

天弘现金管家货币市场基金 2018年半年度报告摘要

2018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;2018年8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、误导性陈述成重大遗漏,并对其内容的填实性。确确性和定整性采担作则及违带的法律责任。本半年度报告已经5分之以上社业董事等全师遗,并由董事长鉴发。基金任管人中国邮政结常银行股份有限公司根据本基金合同规定,于 2018 年 8 月 23 日复核下本报告中的财务指定,净往衰艰,到别念情况,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 天弘基金管理 天弘基金管理

盈利。 基金的过住业编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 读本基金的招票设制书及其更新。 本半年度报告摛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

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

支资策略

2.4 信息披露方:

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	6,938,516,990.63 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	天弘現金 管家货币 B 类	天弘現金管 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	566,195, 5,191,018, 782,231, 328,143, 70,928,605.03 374,38 (f) 356,01 (f) 236,89 (f) 418,32 (f) (f)				

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 收益和风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。 险收益特征 2.3 基金管理人和基金托 天弘基金管理有限公司 息披露负责人

www.thfund.com.cn 基金管理人及基金托管 § 3 主要财务指标和基金净值表

3.1.1 期间数据和指标 152,576 770.33 14,806, 003.12 6,526 104.74 5,162,132. 期利润 152,576 770.3 14,806, 003.12 6,526 104.74 2.0003% 2.0254% 3.1.2 期末数据和指标 782,231, 236.89 朝末基金资产净值 566.195.374.38

、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

的金額相等。
3、本基金的利润分配是按日结转份额。
4、本基金的利润分配是按日结转份额。
4、本基金产2014年10月15日起增加天弘观金管家货币 C 类基金份额。于 2015年5月5日起增加灭现现金管家货币 D 类基金份额。于 2016年7月14日起增加灭机聚金管家货币 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储比较基准收益率的比较。
(1) 天弘观金管家货币 A 类基金份额净值收益率及其与同期业储比较基准收益率的比

阶段 (天弘现金管家货币 A 类)	份额净值 收益率①	份額净值 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	0.4147%	0.0078%	0.1126%	0.0000%	0.3021%	0.0078%
过去三个月	1.0318%	0.0053%	0.3418%	0.0000%	0.6900%	0.0053%
过去六个月	2.0003%	0.0044%	0.6810%	0.0000%	1.3193%	0.00449
过去一年	3.9418%	0.0034%	1.3781%	0.0000%	2.5637%	0.00349
过去三年	9.3689%	0.0038%	4.1955%	0.0000%	5.1734%	0.00389
自基金合同生效日起至今	22.7139%	0.0065%	8.6098%	0.0000%	14.1041%	0.0065%

阶段 天弘现金管家货币B类 1.4405% 0.0044%

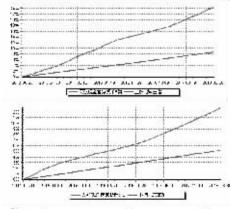
阶段 (天弘現金管家货币 C 类)	份额净值收益率①	份額净值 收益率标 准差②	业绩比较 基准收益 率③	业绩比较 基准收益 率标准差 ④	①-③	2-4
过去一个月	0.4184%	0.0078%	0.1126%	0.0000%	0.3058%	0.0078%
过去三个月	1.0441%	0.0053%	0.3418%	0.0000%	0.7023%	0.0053%
过去六个月	2.0254%	0.0044%	0.6810%	0.0000%	1.3444%	0.0044%
过去一年	3.9933%	0.0034%	1.3781%	0.0000%	2.6152%	0.0034%
过去三年	9.5348%	0.0038%	4.1955%	0.0000%	5.3393%	0.0038%
自C级份额生效日起至今	12.7460%	0.0052%	5.1927%	0.0000%	7.5533%	0.0052%
(4) 天弘现金管家货	币 D 类基金	· 份额净值W	Z 益率及其4	与同期业绩	比较基准收	益率的比
EA ISL	2/3 don 10s All	份额净值	业绩比较	业绩比较		

阶段 (天弘現金管家货币 D 类)	份额净值 收益率①	收益率标 准差②	基准收益率(3)	基准收益 率标准差 ④	①-③	2-4
过去一个月	0.4142%	0.0078%	0.1126%	0.0000%	0.3016%	0.0078%
过去三个月	1.0315%	0.0053%	0.3418%	0.0000%	0.6897%	0.0053%
过去六个月	2.0000%	0.0044%	0.6810%	0.0000%	1.3190%	0.0044%
过去一年	3.9412%	0.0034%	1.3781%	0.0000%	2.5631%	0.0034%
过去三年	9.3724%	0.0038%	4.1955%	0.0000%	5.1769%	0.00389
自 D 级份额生效日起至今	9.9419%	0.0039%	4.4107%	0.0000%	5.5312%	0.0039%
(5) 天弘现金管家货 较	币E类基金	份额净值的	Z益率及其4	与同期业绩	比较基准收	益率的比
阶段(天弘現金管家货币E	份额净值	份額净值 政益率标	业绩比较	业绩比较 基准收益	(T)=(3)	2-4

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,本基金法取同期上天通知存款利率(税后)作为本基金的业绩比较基准。 2.本基金于2014年10月15日起增加天宏现金管家货币 C表基金份额,于2015年5 月5日起增加天弘现金管家货币 D 英基金份额,于2016年7月14日起增加天弘现金管家

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





DONN'S MIN NO E GENE ED NOS E MINGRE E PAGE MIN HE ENGLO —**▼**2577871.0 — 60007#

AAAR TION WORK DIGHT DIGHT TACK

-75015730×-180461

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。 本报告期内,本基金共进行利润分配 181.805.972.09 元。 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

§ 5 托管人报告

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、

§ 6 半年度财务会计报告(未经审计) 6.1 资产负债表

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 20 日起办理该资份额的申购和赎回业务。 3. 本基金于 2015 年 5 月 5 日息增加天弘现金管家货币 D 类基金份额,并于 2015 年 5 月 6 报告截止日:2018年6月30日

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

天弘 基金管理有關公司(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

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、5

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、天弘云端生活优造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

起八世分长贝德金、(公如中世代村)有权至及起八世分长贝德金、(公如田建校有权至及起八世分长 货基金、天弘中市高端整条制着指数型发起式证券投资基金、天弘上中市高端整条制式证券投资基金、 货基金、天弘中市 100 指数型发起式证券投资基金、天弘中市 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

证信品饮料指数型发起式证券投资基金、天弘、冠宣货币市场基金、天弘、裕利灵活配置混合型证 券投资基金、天弘、军保本混合型证券投资基金、天弘、价值精造灵活配置混合型及起式证券投资

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

说明

天弘荣享定期开放债券型发起式证券投资基金。

职务

姓名

李晨

持有人谋求最大利益。

为日常监控和分析评估体系等。

情况良好,未出现异常情况。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

2012年 8 月

2016年 11 月

注:1、上述任职日期为本基金管理人对外披露的任职日期。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

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

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

定,拟定相应的监控、分析和防控措施。

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

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。

46 管理人对报告期内其全估信程序等事项的说明

理、基金会计、风险管理人员及内控合规人员组成。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本报告期内本基金管理人无应说明预警信息。

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况亩昭

额持有人(该收益参与下一日的收益分配)。

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

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。

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。

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

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

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

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

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

本报告期内 未用现违反公平交易制度的情况 公司施下各基金不存在因非公平交易签导致

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

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

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

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

2018年上半年,名义经济增速从去年的高位有所回落,以基建为代表的投资需求出现明显

下行,但是生产层面明显强于需求,微观高频数据和商品价格表现仍然较强;通胀方面,**1 季**度

PPI 同比出现快速回落,2季度由于工业品价格反弹,叠加去年同期蒸数偏低,PPI 同比出现反

强 但 CPI 增速由于食品价格表现低迷 险 2 月由于森节错位因素达到 2 9%之外 其他月份均在 2%左右,通胀压力不大。政策而方面,政策有所调整,以缓解信用紧缩格局,货币政策维护流动性

合理充裕。资金面方面,年初以来资金面状况较去年年末明显缓解,4月末降准之后出现显著收

紧,但除此之外资金面整体较为宽松。债市方面,年初债券市场由于海外利率快速上行、监管政策 频出引发悲观预期,收益率出现一波快速上行,此后由于资金面稳定趋松,收益率逐步下行,3月

份中美贸易战发酵,带动国内避险情绪上升,收益率出现一波较大幅度的下行,4月18日,央行 降准导致债券收益率快速下行,但此后资金面出现超预期显著收紧,收益率明显回调,此后长端 大体处于震荡态势。进入6月份之后,由于金融数据不及预期、经济数据表现欠佳,收益率继续下

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

截至 2018 年 6 月 30 日,天弘现金管家货币 A 类份额净值收益率 2.0003%,天弘现金管家

展望 2018 年下半年, 预计经济增长将延续放缓态势, 基本面对于借市有一定的利好效应, 但

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,

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

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。

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

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

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

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

货币 B 类份额净值收益率 2.1215%, 天弘现金管家货币 C 类份额净值收益率 2.0254%, 天弘现

金管家货币 D 类份额净值收益率 2.0000%, 天弘现金管家货币 E 类份额净值收益率 1.9982%,

素。结合产品用户结构、申购赎回频率特点,以及与市场资金面同向性较强的特点,季度初缩短久 期,季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稳健的收

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

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。

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

41 基金管理人及基金经理情况

7蒙古君正能源化工集团股份有限公司 新疆天瑞博丰股权投资合伙企业(有限合伙

新疆天聚宸兴股权投资合伙企业(有限合伙

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

资产	附注号	本期末 2018年 6 月 30 日	上年度末 2017年 12 月 31 日
资产:			
银行存款	6.4.7.1	1,801,461,943.56	2,718,332,702.07
结算备付金			_
存出保证金		12,392.80	2,836.36
交易性金融资产	6.4.7.2	5,111,128,630.12	4,878,399,840.57
其中:股票投资		-	_
基金投资		-	_
债券投资		5,111,128,630.12	4,878,399,840.57
资产支持证券投资		-	_
贵金属投资		-	_
衍生金融资产	6.4.7.3	-	_
买人返售金融资产	6.4.7.4	1,039,582,319.37	3,552,586,772.63
应收证券清算款		-	_
应收利息	6.4.7.5	26,837,845.83	45,616,481.40
应收股利		-	
应收申购款		211,650,541.72	19,697,240.29
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		8,190,673,673.40	11,214,635,873.32
负债和所有者权益	附注号	本期末 2018年 6 月 30 日	上年度末 2017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		1,247,998,856.00	1,000,081,779.89
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		2,288,129.36	3,200,032.3
应付托管费		693,372.56	969,706.78
应付销售服务费		314,929.11	363,209.4
应付交易费用	6.4.7.7	163,429.76	213,951.29
应交税费		211,191.12	-
应付利息		244,708.40	441,492.99
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	242,066.46	462,000.00
负债合计		1,252,156,682.77	1,005,732,172.73
所有者权益:			
实收基金	6.4.7.9	6,938,516,990.63	10,208,903,700.59
未分配利润	6.4.7.10	-	_
所有者权益合计		6,938,516,990.63	10,208,903,700.59
负债和所有者权益总计		8,190,673,673.40	11,214,635,873.33

挂报告截止日2018年6月30日,基金份額冷值1,0000元,天见现金管家货币市场基金份额总额6,5936,516,990.63 份,其中天弘观金管货货币市场基金人数基金份额的份额总额为566,195,374.38 份,天弘观金管家货币市场基金份额的份额总额为56,016 份,天 弘观金管家货币市场基金 区 级基金份额的份额总额为782,231,238.89 份,天弘观金管家货币市场基金 区 级基金份额的份额总额为782,231,238.89 份,天弘观金管家货币市场 是金管家货币市场基金 C 級基金份額的份額总額为 782,231,236.88 份, 天弘現金管家货币市 基金 D 級基金份額的份額总額为 328,143,418.32 份, 天弘現金管家货币市场基金 E 級基金份 9份額总額为 70,928,605.03 份。 6.2 利润表 会计主体, 宋弘現金管家货币市场基金 本招告期,2018 年 1 月 1 日 -2018 年 6 月 30 日 每份 4 基本等

項目	附注号	本期 2018年1月1日-2018 年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日-2017年6 月30日
一、收人		210,331,036.47	179,183,016.57
1.利息收入		205,025,280.13	174,767,691.25
其中:存款利息收入	6.4.7.11	43,495,767.29	80,826,323.23
债券利息收人		116,036,593.40	49,781,933.71
资产支持证券利息收入		-	-
买人返售金融资产收入		45,492,919.44	44,159,434.31
其他利息收人		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		5,305,756.34	4,415,325.32
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	5,305,756.34	4,415,325.32
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	-	-

4,415,325.32 4,415,325.3 衍生工具收益 28,525,064 22,416,161. 1,998,300 1,540,382.8 2,704,244.5 156,766,855.31 6.3 所有者权益(基金净值)变过

項目	本期 2018年1月1日-2018年6月30日				
柳日	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)	10,208,903,700.59	-	10,208,903,700.59		
二、本期经营活动产生的基金净值 变动数(本期利润)	-	181,805,972.09	181,805,972.09		
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)	-3,270,386,709.96	-	-3,270,386,709.96		
其中:1.基金申购款	34,009,958,415.62	-	34,009,958,415.62		
2.基金赎回款	-37,280,345,125.58	-	-37,280,345,125.58		
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)	-	-181,805,972.09	-181,805,972.09		
五、期末所有者权益 (基金净值)	6,938,516,990.63	-	6,938,516,990.63		
項目	2017	上年度可比期间 F1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、本期基金份額交易产生的基金 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		

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: 主管会计工作负责人

. 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")证监管可[2012/835 号(关于核准天弘明金曾家货币市场监金等条份批准)核准,由天 弘基金曾理有限公司依照(中华人民共和国证券投资基金法和(天弘明金曾家货币市场基金基 金台司负商金子序纂集、基金多为契约至扩张法施。存款同联化定,请农议立募集不包括认购资 金利息共募集 1,234,347,012.5 元,业经普华永迪中天会计师申务所有限公司曾华永迪中天验 子(2012)第205 号验贷报号于业验证。经时中国证监会各案(天公现金曾家货币市场基金基金 2012]邦 205 亏難資报告予以验证。经向中国证监会备案、(天弘现金管家货币市场基金基金 助于 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 劳爾、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 5 司 基金任意人为由国城政基础与组队公司

是政策面方面,财政政策更加积极,对经济的下行形成对冲,需要关注积极财政政策对经济的拉

6.4.公宣计报表的编制态面 未基金的财务报差按照财效部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则一基 规则》各项具体会计准则及相关规定(以下合称"企业会计准则")。中国证金信赖市的(证券投 金信息披露,招配,模取第3分件度报告》),中国证券投资基金、验金信息 "中国基金业协会"则而的(证券投资基金会计核赛业务指引)、(天弘观金管家货币市场基金企合国利在营务报费指令报费准备。

基金合同) 新定财务报表附注 6.44 所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及 产的基金行业实务操作编制。 6.4.3 遗赠企业会计准则及其他有关规定的声明 本财务报表以持续运营为基础编制。 6.4.3 遗赠企业会计准则及其他有关规定的声明 再集、完整地反映了本基金 2018 年6月 30 日也期间的财务报表符合企业会计准则的要 再集、完整地反映了本基金 2018 年6月 30 日的财务状况以及 2018 年 1月 1 日至 2018 年6 30 日止期间的监营成果和基金净值变或情况等有关全质。 6.4.4 本报告期所采用的会计政策和会计估计均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、会计估计均最近一期年度会计报告所采用的 计发策 会计估计一致。 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 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

放策、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。

抵減。 对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免证增值税,对围储,地方政府 信以及金融同业往来利息收入亦免证增值税。资管产品管理人运营资管产品提供的贷款服务,以 2018年1月1日起产生的利息及和急胜域的收入为销售额。 (b)对基金处证券市场中取得的收入、包括买卖股票、债券的差价收入,股票的股息,红利收入,债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。 (c)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和代量 20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在1个月以内(合1个月)

20%的扩入所特权。对金金从上市公司取休的股息红利所待。持收制股往 1 个月以外(省 1 个月)的 "就是是看到所得金额计入应转股前接有"新进投股期股往 1 个月以上 至 1 年(名 1 年)的 "富城长50%计人应转股所得额;持股期股租过 1 年的,就免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限借股,就等后取得的股息。红河收,按据上还搬定计算纳税,持股时间日解第日起计算,解禁商取得的股息。红河收入接限上还搬定计算纳税,持股时间目解第日起计算,解禁商业将的股息。红河收入继续暂减按 50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用 20%的税率计证 人为库组税

所得税。 (d) 基金卖出股票按 0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买人股票不征收股票交易印花税。 (e) 本基金分别按实际缴纳的增值税额的 7%、3%。2%和 1%缴纳城市维护建设税,教育费附 地方教育附加和防洪工程维护费。 地方教育的加州的成立性地デザ。 6.4.7 美联方关系 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

6.4.7.1 年取日前行住任制天东城未形里人利吉大东的天东乃及王文 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 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 天弘基金管理有限公司 基金管理人、基金销售机构、基金注 中国邮政储蓄银行股份有限公司 基金托管人、基金销售机 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。

6.4.8.1 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。

平世:八匹田元		
项目	本期 2018年1月1日-2018年6月30日	上年度可比期间 2017年1月1日-2017年6月30日
当期发生的基金应支付的 管理费	14,580,293.59	13,778,299.89
其中:应支付销售机构的客 户维护费	786,899.52	437,773.78
		报酬按前一日基金资产净值 0.33
的年费率计提 逐日累计3	百每月月底 按月支付, 其计算公式	一、一、一、一、一、一、一、一、一、一、一、一、一、一、一、一、一、一、一、

16年以上176%。在日本日主程7万地。次月末日。次月末日次;日日在大阪駅一面 日盛並川 春館×0.387分。当年天教。 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机构的定的农据销售机构销售 基金的保有基程。全比例的客户维护费,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

6.4.8.2.2 基金托管费

顶目	本期	上年度可比期间	
49. E3	2018年1月1日-2018年6月30日	2017年1月1日-2017年6月30日	
当期发生的基金应支付的 托管费	4,418,270.77	4,175,242.38	
注:支付基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公	司的托管费按前一日基金资产净	伯
	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	. 0		
6.4.8.2.3 销售服务费			
单位 人民币元			

本期 2018年1月1日-2018年6月30日 627,571.2 中国邮政储蓄银 股份有限公司 17,451.49 17,454.

弘基金管理有 42,726.6 550,253

日销售服务费=前一日基金资产净值×约定年费率/当年5 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

		4.90				
	2018年	1月1日-20	18年6月30	日		
银行间市场交易的	债券交	债券交易金额		基金逆回购		E回购
各关联方名称	基金买人	基金卖出	交易金額	利息收入	交易金額	利息支出
中国邮政储蓄银行股份有 限公司	-	-	-	-	740,096, 000.00	96,940.14
	2017年	上年度可b 1月1日-20	七期间 117年6月30	В		
银行间市场交易的	银行间市场交易的 债券交易金额 基金逆回购 基金正回购				E回购	
各关联方名称	基金买人	基金卖出	交易金額	利息收入	交易金額	利息支出
中国邮政储蓄银行股份有 限公司	-	-	-	-	-	-
0 4 0 4 Ar 34 mt -> - 4rt 34r	-b-4t-A-46-13	1971				

64.8.4 答关联方投资本基金的情况 64.8.4 1报告期內基金管理、运用固有资金投资本基金的情况 本基金末程与期及上年度工作则和无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。 64.8.4 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 未基金末程与期末及上年度来添基金管理人之外的生使关联方投资本基金的情况。 64.8.5 由来联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入 级价、人民币法

本期 2018年1月1日-2018年6月30日 上年度可比期间 2017年1月1日-2017年6月30日 233,014.62 11,713,115.03 存款由基金托管人 中国邮政储蓄银

截至本报告期末 2018 年 6 月 30 日止, 本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出

购证券款余者 金额单位:		856.00 元,是以	以如下债券作为	抵押:	
债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单 价	数量(张)	期末估值总额
080216	08国开 16	2018-07-02	100.42	2,093,000	210,179,060.00
111809181	18浦发银 行 CD181	2018-07-02	99.32	1,184,000	117,594,880.00
111810275	18兴业银 行 CD275	2018-07-02	99.32	5,208,000	517,258,560.00
111815262	18民生银 行 CD262	2018-07-02	99.32	3,000,000	297,960,000.00
180311	18进出 11	2018-07-02	99.28	700,000	69,496,000.00
189925	18贴现国 债 25	2018-07-02	99.48	600,000	59,688,000.00
会计	_	_	_	12 785 000	1 272 176 500 00

- 12,785,000 1,272,176,500.00 购证券款的余额。 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,由对公允价值计最整体而言具有重要意义的输入值所属的 公允尔田订取10年70年70年70年7日 最低层次决定 第一层次,相同资产或负债在活跃市场上来经调整的报价。 第二层次,相等资产或负债的不可观察输入值。 第三层次,相关资产或负债的不可观察输入值。 (b)持续的以公允价值订量的金融工具

(D)疗法的以公元的值针蛋的查施工具 ()各层次金融工具公允价。 是2018年6月30日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计人当期损益的金融资产中 属于第二层次为4.878.399.440.57元,无属于第一层火或第三层次的余额(2017年12月 31日,第二层次为4.878.399.440.57元,无第一或第三层次)。 (确)公允伯的所属层处向的重土变动 未基金本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次未发 生书本业。

生重大变动。 (iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额 元。 (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

以公允价值计量的金融近具 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

「国相左眼小。 (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。

7.1 期末基金资产组合情况 金额单位:人民币元

序号	项目	金額	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	5,111,128,630.12	62.40
	其中:债券	5,111,128,630.12	62.40
	资产支持证券	-	-
2	买人返售金融资产	1,039,582,319.37	12.69
	其中:买断式回购的买人返售金融资产	-	_
3	银行存款和结算备付金合计	1,801,461,943.56	21.99
4	其他各项资产	238,500,780.35	2.91
5	合计	8,190,673,673.40	100.00

序号	項目	占基金资产净值的	占基金资产净值的比例(%)			
1	报告期内债券回购融资余额		5.44			
	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	1,247,998,856.00	17.99			
	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

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

末投资组合平均剩余期限"项目则列示非交易日的数据

注,投资组合平均剩金期限指交易日的组合平均剩金期限 若报告期末为非交易日"报会 次组百十分粤茶则成"项目则为不平之め口的数据。 报告期内投资给平均剩余期限超过 120 天情况说明 根据本货币市场基金基金台同的约定, 其投资组合的平均剩余期限在每个交易日都不得超 20 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	15.00	17.99		
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动 利率债	-	-		
2	30天(含)-60 天		-		
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动 利率债	-	-		
3	60天(含)—90 天	95.71			
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动 利率债	-	-		
4	90天(含)-120 天	0.43	_		
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动 利率债	=	-		
5	120天(含)—397 天(含)	3.46	-		
	其中:剩余存续期超过 397 天的浮动 利率债	-	-		
	合计	114.61	17.99		

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

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

59,675,998 330,407,497 3,620,124,60

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 金额单位;人民币元

债券名称 推余成本 4 111808154 496,336,751 8京基投 SCP002

"与"摊余成本法"强 的基金资产净值的偏国

也期内编定聚的最低值 0.04 起南内编定度的绝对值达到 0.25%情况说明 报告期内负值深度的绝对值达到 0.25%情况说明 本据告期内、本货币市场基金投资组合未发生价值离度的绝对值达到 0.25%的情况。 报告期内正编度度的绝对位达到 0.55%情况识明 本报告期内。本货币市场基金投资组合未发生正编离度的绝对值达到 0.55%的情况。 7.8 期末接分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 本基金本报告期末共持有资产支持证券。 7.9 投资组合根告附注 7.9 投资组合根告附注

7.9.1 基金计价方法设明。
本基金估值采用确会成本、即估值对象以买人成本列示,按票面利率或协议利率并考虑其
买人时的银价与新价。在其剩余存准期内按照实际利率选进行摊销。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,确实成本法。计算的基金资产净值与转印影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畅养和不公平的结果。基金管理人于每一估值日,采用估值技术,对基金特有的信值对象进行重新评估。即"影子定价"。投资组合的域
余成本与其他可参考公允价值指标产生重大偏离的,应按其他公允价值指标开组合的版面价值进行 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活动计量。如基金份额 净值恢复至 1元,可恢复使用操实成本法估资公允价值,如布确值证据表明技上适方法进行估估 且的价格估值。 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 前一年内受到公开谴责,处罚的情形。

	9.3 期末其他各项资产构成 位:人民币元	
序号	名称	金額
1	存出保证金	12,392.80
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	26,837,845.83
4	应收申购款	211,650,541.72
5	其他应收款	-
6	待推费用	-
7	其他	-
	∆i+	239 500 790 35

8 会订 7.9.4 投资组合报告附注的其他文字描述部分 由于四会五人的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。 8 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

持有人户数 寺有份額 持有份额 61,797,837. 98.74% 1.269 24,547. 41,241,135. 5.279 94.73 3,230 58,542,125

tt A B C D 8.2 期末货币市场基金前十名份额持有人情态

347,410,160 205,831,231 券商类机构 201,576,427.8

5弘現金管

313,928. ○ 以現金管: 告币 C 本 2,062.0 基金管理公司所有从业人员报 有本基金 ○弘現金管
货币D类 1,538,172. .4 期末基金管理人的从业人

₹弘現金管等 货币 C 类 弘现金管等 货币 D 类 ₹弘現金管等 货币 E 类 尺弘现金管等 货币 B 类 ○弘現金管等 货币 C 类 b基金基金经理持有本开放式基金 ○弘現金管家 货币 D 类

天弘現金管家 货币 E 类

§ 9 开放式基金份额变动

k报告期基金总申购份 794,261 27,625,360 1,316,75 486,956 433.3 :本报告期基金总赎 1,300,276 542,47 834.2 , 总申购份额含

注, 总申助份額含红利再校,分級份額调增和转換转人份額; 总赎回份額合分級份額调減和 转 10 重大事件揭示 10.1 基金份網持有人大会决议 本报告期内本基金米召开基金份额持有人大会。 10.2 基金管理人,基金保管,的专门基金任管的门的重大人事变动 本报告期内本基金的基金管理人,基金保管人的专门基金任管的门本发生重大人事变动。 13.3 涉及基金管理人,基金健性,基本保管业多的诉讼 本报告期内设有发生涉及基金管理人,基金财产,基金保管业务的诉讼。 14.4 基金投资策略的信变 本报告期内本基金投资策略的企业。 本报告期内本基金投资策略的企业。

10.5 本报告期持有的基金发生的重大影响事件

10.3 不取它前时间的运盘及王印蓝人是中旬中 本股份期内本基金未均有基金。 10.6 基金改聘会计师库多所情况。 本股份期内未基金所聘用的会计师库多所未发生变化。 和股份期内基金所聘用的会计师库多所未发生变化。 不报告期内全量的。 不报告期内是一人管宫人及其高级管理人员受监管部门商差或处罚的情况。 司交易单元的有关情况 公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

券商名称 成交金額 佣金

中信证券	1	-	-	-					
10.8.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况 金额单位:人民币元									
	债券交易		债券回购交易		权证交易				
券商名称	成交金額	占当期债券 成交总额比例	成交金額	占当期债券回 购成交总额比 例	成交金額	占当期权证 成交总额比例			
大同证券	-	-	-	-	-	-			
东北证券	-	-	-	-	-	-			
东吴证券	-	-	-	-	-	-			
国金证券	-	-	-	-	-	-			
国盛证券	-	-	-	-	-	-			
华宝证券	-	-	-	-	-	-			
华融证券	70,422, 869.00	100.00%	-	-	-	-			
华泰证券	-	-	-	-	-	-			
申万宏源	-	-	-	-	-	-			
兴业证券	-	-	-	-	-	-			
招商证券	-	-	-	-	-	-			

照照原等
中信证券
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,内控制度键金,最近两年未因重大选银行为受到监管机关的
校刊,研究实力较强,能及好。企面,定期向基金管理人程度,高度质量的咨询服务,包括宏观经济报告,市场分析报告,行业研究报告,个投分析报告及全面的信息服务。
2,基金专用交易率完成连程图,本基金管理人根据,选标准进行考察后,确定选用交易解价的证券经营机构。然后基金管理人和被选用的证券经营机构签订交易解位租用协议。

3.本基金报告期内新租用交易单元·2 个. 其中包括国感证券上海交易单元 1 个. 国感证券深

3、本基金报告期内新租用总易年元;2个,其中包括協設证券工得火め平允・1,超级证券件。 2.易换完 1个。 4、本基金报告期内停止租用党易单元;无。 10.9 偏減度验力值超过 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。 (1 影响投资者炭液的其他重要信息 11.报告期内单一投资者将靠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

。 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 二〇一八年八月二十七日