天弘中证食品饮料指数型发起式证券投资基金 2018年年度报告摘要

基金管理人:天弘基金管理有限公司
基金托管人:中信证券股份有限公司
送出日期:2019年03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。
基金托管人中信证券股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年03月25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。本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。
本报告期自2018年01月01日至2018年12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	天弘中证食品饮料	
基金主代码	001631	
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	
基金管理人	天弘基金管理有限公司	
基金托管人	中信证券股份有限公司	
报告期末基金份额总额	441,779,380.42份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	天弘中证食品饮料A	天弘中证食品饮料C
下属分级基金的交易代码	001631	001632
报告期末下属分级基金的份额总额	231,367,184.90份	210,612,195.52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配合复制标的指数,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	中证食品饮料指数收益率×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	中信证券股份有限公司
信息披露负责人	姓名	童建林	杨军智
	联系电话	022-83310208	010-60836299
	电子邮箱	service@thfund.com.cn	yjz@citics.com
客户服务电话		95046	010-60836588
传真		022-83865569	010-60834004

2.4 信息披露方式

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

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

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	2018年		2017年		2016年	
	天弘中证食品饮料A	天弘中证食品饮料C	天弘中证食品饮料A	天弘中证食品饮料C	天弘中证食品饮料A	天弘中证食品饮料C
本期已实现收益	−11,638,384.30	−12,657,389.33	9,688,011.92	6,364,434.99	407,937.98	228,451.03
本期利润	−58,672,659.23	−66,321,063.24	21,953,478.40	11,839,645.69	339,360.21	429,138.38
加权平均基金份额本期利润	−0.3175	−0.4043	0.3619	0.2571	0.0115	0.0447
本期基金份额净值增长率	−18.51%	−18.69%	36.68%	36.31%	1.88%	1.66%
3.1.2 期末数据和指标	2018年末		2017年末		2016年末	
期末可供分配基金份额利润	0.0709	0.0615	0.1883	0.1811	0.0085	0.0053
期末基金资产净值	265,479,040.54	239,947,553.49	237,819,679.84	177,369,726.34	32,244,029.76	77,519,563.28
期末基金份额净值	1.1484	1.1393	1.4839	1.4754	1.0859	1.0824

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

天弘中证食品饮料A

阶段	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
过去三个月	−15.68%	2.17%	−16.26%	2.22%	0.58%	−0.05%
过去六个月	−20.00%	1.90%	−21.24%	1.94%	1.24%	−0.04%
过去一年	−18.51%	1.77%	−20.93%	1.80%	2.42%	−0.03%
过去三年	13.41%	1.49%	8.70%	1.49%	4.71%	−
自基金合同生效起至今	20.92%	1.52%	11.00%	1.57%	9.92%	−0.05%

天弘中证食品饮料C

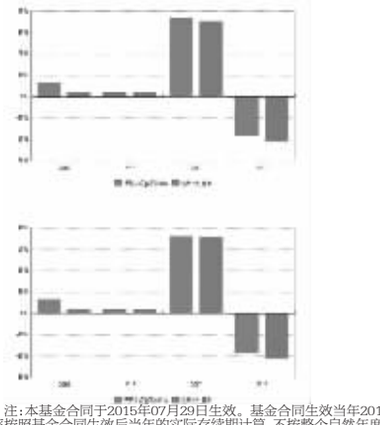
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	−15.72%	2.17%	−16.26%	2.22%	0.54%	−0.05%
过去六个月	−20.08%	1.90%	−21.24%	1.94%	1.16%	−0.04%
过去一年	−18.69%	1.77%	−20.93%	1.80%	2.24%	−0.03%
过去三年	12.67%	1.49%	8.70%	1.49%	3.97%	−
自基金合同生效起至今	19.96%	1.52%	11.00%	1.57%	8.96%	−0.05%

注:本基金投资组合的业绩比较基准为:中证食品饮料指数收益率×95%+银行活期存款利率(税后)×5%。中证食品饮料指数选取包装食品与肉类、饮料等行业的代表性公司作为样本股,以反映食品饮料类上市公司股票的整体表现。

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2015年07月29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。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:本基金合同于2015年07月29日生效。基金合同生效当年2015年的净值增长率按照基金合同生效后当年的实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

天弘中证食品饮料A

单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2018年	0.781	11,845,036.69	1,659,651.85	13,504,688.54	−
合计	0.781	11,845,036.69	1,659,651.85	13,504,688.54	−

天弘中证食品饮料C

单位:人民币元

年度	每10份基金份额分红数	现金形式发放总额	再投资形式发放总额	年度利润分配合计	备注
2018年	0.776	10,701,005.48	1,626,336.02	12,327,341.50	−
合计	0.776	10,701,005.48	1,626,336.02	12,327,341.50	−

§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%
梵谷资产管理有限公司	5.6%
新疆天瑞博丰股权投资合伙企业(有限合伙)	3.5%
新疆天惠新盛股权投资合伙企业(有限合伙)	2%
新疆天聚富兴股权投资合伙企业(有限合伙)	2%
新疆天聚富兴股权投资合伙企业(有限合伙)	3.5%
合计	100%

截至2018年12月31日,本基金管理人共管理45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)、天弘护深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、天弘上证50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、天弘中证电子指数型发起式证券投资基金、天弘中证计算机主题指数型发起式证券投资基金(原"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、天弘信利债券型证券投资基金、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(助理)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,历任权益研究员、基金经理助理。
陈瑞	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、基金交易策略、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 公平交易制度和控制方法

基金管理人一直坚持公平对待旗下所有基金的原则,严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度,在研究分析、投资决策和交易执行等各个环节落实公平交易原则。公平交易范围包括各类投资组合、所有投资交易品种、以及一级市场申购、二级市场交易等所有投资交易管理活动及授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。
针对公司旗下所有投资组合的交易所公开竞价交易,通过交易系统中的公平交易程序,对于不同投资组合同日同向买卖同一证券的指令自动进行比例分配。针对场外网下交易业务,依照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部场外、网下交易业务的相关规定,确保各投资组合享有公平的交易执行机会。对于以公司名义进行的交易严格按照发行分配的原则或价格优先、比例分配的原则在各投资组合间进行分配。

4.3.2 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。

4.3.3 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

报告期内,本基金秉承合规第一、风控第一的原则,坚持既定的指数化投资策略,力争投资回报与所跟踪指数保持一致,努力为投资者提供一个良好的指数投资工具。
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。当由于申赎变动、指数成分股权重调整、成分股停牌等情况可能对指数跟踪效果带来影响时,本基金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。报告期内,本基金整体运行平稳。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2018年12月31日,天弘中证食品饮料A基金份额净值为1.1484元,天弘中证食品饮料C基金份额净值为1.1393元。报告期内份额净值增长率天弘中证食品饮料A为-18.51%,天弘中证食品饮料C为-18.69%,同期业绩比较基准增长率均为-20.93%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

最新数据显示,PMI仍处于荣枯线以下,房地产投资趋势性向下,基建投资面临地方政府债务制约反弹乏力、外部需求面临中美贸易争端以及全球经济增长放缓的拖累,汽车销量下滑,社会消费品零售总额增速较低,2019年国内经济增长仍然面临较大的下行压力,稳增长也面临着较大的考验。但另一方面,宏观经济政策已经发生较大的转变,货币政策保持宽松,财政减税降费将继续推进,力促金融支持实体经济尤其是支持小微企业、民营企业的配套政策措施加速出台,政策底已清晰进入右侧。展望2019年,我们预期货币政策保持宽松,持续降准仍然值得期待,加大专项债供给力保基建平稳,另外,制造业投资企稳回升的趋势将延续,中国经济结构调整正在取得积极进展,虽然实际GDP增速保持平稳,但经济结构将更加优化,减税降费刺激消费,国资国企、财税金融、土地、市场准入、社会管理等领域的改革持续推进,都将是中国经济增长新的支点。过去一年A股市场经历了中美贸易战冲击、国内经济下行压力,金融市场风险暴露,随着风险的逐步释放,目前A股整体的估值水平可能已经到达底部区域,配置价值逐步显现。
目前中国已经进入长达10年的消费升级时代,从美国和日本的经验来看,这个阶段食品饮料指数是能大幅跑赢基准指数的行业,并且诞生了可口可乐、麦当劳等大牛股;中期来看,我国经济依然面临着压力,食品饮料作为消费里面相对必选的行业,受到经济波动相对较小,业绩更为稳健,属于熊市里有相对收益,牛市中有绝对收益的品种。从估值来看,食品饮料目前的估值处于历史极端低值,长期配置价值明显。

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的高级管理人员、督察长、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、风险管理人员及内控合规人员组成。
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人和会计师事务所。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《基金法》、《天弘中证食品饮料指数型证券投资基金基金合同》及其他相关法律法规的规定,本报告期内,本基金进行了1次分红。以2018年06月15日已实现的可分配收益68,382,305.95元为基准计算,2018年06月26日向天弘中证食品饮料A基金份额持有人按每10份基金份额派发红利0.781元,向天弘中证食品饮料C基金份额持有人按每10份基金份额派发红利0.776元。本次分红符合本基金基金合同中利润分配的相关约定。
本基金截止本报告期末不存在根据基金合同约定应分配但尚未实施利润分配的情形。

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

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,中信证券股份有限公司(以下称"本托管人")在对天弘中证食品饮料指数型发起式证券投资基金(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,天弘基金管理有限责任公司在天弘中证食品饮料指数型发起式证券投资基金投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支等问题上,托管人未发现损害基金持有人利益的行为。
本报告期内,天弘中证食品饮料指数型发起式证券投资基金进行了1次利润分配。2018年06月26日向天弘中证食品饮料A基金份额持有人按每10份基金份额派发红利0.781元,向天弘中证食品饮料C基金份额持有人按每10份基金份额派发红利0.776元。本次分红符合基金合同中利润分配的相关约定。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期,由天弘基金管理有限责任公司编制并经托管人复核审查的有关天弘中证食品饮料指数型发起式证券投资基金的年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告相关内容、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6 审计报告

本报告期本基金财务会计报告经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计,该所出具了"标准无保留意见的审计报告",且在审计报告中无强调事项。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:天弘中证食品饮料指数型发起式证券投资基金
报告截止日:2018年12月31日

单位:人民币元

资 产	本期末 2018年12月31日	上年度末 2017年12月31日
资 产:		
银行存款	39,432,967.89	47,172,605.24
结算备付金	206,085.92	2,125,733.83
存出保证金	440,594.65	361,104.27
交易性金融资产	469,965,815.43	390,487,142.92
其中:股票投资	469,965,815.43	390,487,142.92
基金投资	−	−
债券投资	−	−
资产支持证券投资	−	−
贵金属投资	−	−
衍生金融资产	−	−
买入返售金融资产	−	−
应收证券清算款	−	11,219,351.21
应收利息	8,825.51	11,700.74
应收股利	−	−
应收申购款	5,676,549.88	10,240,886.38
递延所得税资产	−	−
其他资产	−	−
资产总计	515,730,839.28	461,618,524.59
负债和所有者权益	本期末 2018年12月31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	−	−
卖出回购金融资产款	−	−
应付证券清算款	4,800,731.93	−
应付赎回款	4,894,477.45	45,697,668.93
应付管理人报酬	202,825.32	154,900.73
应付托管费	40,565.07	30,980.11
应付销售服务费	36,420.89	27,801.19
应付交易费用	142,751.26	144,844.95
应交税费	−	−
应付利息	−	−
应付利润	−	−
递延所得税负债	−	−
其他负债	186,473.33	172,920.50
负债合计	10,304,245.25	46,229,116.41
所有者权益:		
实收基金	441,779,380.42	280,623,449.80
未分配利润	63,647,213.61	134,765,958.38
所有者权益合计	505,426,594.03	415,389,408.18
负债和所有者权益总计	515,730,839.28	461,618,524.59

注:报告截止日2018年12月31日,天弘中证食品饮料指数型发起式证券投资基金A类基金份额净值1.1484元,天弘中证食品饮料指数型发起式证券投资基金C类基金份额净值1.1393元;基金份额总额441,779,380.42份,其中天弘中证食品饮料指数型发起式证券投资基金A类基金份额231,167,184.90份,天弘中证食品饮料指数型发起式证券投资基金C类基金份额210,612,195.52份。

7.2 利润表

会计主体:天弘中证食品饮料指数型发起式证券投资基金
本报告期:2018年01月01日至2018年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期2018年01月01日至2018年12月31日	上年度可比期间2017年01月01日至2017年12月31日
一、收入	−120,031,240.99	35,645,101.35
1.利息收入	323,279.76	107,957.51
其中:存款利息收入	323,279.76	107,957.51
债券利息收入	−	−
资产支持证券利息收入	−	−
买入返售金融资产收入	−	−
其他利息收入	−	−
2.投资收益(损失以"-"填列)	−21,016,926.43	17,071,543.40
其中:股票投资收益	−27,859,972.45	15,714,193.74
基金投资收益	−	−
债券投资收益	−	−
资产支持证券投资收益	−	−
贵金属投资收益	−	−
衍生工具收益	−	−
股利收益	6,843,046.02	1,357,349.66
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	−100,697,948.84	17,940,677.18
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)	−	−
5.其他收入(损失以"-"号填列)	1,360,354.52	524,923.26
减:二、费用	4,962,481.48	1,851,977.26
1.管理人报酬	2,350,585.05	685,131.19
2.托管费	470,117.03	137,026.22
3.销售服务费	493,015.49	144,502.78
4.交易费用	1,394,740.47	716,381.57
5.利息支出	−	−
其中:卖出回购金融资产支出	−	−
6.税金及附加	−	−
7.其他费用	254,023.44	168,935.50
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	−124,993,722.47	33,793,124.09
减:所得税费用	−	−
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	−124,993,722.47	33,793,124.09

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:天弘中证食品饮料指数型发起式证券投资基金
本报告期:2018年01月01日至2018年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期2018年01月01日至2018年12月31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)	280,623,449.80	134,765,958.38	415,389,408.18
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	−	−124,993,722.47	−124,993,722.47
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)	161,155,930.62	79,707,007.74	240,862,938.36
其中:1.基金申购款	1,858,803,758.11	745,472,902.16	2,604,276,660.27
2.基金赎回款	−1,697,647,827.49	−665,765,894.42	−2,363,413,721.91
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)	−	−25,832,030.04	−25,832,030.04
五、期末所有者权益(基金净值)	441,779,380.42	63,647,213.61	505,426,594.03
项 目	上年度可比期间2017年01月01日至2017年12月31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)	101,314,378.08	8,449,214.96	109,763,593.04
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	−	33,793,124.09	33,793,124.09
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)	179,309,071.72	92,523,619.33	271,832,691.05
其中:1.基金申购款	1,093,993,364.11	407,563,521.12	1,501,556,885.23
2.基金赎回款	−914,684,292.39	−315,039,901.79	−1,229,724,194.18
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)	−	−	−
五、期末所有者权益(基金净值)	280,623,449.80	134,765,958.38	415,389,408.18

注:报告期末基金份额总额441,779,380.42份,其中天弘中证食品饮料指数型发起式证券投资基金A类基金份额231,167,184.90份,天弘中证食品饮料指数型发起式证券投资基金C类基金份额210,612,195.52份。

§8 投资组合报告

8.1 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	权益投资	469,965,815.43	91.13
	其中:股票	469,965,815.43	91.13
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	39,639,053.81	7.69
8	其他各项资产	6,125,970.04	1.19
9	合计	515,730,839.28	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

8.2.1 报告期末(指数投资)按行业分类的境内股票投资组合

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	469,849,630.13	92.96
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	−	−
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	469,849,630.13	92.96

8.2.2 报告期末(积极投资)按行业分类的境内股票投资组合

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	66,039.50	0.01
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	50,145.80	0.01
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	116,185.30	0.02

8.3 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

8.3.1 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

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	600519	贵州茅台	82,595	48,731,875.95	9.64
2	600887	伊利股份	2,109,014	48,254,240.32	9.55
3	000858	五粮液	910,383	46,320,287.04	9.16
4	002304	洋河股份	422,134	39,984,532.48	7.91
5	603288	海天味业	567,900	39,071,520.00	7.73
6	000568	泸州老窖	513,137	20,864,150.42	4.13
7	000895	双汇发展	693,616	16,362,401.44	3.24
8	600872	中炬高新	390,489	11,503,805.94	2.28
9	300146	汤臣倍健	622,300	10,572,877.00	2.09
10	000860	顺鑫农业	279,741	8,920,940.49	1.77

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年度报告正文。

8.3.2 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

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	603185	上机数控	1,345	66,039.50	0.01
2	601860	紫金银行	15,970	50,145.80	0.01

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年度报告正文。

8.3.3 期末按照证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。

8.6 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。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 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。

8.11 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 本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。

8.12.3 期末其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	应收保证金	440,594.65
2	应收证券清算款	−
3	应收股利	−
4	应收利息	8,825.51
5	应收申购款	5,676,549.88
6	其他应收款	−
7	待摊费用	−
8	其他	−
9	合计	6,125,970.04

8.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报