天弘荣享定期开放债券型发起式证券投资基金 2019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:兴业银行股份有限公司
送出日期:2019年08月24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一以上独立董事签字同意,并由董事长签发。
基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2019年08月21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。
本基金组一投资者持有的基金份额或者构成一致行动人的多个投资者持有的基金份额可达到或者超过50%,本基金不向个人投资者公开销售。
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2019年01月01日起至2019年06月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	天弘荣享
基金主代码	006871
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018年06月25日
基金管理人	天弘基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,957,221,679.30份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在控制信用风险、谨慎投资的前提下,力争在获取持有期收益的同时,实现基金资产的长期稳定增值。
投资策略	(一)封闭期投资策略 本基金将在控制信用风险、谨慎投资的前提下,力争在获取持有期收益的同时,实现基金资产的长期稳定增值。基于此目标,本基金将在分发展基金管理人的研究优势,将规范的实策研究、严谨的个券分析与积极主动的投资风格相结合,在分析和判断宏观经济运行状况和金融市场运行趋势的基础上,动态调整固定收益类资产配置比例,自上而下动态债券组合久期及债券类属配置。在严谨深入的基本面分析和信用分析基础上,综合考量各类债券的流动性、供求关系、风险及收益率水平等,自下而上地精选个券。(二)开放期投资策略 开放期内,本基金为保持较高的组合流动性,方便投资人安排投资,在遵守本基金有关投资限制与投资比例的前提下,将主要投资于高流动性的投资品种,减小基金净值的波动。
业绩比较基准	中债综合全价(总值)指数收益率
风险收益特征	本基金为债券型基金,其预期收益和风险高于货币市场基金,但低于股票型基金和混合型基金。

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	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	童建林	龚小武
	联系电话	022-83310208	021-52629999-212056
	电子邮箱	service@thfund.com.cn	gongxiaowu@cib.com.cn
客户服务电话		95046	95561
传真		022-83935569	021-62159217

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(2019年01月01日-2019年06月30日)
本期已实现收益	74,962,543.98
本期利润	57,793,339.51
加权平均基金份额本期利润	0.0208
本期基金份额净值增长率	2.36%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2019年06月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0044
期末基金资产净值	3,005,014,361.98
期末基金份额净值	1.0162

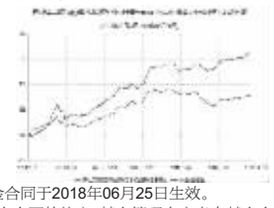
注:1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如,开放式基金的申购赎回费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
3、本基金《基金合同》2018年06月25日起生效。

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	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	0.49%	0.03%	0.28%	0.03%	0.21%	0.00%
过去三个月	0.86%	0.05%	-0.24%	0.06%	1.10%	-0.01%
过去六个月	2.36%	0.07%	0.24%	0.06%	2.12%	0.01%
过去一年	6.64%	0.08%	2.82%	0.06%	3.82%	0.02%
自基金合同生效起至今	6.54%	0.08%	3.14%	0.06%	3.40%	0.02%

注:本基金的业绩比较基准为:中债综合全价(总值)指数收益率。中债综合全价(总值)指数是由中央国债登记结算有限责任公司编制,样本债券涵盖的范围更加全面,具有广泛的市场代表性,涵盖主要交易市场(银行间市场、交易所市场等)、不同发行主体(政府、企业等)和期限(长期、中期、短期等),能够很好地反映中国债券市场总体价格水平和变动趋势。中债综合指数各项指标值的时间序列更加完整,有利于更加深入地研究和分析市场。在综合考虑了指数的权威性和代表性、指数的编制方法和本基金的投资范围和投资理念,本基金选择市场认同度较高的中债综合全价(总值)指数收益率作为业绩比较基准,该业绩比较基准能够比较真实的反映本基金投资组合的风险收益特征。
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2018年06月25日生效。
2、按照本基金合同的约定,基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。本基金的建仓期为2018年06月25日至2018年12月24日,建仓期结束时及至报告期末,各项资产配置比例均符合基金合同的约定。

§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2019年6月30日,本基金管理人共管理49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、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、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、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、天弘沿宝货币市场基金、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、天弘穗利一年定期开放债券型证券投资基金、天弘弘丰增强回报债券型证券投资基金、天弘港股通精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、天弘增强回报债券型证券投资基金、天弘安益债券型证券投资基金、天弘华享三个月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		
姜晓丽	本基金基金经理。	2018年6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。
赵鼎龙	本基金基金经理助理。	2018年11月	-	5年	男,电子学硕士,历任Micron Asia产品分析师、泰康资产管理有限责任公司固收交易员,2017年8月加盟本公司,历任本公司投资经理助理。

注:1、基金经理任职日期为基金合同生效日。基金经理助理任职日期为聘任日期。
2、本基金经理助理协助基金经理进行投资、研究、头寸管理等日常工作,不具有独立决策职能。
3、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的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析
2019年以来,经济在前期政策调整及贸易战缓和带动下,库存周期下行最快阶段已经过去,社融数据及中长期贷款数据也在1-2月份出现企稳,进入2季度经济动能边际有所趋缓,美国经济加库存的行为开始逆转,制造业库存还在累积,建筑业链条的景气依旧较好,但是逐步在年中进入淡季。货币政策年初两次降准后,在两会前后转向稳定,并未出台进一步宽松的政策,并在3月底4月初政策出现了微调,收紧了流动性,但是在4月底贸易战重新出现波折后,又转向对冲性的政策,随后在5月份出现包商银行被托管事件,为了应对市场的恐慌情绪,央行在公开市场投放了大量的流动性,态度重现转向友好。金融市场方面在政策见底、经济企稳带动下,权益市场出现回暖,市场风险偏好提升,利率债在年初下行后转向震荡,信用债出现结构分化,高等级出现震荡,低等级短端信用利差不断压缩。
运作期内,年初开放期后基金的规模有所增长,当时考虑收益率继续下行的空间不大,主要配置的是2年内高等级的信用债,在春节后判断经济开工较旺,主动减仓,将组合杠杆率降低到140%左右的水平,同时降低了久期,在4月份收益率冲高后,判断货币政策重新转向温和后,主动增加了3年内高等级的持仓,并提高了组合的杠杆,但在包商事件爆发后第一时间为了避免事件演化不确定性对债券市场的影响,减持了组合中长久期的资产,并降低了组合的久期。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现
截至2019年06月30日,本基金份额净值为1.0162元,本报告期份额净值增长率2.36%,同期业绩比较基准增长率0.24%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

经济基本面方面,年初以来建筑业活动较强,地产施工端有一定支撑,制造业经历了1年多左右的去库存,制造业进一步下行的空间有限,经济后续企稳回升的概率较高。政策方面,央行在2季度出现贸易战反复、包商银行事件后,对货币政策进行了调整,大量投放了流动性,对冲市场预期的恶化,目前市场流动性处于充裕的水平。6月底以来,贸易战有所缓和,包商事件对流动性的冲击有所弱化,从央行近期措辞来看,资金利率中枢有抬升的压力。但偏中长期来看,由于本轮经济的企稳对政策的依赖度较高,复苏主要体现在对融资敏感的建筑业链条,叠加外围美联储降息,因此目前还看不到宽松政策的退出。债券市场上,由于估值水平接近年初降准后的低点,估值保护较差,市场存在降息的预期,若央行不能在未来1个季度兑现降息,若叠加经济的逐步企稳,收益率存在一定的上行压力。但是货币政策在未来1个季度不会出现明显转向,收益率调整幅度相对有限。传统债券盈利来源中,我们认为久期的价值下降,信用利差较低的背景下信用的价值下降,杠杆价值相对中性,信用债内部骑乘策略有一定的空间。

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订与估值相关的定价服务协议。

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》、《天弘荣享定期开放债券型发起式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2次分红。以2019年03月05日已实现的可分配收益39,997,313.89元为基准计算,2019年03月20日向本基金的基金份额持有人按每10份基金份额派发红利0.122元。以2019年06月10日已实现的可分配收益53,820,648.18元为基准计算,2019年06月18日向本基金的基金份额持有人按每10份基金份额派发红利0.164元。2次分红均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

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

报告期内,本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,诚信、尽责地履行了基金托管人义务,不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内,本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查,未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为;基金管理人在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认真复核了本半年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,认为其真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§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:天弘荣享定期开放债券型发起式证券投资基金
报告截止日:2019年06月30日

单位:人民币元

资产	本期末 2019年06月30日	上年度末 2018年12月31日
资产:		
银行存款	22,750,400.18	223,729.45
结算备付金	71,190,619.37	85,184,121.74
存出保证金	299,848.58	196,040.37
交易性金融资产	3,738,392,600.00	2,817,841,200.00
其中:股票投资	-	-
基金投资	-	-
债券投资	3,738,392,600.00	2,817,841,200.00
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	-	145,318.86
应收利息	64,346,790.29	45,933,859.77
应收股利	-	-
应收申购款	-	-
递延所得税资产	-	-
其他资产	-	-
资产总计	3,896,980,258.42	2,949,524,270.19
负债和所有者权益	本期末 2019年06月30日	上年度末 2018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	867,429,802.10	916,459,362.06
应付证券清算款	22,616,948.62	-
应付赎回款	-	-
应付管理人报酬	745,428.48	518,653.37
应付托管费	248,476.15	172,884.45
应付销售服务费	-	-
应付交易费用	38,971.45	33,332.30
应交税费	237,534.99	266,936.45
应付利息	540,557.51	125,539.06
应付利润	-	-
递延所得税负债	-	-
其他负债	108,177.14	149,000.00
负债合计	891,965,896.44	917,725,707.69
所有者权益:		
实收基金	2,957,221,679.30	1,990,198,180.61
未分配利润	47,792,682.68	41,600,381.89
所有者权益合计	3,005,014,361.98	2,031,798,562.50
负债和所有者权益总计	3,896,980,258.42	2,949,524,270.19

注:1、报告截止日2019年06月30日,基金份额净值1.0162元,基金份额总额2,957,221,679.30份。
2、本财务报表的比较期间为2018年06月25日(基金合同生效日)至2018年06月30日(下同)。

6.2 利润表

会计主体:天弘荣享定期开放债券型发起式证券投资基金
本报告期:2019年01月01日至2019年06月30日

单位:人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日	上年度可比期间 2018年06月25日(基金合同生效日)至2018年06月30日
一、收入	79,276,367.78	-715,385.45
1.利息收入	77,054,522.57	893,089.60
其中:存款利息收入	713,778.67	228,260.47
债券利息收入	76,338,336.78	125,421.77
资产支持证券利息收入	-	-
买入返售金融资产收入	2,407.12	539,407.36
其他利息收入	-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)	19,391,049.68	-
其中:股票投资收益	-	-
基金投资收益	-	-
债券投资收益	19,391,049.68	-
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	-	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	-17,169,204.47	-1,608,475.05
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	21,483,028.27	177,835.38
1. 管理人报酬	4,264,126.56	41,483.10
2. 托管费	1,421,375.45	13,827.70
3. 销售服务费	-	-
4. 交易费用	41,969.75	1,055.73
5. 利息支出	15,430,219.93	116,283.68
其中:卖出回购金融资产支出	15,430,219.93	116,283.68
6. 税金及附加	196,758.88	448.29
7. 其他费用	128,577.70	4,736.88
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)	57,793,339.51	-893,220.83
减:所得税费用	-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)	57,793,339.51	-893,220.83

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:天弘荣享定期开放债券型发起式证券投资基金
本报告期:2019年01月01日至2019年06月30日

单位:人民币元

项目	本期 2019年01月01日至2019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)	1,990,198,180.61	41,600,381.89	2,031,798,562.50
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	57,793,339.51	57,793,339.51
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)	967,023,498.69	32,975,501.31	999,999,000.00
其中:1.基金申购款	967,023,498.69	32,975,501.31	999,999,000.00
2.基金赎回款	-	-	-
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)	-	-84,576,540.03	-84,576,540.03
五、期末所有者权益(基金净值)	2,957,221,679.30	47,792,682.68	3,005,014,361.98
项目	上年度可比期间 2018年06月25日(基金合同生效日)至2018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)	1,009,999,200.02	-	1,009,999,200.02
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-893,220.83	-893,220.83
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)	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
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)	1,009,999,200.02	-893,220.83	1,009,105,979.19

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	薄贺龙	肖慧敏
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况
天弘荣享定期开放债券型发起式证券投资基金(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[2018]136号《关于准予天弘荣享定期开放债券型发起式证券投资基金注册的批复》注册,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《天弘荣享定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式、发起式基金,以定期开放的方式运作,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集1,009,999,000.00元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2018)第0432号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《天弘荣享定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》于2018年6月25日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,009,999,200.02份基金份额,其中认购资金利息折合200.02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,基金托管人为兴业银行股份有限公司。
本基金为发起式基金,发起资金认购部分为10,000,200.02份基金份额,发起资金认购方承诺使用发起资金认购的基金份额持有期限不少于3年。
本基金的第一个封闭期为自基金合同生效之日(含)起至三个月对日的前一日(含)为止。首个封闭期结束之后次日(含)起进入首个开放期,下一个封闭期为首个开放期结束之日次日(含)起至三个月对日的前一日(含),以此类推。封闭期内不开放申购和赎回业务,也不上市交易。每个开放期时长不超过20个工作日。
根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘荣享定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金投资于国内依法发行和上市交易的国债、金融债、地方政府债、企业债、公司债、央行票据、中期票据、短期融资券、超短期融资债、资产支持证券、次级债、中小企业私募债、证券公司短期公司债券、同业存单、可转换债券(含可分离交易可转债)、可交换债、债券回购、银行存款以及国债期货等法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但须符合中国证监会的相关规定。本基金不投资股票或权证等权益类资产,也不参与一级市场新股申购或新股增发,但可持有因可转债转股所形成的股票、因持有该股票所派发的权证以及因投资分离交易可转债而产生的权证等资产,因上述原因持有的股票和权证等资产,本基金将在其可交易之日起的十个交易日内卖出。本基金对债券资产的投资比例不低于基金资产的80%。但应开放期流动性需要,为保护基金份额持有人利益,在每次开放期开始前10个工作日、开放期及开放期结束后10个工作日的期间内,基金投资不受上述比例限制。开放期内,本基金每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,持有现金或者到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%,在封闭期内,本基金不受上述5%的限制,但每个交易日日终在扣除国债期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于交易保证金一倍的现金。前述现金不包括结算备付金、存出保证金、应收申购款等。本基金的业绩比较基准为:中债综合全价(总值)指数收益率。

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》、《天弘荣享定期开放债券型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。
本财务报表以本基金持续经营为基础编制。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明
本基金2019年度上半年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2019年06月30日的财务状况以及2019年度上半年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、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表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 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[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、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》、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》、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》、财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》、财税[2017]90号《关于租入固定资产进项税额抵扣等增值税政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:
(1)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。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。
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。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日起产生的利息及利息性质的收入为销售额。资管产品管理人运营资管产品转让2017年12月31日前取得的基金、非货物期货,可以选择按照实际买入价计算销售额,或者以2017年最后一个交易日的基金份额净值、非货物期货结算价格作为买入价计算销售额。
(2)对基金从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。
(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。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(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。
(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。
(5)本基金的城市维护建设税、教育费附加、地方教育费附加和防洪工程维护费等税费按照实际缴纳增值税额的适用比例计算缴纳。

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、注册登记机构
兴业银行股份有限公司("兴业银行")	基金托管人

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 2019年01月01日至2019年06月30日	上年度可比期间 2018年06月25日(基金合同生效日)至2018年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	4,264,126.56	41,483.10
其中:支付销售机构的客户维护费	-	-

注:1、支付基金管理人天弘基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值0.30%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 X 0.30% / 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 2019年01月01日至2019年06月30日	上年度可比期间 2018年06月25日(基金合同生效日)至2018年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	1,421,375.45	13,827.70

注:支付基金托管人兴业银行股份有限公司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X 0.10%/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

份额单位:份

项目	本期 2019年01月01日至2019年06月30日	上年度可比期间 2018年06月25日(基金合同生效日)至2018年06月30日
基金合同生效日(2018年06月25日)持有的基金份额	-	10,000,200.02
报告期初持有的基金份额	10,000,200.02	-
报告期间申购/买入总份额	-	-
报告期间拆分变动份额	-	-
减:报告期间赎回/卖出总份额	-	-
报告期末持有的基金份额	10,000