天弘精选混合型证券投资基金

2019年第一季度报告

基金管理人:天弘基金管理有限公司
基金托管人:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2019年04月19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。
基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年04月17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2019年01月01日起至2019年03月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	天弘精选混合
基金主代码	420001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005年10月08日
报告期末基金份额总额	1,638,821,171.24份
投资目标	以资产配置为导向,在股票、债券、短期金融工具等之间进行动态选择,在控制风险的前提下追求基金财产的长期稳健增值。
投资策略	在资产配置层次上,本基金以资产配置为导向,力图通过对股票、债券和短期金融工具进行灵活资产配置,在控制风险基础上,获取收益;在行业配置层次上,根据各个行业的景气程度,进行行业资产配置;在股票选择上,本基金将挖掘行业龙头,投资于有投资价值的行业龙头企业;本基金债券投资坚持以久期管理和凸性分析为核心,以稳健的主动投资为主导,选取价值被低估的券种,以获得更高的收益。
业绩比较基准	上证180指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45%
风险收益特征	本基金为主动管理的混合型基金,其长期平均风险程度低于股票型基金,高于货币市场型基金。本基金力争在严格控制风险的前提下,谋求实现基金财产的长期稳定增长。
基金管理人	天弘基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

§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(2019年01月01日 - 2019年03月31日)
1.本期已实现收益	5,548,370.27
2.本期利润	260,282,552.12
3.加权平均基金份额本期利润	0.1566
4.期末基金资产净值	1,224,663,952.81
5.期末基金份额净值	0.7473

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。

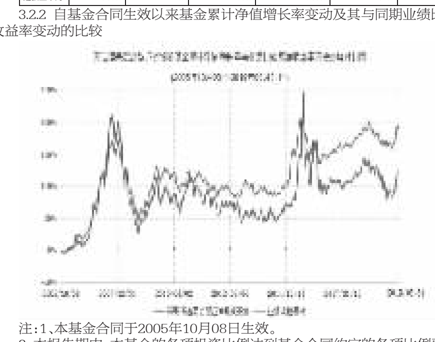
3、本基金合同于2005年10月08日生效。

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	26.60%	1.21%	14.06%	0.85%	12.54%	0.36%

3.2.2 自基金合同生效以来基金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2005年10月08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		
钱文成	本基金基金经理。	2013年01月	-	13年	男,理学硕士。2007年5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。
姜晓丽	本基金基金经理。	2016年07月	-	10年	女,经济学硕士。历任本公司债券研究员兼债券交易员,光大永明人寿保险有限公司债券研究员兼交易员,2011年8月加盟本公司,历任固定收益研究员、基金经理助理等。
谷琦彬	本基金基金经理。	2018年06月	-	9年	男,电机工程与应用电子技术硕士学位。历任中信证券股份有限公司研究员,瑞银证券有限责任公司研究员,国泰君安证券股份有限公司首席研究员。2015年11月加盟本公司,历任高级研究员。

注:1、基金经理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。

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

2019年一季度市场大幅上涨,1月份在外资净买入大幅上升的带动下,以食品饮料和家电等消费类行业领涨,2月份公布1月社融金额大幅超预期,市场被全面激活,科技类为首的行业大幅上涨,同时市场整体表现出明显的行业轮动、主题不断的特征,3月份在市场逐步感受到经济并没有此前预期的那样悲观,市场的风险偏好进一步提升,一季度整体基本修复了2018年的跌幅,股票市场的估值得到了显著的回升。本基金在1季度逐步提高了仓位,重点配置方向是消费类行业,如食品饮料、家电、轻工制造等,1季度也适度增配了景气度预期较高的农业养殖板块,取得了一定的收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2019年03月31日,本基金份额净值为0.7473元,本报告期份额净值增长率26.60%,同期业绩比较基准增长率14.06%。

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。

§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	权益投资	1,008,392,239.50	81.87
	其中:股票	1,008,392,239.50	81.87
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	69,896,238.98	5.67
	其中:债券	69,896,238.98	5.67
	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	141,798,075.61	11.51
8	其他资产	11,652,498.50	0.95
9	合计	1,231,739,052.59	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	136,625,911.82	11.16
B	采矿业	732,888.00	0.06
C	制造业	784,542,326.84	64.06
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	5,175,436.00	0.42
E	建筑业	7,600,646.62	0.62
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	21,162,982.94	1.73
J	金融业	26,543,974.92	2.17
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	22,649,644.00	1.85
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	3,358,428.36	0.27
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	1,008,392,239.50	82.34

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

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	603899	晨光文具	1,551,100	57,390,700.00	4.69
2	002557	洽洽食品	2,200,524	56,729,508.72	4.63
3	002508	老板电器	1,741,416	56,073,595.20	4.58
4	603833	欧派家居	456,399	55,406,838.60	4.52
5	002299	圣农发展	2,166,858	53,933,095.62	4.40
6	002191	劲嘉股份	3,697,387	52,465,921.53	4.28
7	002035	华帝股份	3,606,200	50,594,986.00	4.13
8	000568	泸州老窖	739,321	49,223,992.18	4.02
9	600519	贵州茅台	53,900	46,030,061.00	3.76
10	601968	宝钢包装	8,374,700	42,208,488.00	3.45

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中:政策性金融债	-	-
4	企业债券	46,956,678.60	3.83
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	10,271,000.00	0.84
7	可转债(可交换债)	3,093,560.38	0.25
8	同业存单	9,575,000.00	0.78
9	其他	-	-
10	合计	69,896,238.98	5.71

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	136436	16远洋01	200,000	20,140,000.00	1.64
2	101801085	18大横琴MTN001	100,000	10,271,000.00	0.84
3	143807	18电投07	100,000	10,180,000.00	0.83
4	136773	16清控02	100,000	9,806,000.00	0.80
5	111807085	18招商银行CD085	100,000	9,575,000.00	0.78

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

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	398,061.94
2	应收证券清算款	9,349,515.01
3	应收股利	-
4	应收利息	1,586,007.69
5	应收申购款	318,913.86
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	11,652,498.50

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

本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。

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	1,675,056,123.25
报告期期间基金总申购份额	12,548,879.25
减:报告期期间基金总赎回份额	48,783,831.26
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	1,638,821,171.24

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。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	23,012,311.59
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	23,012,311.59
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	1.40

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未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

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。

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精选混合型证券投资基金募集的文件

2、天弘精选混合型证券投资基金基金合同

3、天弘精选混合型证券投资基金托管协议

4、天弘精选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

二〇一九年四月十九日

太平日日鑫货币市场基金

2019年第一季度报告

基金管理人:太平基金管理有限公司
基金托管人:中国民生银行股份有限公司
报告送出日期:2019年4月19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。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年4月17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2019年1月1日起至2019年3月31日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	太平日日鑫货币
基金主代码	004330
交易代码	004330
基金运作方式	契约型、开放式
基金合同生效日	2017年3月15日
报告期末基金份额总额	3,654,067,989.06份
投资目标	在控制基金资产投资风险和保持基金资产较高流动性的基础上,力争获得超越业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金通过对短期金融工具的积极投资管理,在有效控制投资风险和保持流动性的基础上,力争获得超越业绩比较基准的投资回报。 1、资产配置策略 本基金通过对货币政策、宏观经济运行状况、利率走势、资金供求变化情况进行深入研究,评估各类投资品种的流动性和风险收益特征,确定各类投资品种的配置比例及期限组合,并适时进行动态调整。 2、利率预期策略 本基金通过跟踪和分析各类宏观经济指标、资金供求状况等因素,对短期利率变化趋势进行评估并形成合理预期,动态配置资产。 3、期限配置策略 本基金在短期利率期限结构分析的基础上,分析和评估各类投资品种的收益性和流动性,构建合理期限结构的投资组合。如预期市场利率水平上升,适度缩短投资组合的平均剩余期限;如预期市场利率水平下降,适度延长投资组合的平均剩余期限。 4、流动性管理策略 本基金将会紧密关注申购/赎回现金流变化情况、市场资金流动状况等影响货币市场基金流动性管理的因素,动态调整并有效分配基金的现金流,以满足基金资产的日常流动性需求。 5、套利策略 本基金根据对货币市场变动趋势、各市场和品种之间的风险收益差异的充分研究和论证,适当进行跨市场或跨品种套利操作,力争提高资产收益率,具体策略包括跨市场套利和跨期限套利等。 6、资产支持证券的投资策略 本基金将综合运用战略资产配置和战术资产配置进行资产支持证券的投资组合管理,并根据信用风险、利率风险和流动性风险变化积极调整投资策略,严格遵守法律法规和基金合同的约定,在保证本金安全和基金资产流动性的基础上获得稳定收益。 7、非金融企业债务融资工具的投资策略 本基金将通过宏观经济、中观产业、微观个券等综合判断,并结合资金面变化进行非金融企业债务融资工具的投资,严格遵守法律法规和基金合同的约定,兼顾安全性、流动性和收益性。 8、同业存单的投资策略 本基金将结合商业银行的不同资质和同业存单剩余期限进行同业存单的投资,注重同业存单的安全性、交易的流动性和收益率的比较,严格遵守法律法规和基金合同的约定。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准:同期七天通知存款税后利率
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	太平基金管理有限公司
基金托管人	中国民生银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	太平日日鑫A 太平日日鑫B
下属分级基金的交易代码	004330 004331
报告期末下属分级基金的份额总额	79,522,526.10份 3,574,545,462.96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(2019年1月1日 - 2019年3月31日)	
	太平日日鑫A	太平日日鑫B
1.本期已实现收益	2,742,780.01	27,089,979.19
2.本期利润	2,742,780.01	27,089,979.19
3.期末基金资产净值	79,522,526.10	3,574,545,462.96

注: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

太平日日鑫A

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	0.6983%	0.0034%	0.3329%	0.0000%	0.3654%	0.0034%

注:本基金的收益分配是按日结转份额。

太平日日鑫B

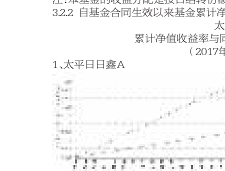
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.7627%	0.0036%	0.3329%	0.0000%	0.4298%	0.0036%

注:本基金的收益分配是按日结转份额。

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变动的比较

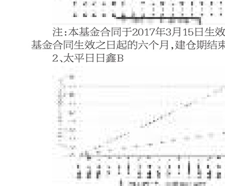
太平日日鑫货币市场基金
累计净值收益率与同期业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2017年3月15日至2019年3月31日)

1、太平日日鑫A



注:本基金合同于2017年3月15日生效。按照本基金基金合同和招募说明书的约定,本基金建仓期为自基金合同生效之日起的六个月,建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合合同约定。

2、太平日日鑫B



注:本基金合同于2017年3月15日生效。按照本基金基金合同和招募说明书的约定,本基金建仓期为自基金合同生效之日起的六个月,建仓期结束时本基金的各项资产配置比例符合合同约定。

§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		
吴超	本基金的基金经理、太平日日金货币市场基金基金经理、太平睿盈混合型证券投资基金基金经理	2018年2月12日	-	5年	美国本特利商学院金融学硕士,具有证券投资基金从业资格,2013年5月起曾在西部证券股份有限公司固定收益部、上海金懿投资有限公司担任部门经理、投资总监等职。2017年3月加入本公司,现任固定收益部基金经理,2018年2月12日起任太平日日金货币市场基金、太平日日鑫货币市场基金基金经理;2019年3月25日起担任太平睿盈混合型证券投资基金基金经理。中国国籍。
潘莉	本基金的基金经理、太平日日金货币市场基金基金经理、太平恒利纯债债券型证券投资基金基金经理	2018年3月23日	-	6年	牛津大学工商管理硕士,具有证券投资基金从业资格。2004年6月起曾就职于东京海上日动火灾保险株式会社非日系部、英国皇家太阳联合保险公司大客户部担任核保和客服工作;中国人保资产管理有限公司历任集中交易室交易员、固定收益部投资经理;南通农村商业银行股份有限公司历任金融市场部固收类投资经理、投资总监。2018年2月加入本公司,现任固定收益部基金经理。2018年3月23日起任太平日日金货币市场基金、太平日日鑫货币市场基金基金经理;2018年6月15日起担任太平恒利纯债债券型证券投资基金基金经理中国国籍。

注:1、基金经理的任职日期和离任日期一般情况下指公司对外公告之日;若该基金经理自本基金基金合同生效之日起即任职,则任职日期指本基金基金合同生效之日;

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 管理人对报告期内基金运作遵规守信情况的说明

本报告期内,本基金管理人严格遵守有关法律法规、监管部门的相关规定和本基金基金合同的约定,依照诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,为基金份额持有人谋求最大利益,不存在损害基金份额持有人利益的行为,不存在违法违规或未履行基金合同的情形。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及有关法规,建立公司内部的公平交易管理制度体系,从研究分析、投资决策、交易执行、事后稽核等环节进行严格规范,通过系统和人工相结合的方式在投资管理活动各环节贯彻和执行公平交易管理制度,以确保公平对待本基金管理人管理的所有投资组合,防范不公平交易和利益输送行为。

本报告期内,本基金管理人严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》及公司公平交易管理的相关制度等的有关规定,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

本报告期内,未发生本基金管理人管理的所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情形,未发现可能导致不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

宏观经济方面,第一季度经济显示出回暖迹象,经济数据略超市场预期,国外经济政治局势发生一定变化,贸易争端有所缓和,市场对于经济预期有所升温。一季度CPI较去年有所上行,主要由食品价格上涨带动。PPI下行明显,原材料涨价压力较小。央行货币政策维持稳健偏宽松的态势,一季度降准一次,同时创新使用TMLF降低银行融资成本。货币传导机制进一步深化,不断推动宽信用进程,信用风险得到部分缓解。债券市场一季度表现一般,整体呈现震荡行情,市场风险偏好明显提升,权益类资产对债券市场压制明显。

预计第二季度市场资金面仍将维持宽松局面,利率债及高评级券种仍将维持震荡行情,中等评级会受到市场更多关注,太平日日鑫将继续秉持"短久期、高评级、低杠杆"的投资思路,严格控制流动性风险,积极把握短期市场资金面波动带来的机会增加收益。本报告期内,本基金在遵守基金合同、控制风险的前提下,为投资者取得了稳定的收益,符合货币基金的风险收益特征。

4.5 报告期内基金的业绩表现

本报告期内,太平日日鑫A的净值收益率为0.6983%,同期业绩比较基准收益率为0.3329%;太平日日鑫B的净值收益率为0.7627%,同期业绩比较基准收益率为0.3329%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

报告期内基金持有人数或基金资产净值未发生预警的情况。

§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(人民币元)	占基金总资产的比例(%)
1	固定收益投资	2,406,523,413.60	61.60
	其中:债券	2,406,523,413.60	61.60
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	1,450,460,811.79	37.13
	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	23,207,897.21	0.59
4	其他资产	26,429,197.59	0.68
5	合计	3,906,621,320.19	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	7.47	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	251,269,235.09	6.88
	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银行间市场交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本基金本报告期内债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

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	58
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	64
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	51

报告期内投资组合平均剩余期限超过120天情况说明

本基金本报告期内投资组合平均剩余期限未超过120天。

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	51.55	6.88
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	20.21	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	1.63	-
3	60天(含)—90天	8.97	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	6.86	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天(含)	18.60	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	106.19	6.88

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

本基金报告期内投资组合平均剩余期限未超过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	270,003,728.41	7.39
	其中:政策性金融债	270,003,728.41	7.39
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	270,495,611.67	7.40
6	中期票据	20,055,914.14	0.55
7	同业存单	1,845,968,159.38	50.52
8	其他	-	-
9	合计	2,406,523,413.60	65.86
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	59,724,529.42	1.63

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	120227	12国开27	2,100,000	210,279,198.99	5.75
2	111810365	18兴业银行CD365	1,000,000	100,000,043.02	2.74
3	111882064	18宁波银行CD142	1,000,000	99,977,549.06	2.74
4	111816312	18上海银行CD312	1,000,000	99,928,849.20	2.73
5	111886463	18江西银行CD106	1,000,000	99,920,927.06	2.73
6	111991256	19宁波银行CD030	1,000,000	99,742,447.71	2.73
7	111816266	18上海银行CD266	1,000,000	99,638,166.48	2.73
8	111871073	18锦州银行CD292	1,000,000	99,441,970.79	2.72
9	111815598	18民生银行CD598	1,000,000	98,683,047.63	2.70
10	111885464	18甘肃银行CD110	1,000,000	98,568,004.48	2.70

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	0次
报告期内偏离度的最高值	0.1284%
报告期内偏离度的最低值	0.0404%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0838%

报告期内负偏离度的绝对值达到0.25%情况说明

报告期内无负偏离度的绝对值达到0.25%情况

报告期内正偏离度的绝对值达到0.5%情况说明

报告期内无正偏离度的绝对值达到0.5%情况

5.8 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。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 基金计价方法说明

本基金估值采用"摊余成本法",即计价对象以买入成本列示,按照票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价,在剩余存续期内按照实际利率法进行摊销,每日计提损益。

5.9.2 本报告期内,本基金投资的前十名证券的发行主体没有出现被监管部门立案调查,或在本报告编制日前一年内受到公开谴责处罚的情况。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(人民币元)
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	6,294,394.59
4	应收申购款	20,134,803.00
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	26,429,197.59

注: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

项目	太平日日鑫A	太平日日鑫B
报告期期初基金份额总额	704,694,875.83	3,391,590,334.61
报告期期间基金总申购份额	194,669,546.67	523,421,552.23
减:报告期期间基金总赎回份额	819,841,896.40	340,466,423.88
报告期期末基金份额总额	79,522,526.10	3,574,545,462.96

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

本报告期内,基金管理人未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	20190101-20190331	2,679,817,206.85	20,824,581.85	-	2,700,641,788.70	73.91
产品特有风险							

(1)本基金投资于货币市场工具,可能面临较高的货币市场利率波动的系统性风险以及流动性风险。货币市场利率的波动会影响基金的再投资收益,并影响到基金资产公允价值的变动,从而影响基金的收益水平。同时为应对赎回进行资产变现时,可能会由于货币市场工具流动性不足而面临流动性风险。

(2)本基金份额净值始终保持为1.00元,投资收益每日分配,按日支付,但投资者购买本基金并不等于将资金作为存款存放在银行或存款类金融机构,基金每日分配的收益因市场情况上下波动,在极端情况下可能为负值,导致基金份额持有人的基金份额缩减的风险。

(3)当影子定价确定的基金资产净值与摊余成本法计算的基金资产净值的负偏离度绝对值连续两个交易日超过0.5%时,基金管理人按照公允价值方法对持有投资组合的账面价值进行调整,导致基金份额持有人的基金份额缩减的风险。

(4)在特定条件下,为保证基金平稳运作,避免诱发系统性风险,基金管理人有可能对当日单个基金份额持有人申请赎回基金份额超过基金总份额1%以上的赎回申请征收1%的强制赎回费用,本基金基金份额持有人会面临赎回份额少于预期的风险。

(5)在极端风险发生时,基金管理人及其股东在履行内部程序后,可以使用固有资金从货币市场基金购买金融工具。基金管理人及其股东存在着无法或来不及从货币市场基金购买金融工具的可能性,基金份额持有人可能面临损失。

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

1、中国证监会关于核准本基金募集的批复

2、《太平日日鑫货币市场基金基金合同》

3、《太平日日鑫货币市场基金招募说明书》

4、《太平日日鑫货币市场基金托管协议》

5、基金管理人业务资格批件、营业执照

6、法律法规及中国证监会要求的其他文件

9.2 存放地点

本基金管理人办公地点(地址:上海市浦东新区花园石桥路33号花旗集团大厦17楼1708室)

9.3 查阅方式

投资者对本报告书如有疑问,可咨询本基金管理人太平基金管理有限公司;部分备查文件可在本基金管理人公司网站上查阅。

客户服务电话:021-61560999

公司网址:www.taipingfund.com.cn

太平基金管理有限公司

二〇一九年四月十九日

天弘现金管家货币市场基金

2019年第一季度报告

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
报告送出日期:2019年04月19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。
基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年04月17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2019年01月01日起至2019年03月31日止。

§2 基金产品概况

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06月20日				
报告期末基金份额总额	10,148,067,258.94份				
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。				
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				
下属分级基金的基金简称	天弘现金管家A类	天弘现金管家B类	天弘现金管家C类	天弘现金管家D类	天弘现金管家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	223,095,785.68份	345,401,543.70份	378,850,798.92份	3,768,151.93份	9,196,950,978.71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(2019年01月01日 - 2019年03月31日)				
	天弘现金管家A类	天弘现金管家B类	天弘现金管家C类	天弘现金管家D类	天弘现金管家E类
1.本期已实现收益	1,704,626.18	3,554,792.61	2,906,129.39	28,526.39	50,154,715.90
2.本期利润	1,704,626.18	3,554,792.61	2,906,129.39	28,526.39	50,154,715.90
3.期末基金资产净值	223,095,785.68	345,401,543.70	378,850,798.92	3,768,151.93	9,196,950,978.71

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、本基金合同于2012年06月20日生效。

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

天弘现金管家A类净值表现

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	0.6700%	0.0008%	0.3381%	0.0000%	0.3319%	0.0008%

天弘现金管家B类净值表现

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	0.7298%	0.0008%	0.3381%	0.0000%	0.3917%	0.0008%

天弘现金管家C类净值表现

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	0.6825%	0.0008%	0.3381%	0.0000%	0.3444%	0.0008%

天弘现金管家D类净值表现

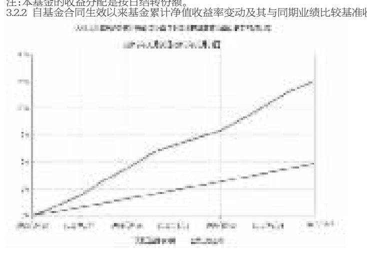
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.6700%	0.0008%	0.3381%	0.0000%	0.3319%	0.0008%

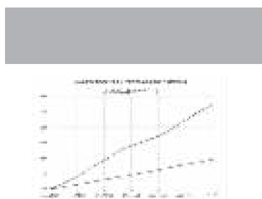
天弘现金管家E类净值表现

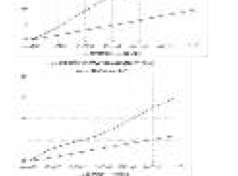
阶段	净值收益率①	净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.6705%	0.0008%	0.3381%	0.0000%	0.3324%	0.0008%

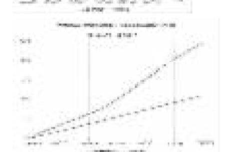
注:本基金的收益分配是按日结转份额。

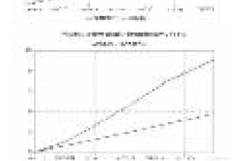
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较











注:1、本基金合同于2012年06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,份额首次确认日为2014年10月21日。

3、本基金于2015年05月05日起增加天弘现金管家货币D类基金份额,并于2015年05月06日起办理该类份额的申购和赎回业务,份额首次确认日为2015年05月07日。

4、本基金于2016年07月14日起增加天弘现金管家货币E类基金份额,并于2016年07月14日起办理该类份额的申购和赎回业务,份额首次确认日为2016年07月15日。

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			
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	-	10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	-	9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,历任本公司投资经理、固定收益部研究员。	

注:1、基金经理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 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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

基本面方面,进入2019年之后,经济仍有下行压力,但是政府基建支持力度较大,对经济形成较强支撑作用,下行速度在政府稳增长政策支持之下已经有所放缓,市场对于后续宽信用取得成效、经济企稳预期明显升温。

通胀预期也有所抬头,主要是由于非洲猪瘟进一步发酵,猪肉价格2月见底之后开始明显反弹,市场担忧对CPI形成抬升效应。

政策面方面,2019年政策仍然延续前期思路,着力支持信用扩张,力求疏通货币政策传导机制,并且吸取2018年政策过晚推出的教训,稳增长政策提前出台,力图努力稳住经济。

债券市场方面,1月份债券收益率下行,2月份由于风险偏好回升债市出现一定幅度调整,3月份债券市场呈现震荡行情。

本基金在报告期内,根据组合自身的特点,进行相应的资产配置,同时根据资金面的变化,择机调整久期,进行波段操作,为持有人创造了与组合特征相匹配的稳健收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2019年03月31日,天弘现金管家A类本报告期净值收益率为0.6700%,天弘现金管家B类本报告期净值收益率为0.7298%,天弘现金管家C类本报告期净值收益率为0.6825%,天弘现金管家D类本报告期净值收益率为0.6700%,天弘现金管家E类本报告期净值收益率为0.6705%,同期业绩比较基准收益率为0.3381%。

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。

§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	3,926,155,433.88	37.36
	其中:债券	3,926,155,433.88	37.36
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	4,038,433,977.66	38.43
	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	2,505,078,592.41	23.84
4	其他资产	38,470,939.14	0.37
5	合计	10,508,138,943.09	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

序号	项目	占基金资产净值比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额	10.11	
	其中:买断式回购融资	-	
序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	354,038,309.00	3.49
	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比例应取报告期内每个交易日融资余额占基金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,下同。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

在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基金资产净值的20%。

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	57
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	109
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	43

注:投资组合平均剩余期限指交易日的组合平均剩余期限,若报告期末为非交易日,"报告期末投资组合平均剩余期限"项目则列示非交易日的数据。

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。

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	39.85	3.49
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)—60天	2.07	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)—90天	43.59	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)—120天	7.35	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	120天(含)—397天(含)	10.31	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	103.17	3.49

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

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。

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	463,082,864.45	4.56
2	央行票据	-	-
3	金融债券	99,999,556.78	0.99
	其中:政策性金融债	50,003,729.37	0.49
4	企业债券	200,012,418.86	1.97
5	企业短期融资券	790,511,848.89	7.79
6	中期票据	190,948,292.77	1.88
7	同业存单	2,181,600,452.13	21.50
8	其他	-	-
9	合计	3,926,155,433.88	38.69
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名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	111811265	18平安银行CD265	4,000,000	397,055,159.11	3.91
2	111808222	18中信银行CD222	3,000,000	297,785,842.95	2.93
3	111807181	18招商银行CD181	2,000,000	198,582,157.45	1.96
4	111815534	18民生银行CD534	2,000,000	198,303,934.40	1.95
5	111811287	18平安银行CD287	2,000,000	198,015,578.55	1.95
6	199911	19贴现国债11	1,900,000	189,156,069.23	1.86
7	111812187	18北京银行CD187	1,900,000	188,711,426.06	1.86
8	111803160	18农业银行CD160	1,600,000	158,836,452.92	1.57
9	136455	16银河G1	1,500,000	150,027,165.04	1.48
10	199908	19贴现国债08	1,200,000	119,568,794.42	1.18

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	0
报告期内偏离度的最高值	0.0991%
报告期内偏离度的最低值	0.0542%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0800%

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。

5.8 报告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。

5.9 投资组合报告附注

5.9.1 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1.00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。

5.9.2 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。

5.9.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	126,437.27
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	31,170,130.41
4	应收申购款	7,174,371.46
5	其他应收款	-
6	其他	-
7	合计	38,470,939.14

5.9.4 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

	天弘现金管家A类	天弘现金管家B类	天弘现金管家C类	天弘现金管家D类	天弘现金管家E类
报告期期初基金份额总额	298,918,887.48	790,558,535.10	449,572,342.32	5,177,022.33	5,472,455,540.32
报告期期间基金总申购份额	36,149,042.25	24,434,142.97	461,380,757.33	791,225.93	45,897,214,756.38
报告期期间基金总赎回份额	111,972,144.05	469,591,134.37	532,102,300.73	2,200,096.33	42,172,719,317.99
报告期期末基金份额总额	223,095,785.68	345,401,543.70	378,850,798.92	3,768,151.93	9,196,950,978.71

注:总申购份额含红利再投、分级份额调增和转换转入份额;总赎回份额含分级份额调减和转换转出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未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

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。

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现金管家货币市场基金募集的文件

2、天弘现金管家货币市场基金基金合同

3、天弘现金管家货币市场基金托管协议

4、天弘现金管家货币市场基金招募说明书

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

二〇一九年四月十九日