

天弘中证环保产业指数型发起式证券投资基金

[2016]第四季度报告

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
报告送出日期:2017年1月20日

§ 1 重要提示

基金管理人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。
本基金名称“天弘中证环保产业指数型发起式证券投资基金”于2017年1月18日复牌了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等定期报告，因涉及定期报告的披露，因此本报告不包含定期报告的内容。
基金管理人承诺定期报告不存在虚假记载、误导性陈述和重大遗漏，并保证基金信息的真实、准确、完整。
本基金的过往业绩并不代表本基金未来的业绩表现，投资有风险，投资者在作出投资决策前应阅读本基金的招募说明书。
本基金报告期自2016年10月1日起至2016年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

项目	金额	占基金资产的比例(%)
1. 现金类资产	98,223,646.09	53.27
其中：银行存款	98,223,646.09	53.27
2. 基金投资	-	-
3. 固定收益投资	-	-
其中：银行存款	-	-
4. 货币市场基金	-	-
5. 贷款及应收款项	-	-
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	86,170,170.02	46.71
8. 其他资产	34,066.46	0.02
9. 合计	104,476,702.07	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末(按投资品种)按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产的比例(%)
A 农、林、牧、渔业	-	-	-
B 制造业	-	-	-
C 制造业	63,757,293.01	60.73	
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业	15,291,200.09	14.33	
E 建筑业	6,306,497.95	6.01	
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	3,170,080.01	2.97	
J 金融业	996,268.94	0.03	
K 房地产业	-	-	-
L 租赁和商务服务业	1,216,204.03	1.14	
M 科学、技术服务业	-	-	-
O 国际贸易、代理和经纪业	-	-	-
P 教育	-	-	-
Q 文化、体育和娱乐业	-	-	-
R 其他服务业	1,150,265.00	1.12	
9. 合计	96,253,460.01	92.07	

注:1. 本期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。本期利润为本期实现收益加上本期公允价值变动收益。
2. 所述各项绩效指标均不包括持有人认购或交易本基金的各项费用(例如,开放式基金的申购赎回费等),计算费用后实际收益水平可能低于所列数字。

3. 本基金合同自2015年7月16日生效。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本基金报告期内基金净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

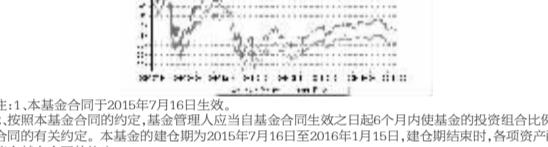
天弘中证环保产业A

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	-1.13%	0.03%	-0.76%	0.01%	-0.36%	-0.01%

天弘中证环保产业C

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	-1.21%	0.03%	-0.76%	0.01%	-0.43%	-0.01%

3.2.2 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2015年7月16日生效。
2. 按照本基金合同的约定,基金管理人应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2015年7月16日至2016年1月15日,建仓期结束时,各项资产配置比例均符合基金合同的约定。

3.4 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间	证券从业年限	说明
刘冬	本基金基金经理	2015年6月7日	—	10年 男,经济学硕士,2007年7月至2008年10月在国泰君安证券股份有限公司任研究员;2008年1月在鹏华基金管理有限公司任研究员;2009年1月在国泰基金管理有限公司任研究员;宏观经济研究员、宏观策略研究员;基金经理助理等。

注:1. 上述任职日期为基金经理合同生效日。
2. 本基金的含义遵从《证券投资基金从业人员资格管理规定》的有关规定。

4.2 管理人对报告期内基金运作风险状况的说明

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

本基金在投资决策过程中实行集中交易制度,建立公平交易机制,对不同投资组合公平对待,不存在利益输送行为。

报告期内,公司公平交易程序运行良好,未发现异常情况;场外、场内两个公平交易制度执行情况良好,未发现异常情况。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本基金在投资决策过程中实行集中交易制度,对不同投资组合公平对待,不存在利益输送等交易行为。

本基金在投资决策过程中实行集中交易制度,对不同投资组合公平对待,不存在利益输送等交易行为。