0000% | 4.6539% | 0.0056% |

(4)天弘现金管家货币D类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(D级) | 份额净值收益率① | 份额净值收益率标准差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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去一个月 | 0.3141% | 0.0016% | 0.1126% | 0.0000% | 0.2015% | 0.0016% |
| 过去三个月 | 0.9031% | 0.0013% | 0.3418% | 0.0000% | 0.5613% | 0.0013% |
| 过去六个月 | 1.7433% | 0.0013% | 0.6810% | 0.0000% | 1.0623% | 0.0013% |
| 过去一年 | 2.9357% | 0.0032% | 1.3781% | 0.0000% | 1.5576% | 0.0032% |
| 自D级份额生效日起至今(2015年05月05日-2017年06月30日) | 5.7732% | 0.0035% | 2.9913% | 0.0000% | 2.7819% | 0.0035% |

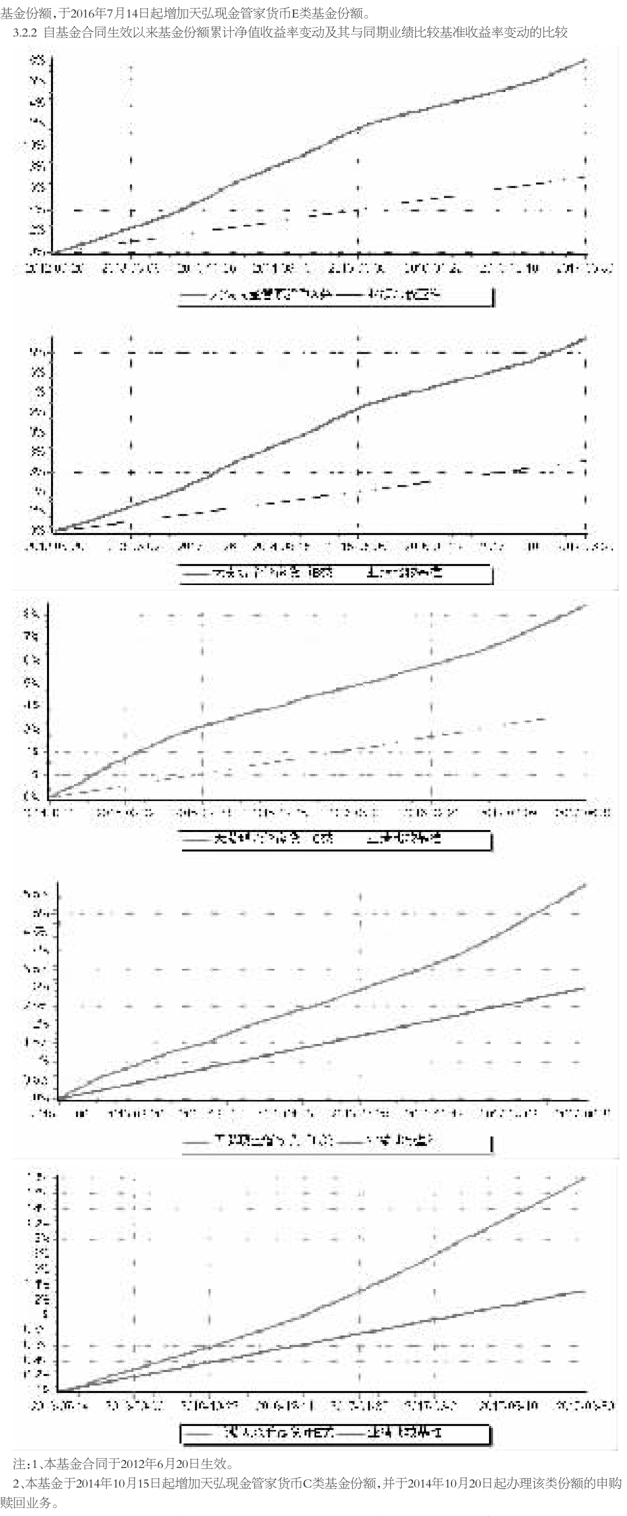
(5)天弘现金管家货币E类基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段(E级) | 份额净值收益率① | 份额净值收益率标准差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 |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去一个月 | 0.3156% | 0.0016% | 0.1126% | 0.0000% | 0.2030% | 0.0016% |
| 过去三个月 | 0.9049% | 0.0013% | 0.3418% | 0.0000% | 0.5631% | 0.0013% |
| 过去六个月 | 1.7447% | 0.0014% | 0.6810% | 0.0000% | 1.0637% | 0.0014% |
| 自E级份额生效日起至今(2016年07月14日-2017年06月30日) | 2.8204% | 0.0033% | 1.3249% | 0.0000% | 1.4955% | 0.0033% |

注:1、天弘现金管家货币市场基金业绩比较基准:同期七天通知存款利率(税后)。通知存款是一种不约定存期,支取时需提前通知银行,约定支取日期和金额方能支取的存款,具有存期灵活、存取方便的特征,同时可获得高于活期存款利息的收益。本基金为货币市场基金,具有低风险、高流动性的特征。根据基金的投资标的、投资目标及流动性特征,本基金选取同期七天通知存款利率(税后)作为本基金的业绩比较基准。

2、本基金于2014年10月15日起增加天弘现金管家货币C类基金份额,于2015年5月5日起增加天弘现金管家货币D类基金份额,于2016年7月14日起增加天弘现金管家货币E类基金份额。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益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2012年6月20日生效。

2、本基金于2014年10月15日起增加天弘现金管家货币C类基金份额,并于2014年10月20日起办理该类份额的申购和赎回业务。

3、本基金于2015年5月5日起增加天弘现金管家货币D类基金份额,并于2015年5月6日起办理该类份额的申购和赎回业务。

4、本基金于2016年7月14日起增加天弘现金管家货币E类基金份额,并于2016年7月14日起办理该类份额的申购和赎回业务。

5、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2017年6月30日,本基金管理人共管理54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、天弘弘运宝货币市场基金、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、天弘金明灵活配置混合型证券投资基金、天弘天盈灵活配置混合型证券投资基金、天弘策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金。

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期限 | | 证券从业年限 | 说明 |
|---|---|---|---|---|---|
| | | 任职日期 | 离任日期 | | |
| 王登峰 | 本基金基金经理;本公司固定收益部总经理。 | 2012年8月 | - | 8年 | 男,经济学硕士。历任中信建投证券股份有限公司固定收益部高级经理。2012年5月加盟本公司,历任本公司固定收益研究员等。 |
| 李晨 | 本基金基金经理。 | 2016年11月 | - | 7年 | 女,金融学硕士。历任泰康资产管理有限责任公司助理研究员。2011年6月加盟本公司。 |

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。

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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2017年上半年,经济基本面表现较好,下游需求走势平稳,经济增长表现超市场预期;通胀方面PPI则主要受基数效应影响,先上后下,但是CPI由于食品价格表现低迷,除1月由于春节错位效应较高之外,较去年明显放缓,通胀担忧显著缓解;政策面方面,货币政策边际趋于紧缩,央行两次提高操作利率,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,资金利率中枢在央行"加息"之下有所抬升,且波动率进一步加大;债市方面,在政策收紧、央行提高政策利率等利空下,整体呈下跌态势,收益率水平突破了去年年底高点,尤其是4、5月份在政策收紧、监管加强等利空下,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,坚持稳健理财的投资理念,把控制流动性风险作为组合管理最重要的因素。根据产品大额用户较多,申购赎回频繁,与市场资金面同向性较强的特点,年初缩短久期,半年末抓住时点紧张的机会拉长久期,增加配置。报告期内,本组合为持有人创造了合意的收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2017年6月30日,A级基金份额净值收益率1.7435%,B级基金份额净值收益率1.8643%,C级基金份额净值收益率1.7683%,D级基金份额净值收益率1.7433%,E级基金份额净值收益率1.7447%,同期业绩比较基准收益率0.6810%。

4.5 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年下半年,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,尤其是三季度将呈现较为平稳的态势。资金面方面,伴随着去杠杆进程的逐步推进,资金利率中枢将有所下行,但是脉冲式收紧仍将出现,资金利率中枢也尚不会出现大幅下行。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,本基金将继续秉承"稳健理财"的投资理念,动态观察市场资金面变化,在控制好流动性风险,久期风险及信用风险的基础上,灵活调整组合资产持有比例,密切观察市场变化,抓住波段机会,在风险可控的基础上,继续为持有人创造稳健的收益。

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固定收益投资估值业务的高级管理人员、督察长、投资总监、分管估值业务的IT运维总监、投资研究部负责人组成。

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、基金会计、风险管理人员及监察稽核人员组成。

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

根据本基金合同及招募说明书(更新)等有关规定,本基金每日将基金净收益分配给基金份额持有人(该收益参与下一日的收益分配)。

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,中国邮政储蓄银行股份有限公司(以下称"本托管人")在天弘现金管家货币市场基金(以下称"本基金")的托管过程中,严格遵守《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《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、利润分配情况等方面进行了认真地复核,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 托管人对本半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、投资组合报告等数据真实、准确和完整。

### §6 半年度财务会计报告(未经审计)

6.1 资产负债表

会计主体:天弘现金管家货币市场基金

报告截止日:2017年6月30日

单位:人民币元

| 资 产 | 附注号 | 本期末<br>2017年6月30日 | 上年度末<br>2016年12月31日 |
|---|---|---|---|
| 资 产: | | | |
| 银行存款 | 6.4.7.1 | 3,411,713,115.03 | 1,798,615,145.27 |
| 结算备付金 | | - | - |
| 存出保证金 | | - | 25,612.65 |
| 交易性金融资产 | 6.4.7.2 | 4,594,490,600.23 | 628,861,872.10 |
| 其中:股票投资 | | - | - |
| 基金投资 | | - | - |
| 债券投资 | | 4,594,490,600.23 | 628,861,872.10 |
| 资产支持证券投资 | | - | - |
| 贵金属投资 | | - | - |
| 衍生金融资产 | 6.4.7.3 | - | - |
| 买入返售金融资产 | 6.4.7.4 | 1,294,244,741.36 | 959,993,679.99 |
| 应收证券清算款 | | - | - |
| 应收利息 | 6.4.7.5 | 51,854,570.43 | 12,235,436.53 |
| 应收股利 | | - | - |
| 应收申购款 | | 41,667,379.47 | 24,191,502.72 |
| 递延所得税资产 | | - | - |
| 其他资产 | 6.4.7.6 | - | - |
| 资产总计 | | 9,393,970,406.52 | 3,423,923,249.26 |
| 负债和所有者权益 | 附注号 | 本期末<br>2017年6月30日 | 上年度末<br>2016年12月31日 |
| 负 债: | | | |
| 短期借款 | | - | - |
| 交易性金融负债 | | - | - |
| 衍生金融负债 | 6.4.7.3 | - | - |
| 卖出回购金融资产款 | | - | - |
| 应付证券清算款 | | - | - |
| 应付赎回款 | | - | - |
| 应付管理人报酬 | | 3,214,002.81 | 1,241,491.00 |
| 应付托管费 | | 973,940.24 | 376,209.40 |
| 应付销售服务费 | | 331,144.60 | 192,378.23 |
| 应付交易费用 | 6.4.7.7 | 186,438.59 | 80,003.30 |
| 应交税费 | | - | - |
| 应付利息 | | - | - |
| 应付利润 | | - | - |
| 递延所得税负债 | | - | - |
| 其他负债 | 6.4.7.8 | 207,354.28 | 470,000.00 |
| 负债合计 | | 4,912,880.52 | 2,360,081.93 |
| 所有者权益: | | | |
| 实收基金 | 6.4.7.9 | 9,389,057,526.00 | 3,421,563,167.33 |
| 未分配利润 | 6.4.7.10 | - | - |
| 所有者权益合计 | | 9,389,057,526.00 | 3,421,563,167.33 |
| 负债和所有者权益总计 | | 9,393,970,406.52 | 3,423,923,249.26 |

注:报告截止日2017年6月30日,基金份额净值1.0000元,天弘现金管家货币市场基金份额总额9,389,057,526.00份,其中天弘现金管家货币市场基金A级基金份额的份额总额为214,453,563.64份,天弘现金管家货币市场基金B级基金份额的份额总额为7,883,116,313.35份,天弘现金管家货币市场基金C级基金份额的份额总额为580,284,233.15份,天弘现金管家货币市场基金D级基金份额的份额总额为298,392,580.68份,天弘现金管家货币市场基金E级基金份额的份额总额为412,810,835.18份。

6.2 利润表

会计主体:天弘现金管家货币市场基金

本报告期:2017年1月1日-2017年6月30日

单位:人民币元

| 项 目 | 附注号 | 本期<br>2017年1月1日-2017年6月30日 | 上年度可比期间<br>2016年01月01日-2016年06月30日 |
|---|---|---|---|
| 一、收入 | | 179,183,016.57 | 150,168,138.37 |
| 1.利息收入 | | 174,767,691.25 | 132,823,308.05 |
| 其中:存款利息收入 | 6.4.7.11 | 80,826,323.23 | 39,224,549.10 |
| 债券利息收入 | | 49,781,933.71 | 84,732,568.19 |
| 资产支持证券利息收入 | | - | - |
| 买入返售金融资产收入 | | 44,159,434.31 | 8,866,190.76 |
| 其他利息收入 | | - | - |
| 2.投资收益(损失以"-"填列) | | 4,415,325.32 | 17,344,830.32 |
| 其中:股票投资收益 | 6.4.7.12 | - | - |
| 基金投资收益 | | - | - |
| 债券投资收益 | 6.4.7.13 | 4,415,325.32 | 17,344,830.32 |
| 资产支持证券投资收益 | 6.4.7.13.3 | - | - |
| 贵金属投资收益 | 6.4.7.14 | - | - |
| 衍生工具收益 | 6.4.7.15 | - | - |
| 股利收益 | 6.4.7.16 | - | - |
| 3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列) | | - | - |
| 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 | | 22,416,161.26 | 26,917,626.77 |
| 1.管理人报酬 | | 13,778,299.89 | 17,253,686.95 |
| 2.托管费 | | 4,175,242.38 | 5,228,389.95 |
| 3.销售服务费 | | 1,540,382.88 | 1,458,450.62 |
| 4.交易费用 | 6.4.7.17 | 837.30 | 24,530.00 |
| 5.利息支出 | | 2,704,244.53 | 2,738,683.41 |
| 其中:卖出回购金融资产支出 | | 2,704,244.53 | 2,738,683.41 |
| 6.其他费用 | 6.4.7.18 | 217,154.28 | 213,885.84 |
| 三、利润总额(亏损总额以"-"号填列) | | 156,766,855.31 | 123,250,511.60 |
| 减:所得税费用 | | - | - |
| 四、净利润(净亏损以"-"号填列) | | 156,766,855.31 | 123,250,511.60 |

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:天弘现金管家货币市场基金

本报告期:2017年1月1日-2017年6月30日

单位:人民币元

| 项 目 | 本期<br>2017年1月1日-2017年6月30日 | | |
|---|---|---|---|
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益(基金净值) | 3,421,563,167.33 | - | 3,421,563,167.33 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 156,766,855.31 | 156,766,855.31 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列) | 5,967,494,358.67 | - | 5,967,494,358.67 |
| 其中:1.基金申购款 | 41,704,885,966.52 | - | 41,704,885,966.52 |
| 2.基金赎回款 | -35,737,391,607.85 | - | -35,737,391,607.85 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列) | - | -156,766,855.31 | -156,766,855.31 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 9,389,057,526.00 | - | 9,389,057,526.00 |
| 项 目 | 上年度可比期间<br>2016年01月01日-2016年06月30日 | | |
| | 实收基金 | 未分配利润 | 所有者权益合计 |
| 一、期初所有者权益(基金净值) | 7,087,860,896.45 | - | 7,087,860,896.45 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润) | - | 123,250,511.60 | 123,250,511.60 |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列) | -2,043,298,251.82 | - | -2,043,298,251.82 |
| 其中:1.基金申购款 | 32,342,259,515.03 | - | 32,342,259,515.03 |
| 2.基金赎回款 | -34,385,557,766.85 | - | -34,385,557,766.85 |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列) | - | -123,250,511.60 | -123,250,511.60 |
| 五、期末所有者权益(基金净值) | 5,044,562,644.63 | - | 5,044,562,644.63 |

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署:

| | | |
|---|---|---|
| 郭树强<br>——————<br>基金管理人负责人 | 韩海潮<br>——————<br>主管会计工作负责人 | 薄贺龙<br>——————<br>会计机构负责人 |

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

天弘现金管家货币市场基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2012]635号《关于核准天弘现金管家货币市场基金募集的批复》核准,由天弘基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘现金管家货币市场基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集1,234,347,012.51元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2012)第205号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《天弘现金管家货币市场基金基金合同》于2012年6月20日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,234,437,256.97份基金份额,其中认购资金利息折合90,244.46份基金份额。本基金的基金管理人为天弘基金管理有限公司,基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。

根据《天弘现金管家货币市场基金基金合同》、《天弘现金管家货币市场基金招募说明书》、《关于天弘现金管家货币市场基金增设C级基金份额并相应修订基金合同部分条款的公告》、《关于天弘现金管家货币市场基金增设D级基金份额并相应修订基金合同部分条款的公告》和《关于天弘现金管家货币市场基金增设E级基金份额并相应修订基金合同部分条款的公告》的有关规定,本基金根据投资者认(申)购本基金的金额,对投资者持有的基金份额按照不同的费率计提销售服务费用,因此形成不同的基金份额等级。本基金设A级、B级、C级、D级和E级五级基金份额,五级基金份额分别设置基金代码,并单独公布每万份基金净收益和7日年化收益率。投资者可自行选择认(申)购的基金份额等级,不同基金份额等级之间不得相互转换,但根据《天弘现金管家货币市场基金基金合同》约定因申购、赎回而发生基金份额自动升级或者降级的除外。本基金C级、D级和E级基金份额不进行基金份额升降级。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘现金管家货币市场基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为现金、通知存款、短期融资券、1年以内(含1年)的银行定期存款和大额存单、期限在1年以内(含1年)的债券回购、期限在1年以内(含1年)的中央银行票据、剩余期限在397天以内(含397天)的债券、剩余期限在397天以内(含397天)的资产支持证券、剩余期限在397天以内(含397天)的中期票据及中国证监会认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。本基金的业绩比较基准为:七天通知存款利率(税后)。

6.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称"中国基金业协会")颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《天弘现金管家货币市场基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2017年1月1日至2017年6月30日止期间的财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2017年6月30日的财务状况以及2017年1月1日至2017年6月30日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 本报告期所采用的会计政策和会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报告所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 会计差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)于2016年5月1日前,以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起,金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖债券的转让收入免征增值税,对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖债券的差价收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

| 关联方名称 | 与本基金的关系 |
|---|---|
| 天弘基金管理有限公司 | 基金管理人、基金销售机构、基金注册登记机构 |
| 中国邮政储蓄银行股份有限公司("中国邮政储蓄银行") | 基金托管人、基金销售机构 |

注:下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

| 项目 | 本期<br>2017年1月1日-2017年6月30日 | 上年度可比期间<br>2016年01月01日-2016年06月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的管理费 | 13,778,299.89 | 17,253,686.95 |
| 其中:应支付销售机构的客户维护费 | 437,773.78 | 384,772.65 |

注:1. 支付基金管理人天弘基金的管理人报酬按前一日基金资产净值0.33%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×0.33%/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。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

| 项目 | 本期<br>2017年1月1日-2017年6月30日 | 上年度可比期间<br>2016年01月01日-2016年06月30日 |
|---|---|---|
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 4,175,242.38 | 5,228,389.95 |

注:付基金托管人中国邮政储蓄银行的托管费按前一日基金资产净值0.10%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×0.10%/当年天数。

6.4.8.2.3 销售服务费

单位:人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 本期<br>2017年1月1日-2017年6月30日 | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | | | | |
| | 天弘现金管家货币A类 | 天弘现金管家货币B类 | 天弘现金管家货币C类 | 天弘现金管家货币D类 | 天弘现金管家货币E类 | 合计 |
| 天弘基金管理有限公司 | 89,593.66 | 359,698.25 | 91.52 | 42,726.65 | 58,143.10 | 550,253.18 |
| 中国邮政储蓄银行 | 14,996.78 | - | - | - | - | 14,996.78 |
| 合计 | 104,590.44 | 359,698.25 | 91.52 | 42,726.65 | 58,143.10 | 565,249.96 |

单位:人民币元

| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间<br>2016年01月01日-2016年06月30日 | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | 当期发生的基金应支付的销售服务费 | | | | | |
| | 天弘现金管家货币A类 | 天弘现金管家货币B类 | 天弘现金管家货币C类 | 天弘现金管家货币D类 | 天弘现金管家货币E类 | 合计 |
| 天弘基金管理有限公司 | 133,773.90 | 469,344.29 | 61.62 | 13,193.95 | - | 616,373.76 |
| 中国邮政储蓄银行 | 16,694.20 | - | - | - | - | 16,694.20 |
| 合计 | 150,468.10 | 469,344.29 | 61.62 | 13,193.95 | - | 633,067.96 |

注:支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值的约定年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付给天弘基金,再由天弘基金计算并支付给各基金销售机构。A级基金份额、B级基金份额、C级基金份额、D级基金份额和E级基金份额约定的销售服务费年费率分别为0.25%、0.01%、0.20%、0.25%和0.25%。销售服务费的计算公式为:

日销售服务费=前一日基金资产净值×约定年费率/当年天数。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期及上年度可比期间未与关联方进行过银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

A级

本基金本报告期及上年度可比期间无基金管理人运用固有资金投资本基金A级基金份额的情况。

B级

本基金本报告期及上年度可比期间无基金管理人运用固有资金投资本基金B级基金份额的情况。

C级

本基金本报告期及上年度可比期间无基金管理人运用固有资金投资本基金C级基金份额的情况。

D级

本基金本报告期及上年度可比期间无基金管理人运用固有资金投资本基金D级基金份额的情况。

E级

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金E级基金份额的情况。

6.4.8.4.2 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

本基金本报告期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.8.5 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<br>2017年1月1日-2017年6月30日 | | 上年度可比期间<br>2016年01月01日-2016年06月30日 | |
|---|---|---|---|---|
| | 期末余额 | 当期存款利息收入 | 期末余额 | 当期存款利息收入 |
| 中国邮政储蓄银行活期存款 | 11,713,115.03 | 200,695.34 | 157,181,506.00 | 91,459.97 |

注:本基金的银行存款由基金托管人中国邮政储蓄银行保管,按银行同业利率计息。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无其他关联交易事项。

6.4.9 期末(2017年6月30日)本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

6.4.10 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2017年6月30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二层次的余额为4,594,490,600.23元,无属于第一层次或第三层次的余额(2016年12月31日:第二层次628,861,872.10元,无第一或第三层次)。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

本基金本报告期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层级未发生重大变动。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于2017年6月30日,本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2016年12月31日:同)。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债,其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 增值税

根据财政部、国家税务总局于2016年12月21日颁布的财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定:(1) 金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益),不征收增值税;(2) 纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期,不属于金融商品转让;(3) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为,以资管产品管理人为增值税纳税人。上述政策自2016年5月1日起执行。

此外,根据财政部、国家税务总局于2017年1月6日颁布的财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及2017年6月30日颁布的财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定,资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为,暂适用简易计税方法,按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为,未缴纳增值税的,不再缴纳;已缴纳增值税的,已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

### §7 投资组合报告

7.1 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 | 固定收益投资 | 4,594,490,600.23 | 48.91 |
| | 其中:债券 | 4,594,490,600.23 | 48.91 |
| | 资产支持证券 | - | - |
| 2 | 买入返售金融资产 | 1,294,244,741.36 | 13.78 |
| | 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 | 3,411,713,115.03 | 36.32 |
| 4 | 其他各项资产 | 93,521,949.90 | 1.00 |
| 5 | 合计 | 9,393,970,406.52 | 100.00 |

7.2 债券回购融资情况

金额单位:人民币元

| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金资产净值的比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 报告期内债券回购融资余额 | | 1.79 |
| | 其中:买断式回购融资 | | - |
| 序号 | 项目 | 金额 | 占基金资产净值的比例(%) |
| 2 | 报告期末债券回购融资余额 | - | - |
| | 其中:买断式回购融资 | - | - |

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值;对于货币市场基金,只要其投资的市场(如银行间市场)可交易,即可视为交易日。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 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 | 84 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最高值 | 111 |
| 报告期内投资组合平均剩余期限最低值 | 23 |

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

根据本货币市场基金基金合同的约定,其投资组合的平均剩余期限在每个交易日都不得超过120天。本报告期内,本货币市场基金投资组合平均剩余期限未发生超过120天的情况。

7.3.2 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 | 10.67 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 2 | 30天(含)—60天 | 8.31 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 3 | 60天(含)—90天 | 63.92 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 4 | 90天(含)—120天 | 3.30 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| 5 | 120天(含)—397天(含) | 12.86 | - |
| | 其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债 | - | - |
| | 合计 | 99.06 | - |

7.4 报告期内投资组合平均剩余存续期超过240天情况说明

本报告期内,本货币市场基金投资组合平均剩余存续期未发生超过240天的情况。

7.5 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 | 摊余成本 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|
| 1 | 国家债券 | - | - |
| 2 | 央行票据 | - | - |
| 3 | 金融债券 | 868,255,503.14 | 9.25 |
| | 其中:政策性金融债 | 868,255,503.14 | 9.25 |
| 4 | 企业债券 | - | - |
| 5 | 企业短期融资券 | 2,538,681,679.56 | 27.04 |
| 6 | 中期票据 | - | - |
| 7 | 同业存单 | 1,187,553,417.53 | 12.65 |
| 8 | 其他 | - | - |
| 9 | 合计 | 4,594,490,600.23 | 48.93 |
| 10 | 剩余存续期超过397天的浮动利率债券 | - | - |

7.6期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位:人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 债券数量(张) | 摊余成本 | 占基金资产净值比例(%) |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 111709250 | 17浦发银行CD250 | 5,000,000 | 494,714,598.17 | 5.27 |
| 2 | 111714182 | 17江苏银行CD182 | 4,000,000 | 395,754,425.19 | 4.22 |
| 3 | 011756028 | 17中电投SCP014 | 3,000,000 | 299,641,512.33 | 3.19 |
| 4 | 011754089 | 17清控SCP001 | 2,500,000 | 249,962,719.33 | 2.66 |
| 5 | 170204 | 17国开04 | 2,400,000 | 238,640,371.94 | 2.54 |
| 6 | 150417 | 15农发17 | 2,000,000 | 200,042,640.82 | 2.13 |
| 7 | 011760084 | 17苏交通SCP017 | 2,000,000 | 199,973,701.52 | 2.13 |
| 8 | 011751026 | 17中船SCP001 | 2,000,000 | 199,965,123.64 | 2.13 |
| 9 | 011752039 | 17神华SCP001 | 2,000,000 | 199,942,344.29 | 2.13 |
| 10 | 011764057 | 17国电SCP003 | 2,000,000 | 199,728,292.22 | 2.13 |

7.7 "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 | 0 |
| 报告期内偏离度的最高值 | 0.0588% |
| 报告期内偏离度的最低值 | 0.0089% |
| 报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值 | 0.0272% |

注:表内各项数据均按报告期内的交易日统计。

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

本报告期内,本货币市场基金投资组合未发生负偏离度的绝对值达到0.25%的情况。

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

本报告期内,本货币市场基金投资组合未发生正偏离度的绝对值达到0.5%的情况。

7.8 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

7.9 投资组合报告附注

7.9.1 基金计价方法说明

本基金估值采用摊余成本法,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余存续期内按照实际利率法进行摊销,每日计提损益。本基金通过每日计算基金收益并分配的方式,使基金份额净值保持在人民币1.00元。

为了避免采用"摊余成本法"计算的基金资产净值与按市场利率和交易市价计算的基金资产净值发生重大偏离,从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果,基金管理人于每一估值日,采用估值技术,对基金持有的估值对象进行重新评估,即"影子定价"。投资组合的摊余成本与其他可参考公允价值指标产生重大偏离的,应按其他公允指标对组合的账面价值进行调整,调整差额确认为"公允价值变动损益",并按其他公允价值指标进行后续计量。如基金份额净值恢复至1元,可恢复使用摊余成本法估算公允价值。如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的,基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的价格估值。

7.9.2 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

7.9.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | - |
| 2 | 应收证券清算款 | - |
| 3 | 应收利息 | 51,854,570.43 |
| 4 | 应收申购款 | 41,667,379.47 |
| 5 | 其他应收款 | - |
| 6 | 待摊费用 | - |
| 7 | 其他 | - |
| 8 | 合计 | 93,521,949.90 |

7.9.4 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。

### §8 基金份额持有人信息

8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

| 份额级别 | 持有人户数(户) | 户均持有的基金份额 | 持有人结构 | | | |
|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | 机构投资者 | | 个人投资者 | |
| | | | 持有份额 | 占总份额比例 | 持有份额 | 占总份额比例 |
| 天弘现金管家货币A类 | 12,178 | 17,609.92 | 128,310,886.06 | 59.83% | 86,142,677.58 | 40.17% |
| 天弘现金管家货币B类 | 109 | 72,322,168.01 | 7,863,076,132.11 | 99.75% | 20,040,181.24 | 0.25% |
| 天弘现金管家货币C类 | 28,944 | 20,048.52 | 15,976,922.10 | 2.75% | 564,307,311.05 | 97.25% |
| 天弘现金管家货币D类 | 23,500 | 12,697.56 | 391,078.07 | 0.13% | 298,001,502.61 | 99.87% |
| 天弘现金管家货币E类 | 15,789 | 26,145.47 | 364,632.36 | 0.09% | 412,446,202.82 | 99.91% |
| 合计 | 80,520 | 116,605.28 | 8,008,119,650.70 | 85.29% | 1,380,937,875.30 | 14.71% |

注:机构/个人投资者持有基金份额占总份额比例的计算中,针对A、B、C、D、E类分级基金,比例的分母采用A、B、C、D、E类各自级别的份额;对合计数,比例的分母采用A、B、C、D、E类分级基金份额的合计数(即期末基金份额总额)。

8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

| 项目 | 份额级别 | 持有份额总数(份) | 占基金总份额比例 |
|---|---|---|---|
| 基金管理公司所有从业人员持有本基金 | 天弘现金管家货币A类 | 255,968.80 | 0.12% |
| | 天弘现金管家货币B类 | - | - |
| | 天弘现金管家货币C类 | 149.87 | 0.00% |
| | 天弘现金管家货币D类 | 159,703.89 | 0.05% |
| | 天弘现金管家货币E类 | 4,287,331.80 | 1.04% |
| | 合计 | 4,703,154.36 | 0.05% |

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

| 项目 | 份额级别 | 持有基金份额总量的数量区间(万份) |
|---|---|---|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金 | 天弘现金管家货币A类 | 0 |
| | 天弘现金管家货币B类 | 0 |
| | 天弘现金管家货币C类 | 0 |
| | 天弘现金管家货币D类 | 0 |
| | 天弘现金管家货币E类 | >100 |
| | 合计 | >100 |
| 本基金基金经理持有本开放式基金 | 天弘现金管家货币A类 | 0 |
| | 天弘现金管家货币B类 | 0 |
| | 天弘现金管家货币C类 | 0 |
| | 天弘现金管家货币D类 | 0 |
| | 天弘现金管家货币E类 | 0 |
| | 合计 | 0 |

### §9 开放式基金份额变动

单位:份

| | 天弘现金管家货币A类 | 天弘现金管家货币B类 | 天弘现金管家货币C类 | 天弘现金管家货币D类 | 天弘现金管家货币E类 |
|---|---|---|---|---|---|
| 基金合同生效日(2012年6月20日)基金份额总额 | 576,166,940.77 | 658,270,316.20 | - | - | - |
| 本报告期期初基金份额总额 | 115,127,662.80 | 2,570,272,809.58 | 514,486,778.86 | 197,317,526.01 | 24,358,390.08 |
| 本报告期基金总申购份额 | 532,314,991.22 | 36,155,624,209.17 | 2,884,038,373.14 | 1,493,069,459.37 | 639,838,933.62 |
| 减:本报告期基金总赎回份额 | 432,989,090.38 | 30,842,780,705.40 | 2,818,240,918.85 | 1,391,994,404.70 | 251,386,488.52 |
| 本报告期基金拆分变动份额 | - | - | - | - | - |
| 本报告期期末基金份额总额 | 214,453,563.64 | 7,883,116,313.35 | 580,284,233.15 | 298,392,580.68 | 412,810,835.18 |

注:总申购份额含红利再投、分级调整转入及转换转入份额;总赎回份额含分级调整转出及转换转出份额。

### §10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内,熊军先生已任职本公司副总经理职务,具体信息请参见基金管理人于2017年4月26日披露的《天弘基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略没有改变。

10.5 基金改聘会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生变化。

10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况

本报告期内管理人、托管人及其高级管理人员没有发生受稽查或处罚的情况。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

1、本基金本报告期未使用租用的证券公司交易单元进行相关交易。

2、基金专用交易单元的选择标准为:该证券经营机构财务状况良好,各项财务指标显示公司经营状况稳定;经营行为规范,内控制度健全,最近两年未因重大违规行为受到监管机关的处罚;研究实力较强,能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务,包括宏观经济报告、市场分析报告、行业研究报告、个股分析报告及全面的信息服务。

3、基金专用交易单元的选择程序:本基金管理人根据上述标准进行考察后,确定选用交易席位的证券经营机构。然后基金管理人和被选用的证券经营机构签订交易席位租用协议。

4、本基金报告期内新租用的证券公司交易单元情况:无。

5、本基金报告期内停止租用的证券公司交易单元情况:无。

10.8 偏离度绝对值超过0.5%的情况

本基金本报告期内未出现偏离度绝对值超过0.5%的情况。

### §11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 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。

11.2 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。

天弘基金管理有限公司
二〇一七年八月二十八日