天弘中证环保产业指数型发起式证券投资基金 2018年半年度报告摘要

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
送出日期:2018年08月27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。

基金托管人广发证券股份有限公司根据本基金合同规定,于2018年8月23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2018年1月1日起至2018年6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	天弘中证环保产业	
基金主代码	001590	
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16日	
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	
报告期末基金份额总额	67,595,727.79份	
基金合同存续期	不定期	
下属两级基金的基金简称	天弘中证环保产业A	天弘中证环保产业C
下属两级基金的交易代码	001590	001591
报告期末下属两级基金的份额总额	25,713,031.98份	41,882,695.81份

2.2 基金产品说明

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	中证环保产业指数收益率×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。

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	广发证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	童建林	崔瑞娟
	联系电话	022-83310208	020-87555888
	电子邮箱	service@thfund.com.cn	cuirj@gf.com.cn
客户服务电话		95046	95575
传真		022-83305569	020-87555129

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

单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期(2018年01月01日-2018年06月30日)	
	天弘中证环保产业A	天弘中证环保产业C
本期已实现收益	-2,996,281.02	-5,325,982.28
本期利润	-6,143,687.96	-11,735,748.46
加权平均基金份额本期利润	-0.1889	-0.1846
本期基金份额净值增长率	-22.42%	-22.53%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2018年06月30日)	
期末可供分配基金份额利润	-0.3766	-0.3817
期末基金资产净值	16,030,157.26	25,897,597.02
期末基金份额净值	0.6234	0.6183

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(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。

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。

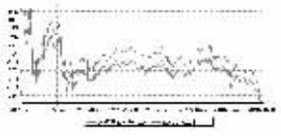
3.2 基金净值表现

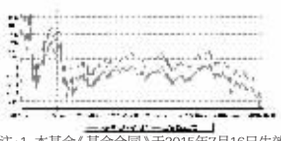
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段(天弘中证环保产业A)	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	-10.42%	1.46%	-10.15%	1.47%	-0.27%	-0.01%
过去三个月	-17.98%	1.14%	-17.96%	1.14%	-0.02%	0.00%
过去六个月	-22.42%	1.24%	-22.44%	1.24%	0.02%	0.00%
过去一年	-21.72%	1.11%	-21.72%	1.11%	0.00%	0.00%
自基金合同生效日起至今	-37.66%	1.67%	-32.12%	1.71%	-5.54%	-0.04%
阶段(天弘中证环保产业C)	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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
过去一个月	-10.44%	1.46%	-10.15%	1.47%	-0.29%	-0.01%
过去三个月	-18.04%	1.14%	-17.96%	1.14%	-0.08%	0.00%
过去六个月	-22.53%	1.24%	-22.44%	1.24%	-0.09%	0.00%
过去一年	-21.92%	1.11%	-21.72%	1.11%	-0.20%	0.00%
自基金合同生效日起至今	-38.17%	1.68%	-32.12%	1.71%	-6.05%	-0.03%

注:本基金投资组合的业绩比较基准为:中证环保产业指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。中证环保产业指数是根据联合国环境与经济综合核算体系对于环保产业的界定方法,将符合资源管理、清洁技术和产品、污染管理的公司纳入环保产业主题,采用等权重加权方式,反映上海和深圳市场环保产业公司表现的指数。本基金投资于股票的资产比例不低于基金资产的90%,投资于中证环保产业指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的80%;本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。

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《基金合同》于2015年7月16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、深圳、四川设有分公司。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2018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、天弘文化新兴产业股票型证券投资基金、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、天弘安康颐养混合型证券投资基金(原"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、天弘医疗健康混合型证券投资基金(原"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、天弘量化驱动股票型证券投资基金(原"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、天弘证券行业指数型发起式证券投资基金、天弘证券公司指数型发起式证券投资基金、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、天弘策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、天弘优选债券型证券投资基金、天弘尊享定期开放债券型发起式证券投资基金、天弘悦享定期开放债券型发起式证券投资基金、天弘荣享定期开放债券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		
张子法	本基金基金经理。	2017年04月	-	16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。
陈瑶	本基金基金经理。	2018年02月	-	7年	女,金融学硕士。2011年7月加盟本公司,历任交易员、交易主管、从事交易管理,程序化交易策略、基差交易策略、融资融券交易策略等研究工作。

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和对独立性的同时,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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2018年上半年,在去杠杆的宏观背景下,信用环境收缩叠加海外经济、贸易摩擦的不确定性,股票市场回落。报告期内,本基金在运作过程中严格遵守基金合同,完全复制标的指数,进行被动指数化投资,保证基金净值增长率与基准指数的高度正相关和跟踪误差最小化。

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。本基金秉承合规第一、风控第一的原则,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,对指数基金采取被动复制与组合优化相结合的方式跟踪指数。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2018年6月30日,天弘中证环保产业A基金份额净值为0.6234元,天弘中证环保产业C基金份额净值为0.6183元。报告期内份额净值增长率天弘中证环保产业A为-22.42%,天弘中证环保产业C为-22.53%,同期业绩比较基准增长率均为-22.44%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

截至本报告期末2018年6月30日,本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

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2018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一层次的余额为27,089,650.45元,属于第二层次的余额为12,135,641.86元,无属于第三层次的余额(2017年12月31日:第一层次34,282,856.98元,第二层次1,261,244.16元,无属于第三层次的余额)。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券,若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况,本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次;并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度,确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(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2018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(2017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)除公允价值外,截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§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	权益投资	39,225,292.31	79.07
	其中:股票	39,225,292.31	79.07
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	5,414,499.67	10.91
8	其他资产	4,969,070.24	10.02
9	合计	49,608,862.22	100.00

7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

7.2.1 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	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	25,199,151.33	60.10
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	4,623,632.30	11.03
E	建筑业	3,652,855.30	8.71
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	1,037,099.93	2.47
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	4,097,560.99	9.77
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	328,040.00	0.78
	合计	38,938,339.85	92.87

7.2.2 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	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	626.28	0.00
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	286,336.18	0.68
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	-	-
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	286,962.46	0.68

注:由于指数成份股调整,上表所列示股票中,*ST凯迪(证券代码:000939)被调出成份股后停牌,故以积极投资股票列示(下同)。

7.3 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

7.3.1 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	占基金资产净值比例(%)
1	000711	京蓝科技	112,080	952,680.00	2.27
2	000967	盈峰环境	92,913	808,343.10	1.93
3	002256	兆新股份	171,200	773,824.00	1.85
4	002610	爱康科技	364,516	765,483.60	1.83
5	600217	中再资环	151,000	723,290.00	1.73
6	601727	上海电气	126,400	692,672.00	1.65
7	300118	东方日升	62,640	676,512.00	1.61
8	002665	首航节能	114,489	664,036.20	1.58
9	002431	棕榈股份	93,352	626,391.92	1.49
10	002121	科陆电子	96,100	623,689.00	1.49

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于本公司网站的半年度报告正文。

7.3.2 期末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	占基金资产净值比例(%)
1	000939	*ST凯迪	57,382	286,336.18	0.68
2	002408	齐翔腾达	51	626.28	0.00

注:投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细,应阅读登载于本公司网站的半年度报告正文。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	300070	碧水源	1,070,164.00	2.81
2	300296	利亚德	1,058,845.00	2.78
3	600388	龙净环保	1,049,270.95	2.76
4	002672	东江环保	1,038,796.00	2.73
5	000711	京蓝科技	1,036,175.00	2.73
6	000826	启迪桑德	1,027,332.00	2.70
7	600703	三安光电	1,010,925.00	2.66
8	300072	三聚环保	987,486.00	2.60
9	300203	聚光科技	946,749.00	2.49
10	002372	伟星新材	854,630.24	2.25
11	600406	国电南瑞	835,749.05	2.20
12	600651	飞乐音响	816,182.34	2.15
13	600217	中再资环	789,668.00	2.08
14	603568	伟明环保	779,561.00	2.05
15	300355	蒙草生态	769,490.00	2.02
16	603859	瑞泰来	768,197.00	2.02
17	002080	中材科技	765,181.25	2.01
18	603515	欧普照明	758,693.84	2.00
19	002663	普邦股份	757,834.72	1.99
20	002717	岭南股份	757,462.00	1.99

注:本项的"买入金额"均按买入成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002372	伟星新材	1,104,494.10	2.90
2	300296	利亚德	1,016,234.24	2.67
3	002672	东江环保	1,015,008.26	2.67
4	002408	齐翔腾达	981,837.00	2.58
5	300070	碧水源	923,628.00	2.43
6	002506	协鑫集成	908,963.00	2.39
7	603515	欧普照明	895,050.00	2.35
8	600388	龙净环保	893,330.00	2.35
9	600590	泰豪科技	854,840.04	2.25
10	600481	双良节能	844,098.10	2.22
11	603568	伟明环保	828,963.00	2.18
12	000826	启迪桑德	799,829.95	2.10
13	600894	广日股份	799,585.00	2.10
14	600703	三安光电	783,486.00	2.06
15	300203	聚光科技	767,760.00	2.02
16	600406	国电南瑞	758,155.08	1.99
17	603063	禾望电气	753,221.00	1.98
18	000875	吉电股份	750,916.00	1.97
19	002341	新纶科技	728,559.00	1.92
20	600900	长江电力	711,698.00	1.87

注:本项"卖出金额"均按卖出成交金额(成交单价乘以成交数量)填列,不考虑相关交易费用。

7.5 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。

7.6 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。

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 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。

7.11 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。

7.12 本报告期投资基金情况

本基金本报告期末未持有基金。

7.13 投资组合报告附注

7.13.1 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。

7.13.2 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。

7.13.3 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	53,766.55
2	应收证券清算款	4,914,026.91
3	应收股利	-
4	应收利息	1,276.78
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,969,070.24

7.13.4 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。

7.13.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

7.13.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

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	000711	京蓝科技	952,680.00	2.27	重大事项
2	000967	盈峰环境	808,343.10	1.93	重大资产重组
3	002256	兆新股份	773,824.00	1.85	重大事项
4	002610	爱康科技	765,483.60	1.83	重大事项
5	600217	中再资环	723,290.00	1.73	重大资产重组
6	601727	上海电气	692,672.00	1.65	拟筹划重大资产重组
7	300118	东方日升	676,512.00	1.61	重大资产重组
8	002665	首航节能	664,036.20	1.58	重大资产重组
9	002431	棕榈股份	626,391.92	1.49	重大事项
10	002121	科陆电子	623,689.00	1.49	拟披露重大事项

7.13.5.2 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	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	000939	*ST凯迪	286,336.18	0.68	实行退市风险警示公告
2	002408	齐翔腾达	626.28	0.00	重大资产重组

7.13.6 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。

§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
天弘中证环保产业A	9,283	2,769.91	5,000,000.00	19.45%	20,713,031.98	80.55%
天弘中证环保产业C	9,787	4,279.42	5,000,000.00	11.94%	36,882,695.81	88.06%
合计	19,070	3,544.61	10,000,000.00	14.79%	57,595,727.79	85.21%

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、C类分级基金,比例的分母采用A、C类各自级别的份额;对合计数,比例的分母采用A、C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开放式基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本开放式基金	天弘中证环保产业A	775.95	0.00%
	天弘中证环保产业C	138,494.63	0.33%
	合计	139,270.58	0.21%

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	天弘中证环保产业A	0
	天弘中证环保产业C	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	天弘中证环保产业A	0
	天弘中证环保产业C	0
	合计	0

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

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	14.79%	10,000,000.00	14.79%	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	14.79%	10,000,000.00	14.79%	

注:本基金成立后有10,000,000.00份为发起份额,发起份额承诺的持有期限为2015年07月16日至2018 年07月16日。

§9 开放式基金份额变动

单位:份

	天弘中证环保产业A	天弘中证环保产业C
基金合同生效日(2015年07月16日)基金份额总额	5,000,000.00	5,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	23,692,278.25	23,788,395.14
本报告期基金总申购份额	36,199,031.44	202,408,516.92
减:本报告期基金总赎回份额	34,178,277.71	184,314,216.25
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	25,713,031.98	41,882,695.81

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。

§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

本报告期内本基金的基金管理人和基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

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 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

本报告期内本基金未持有基金。

10.6 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。

10.7 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

本报告期内本基金管理人、托管人及其高级管理人员没有发生受稽查或处罚的情况。

10.8 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占股票成交总额比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
广发证券	2	124,025,081.58	100.00%	28,686.51	100.00%	

注:1、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。

2、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。

3、本基金报告期内新租用交易单元:无。

4、本基金报告期内停止租用交易单元:无。

§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

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	2018/01/01-2018/01/09	10,000,000.00	-	-	10,000,000.00	14.79%
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