

信息披露 Disclosure

天弘中证环保产业指数型发起式证券投资基金

[2017] 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:广发证券股份有限公司
报告送出日期:2017年4月22日

\$1 重要提示

基金管理人和基金托管人承诺本基金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:广发证券股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年4月18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,保证复核结果与本报告一致。

基金管理人和基金托管人承诺本报告不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金的过往业绩并不代表未来表现。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。

本基金的销售机构详见“风险揭示”。

本基金的管理费每日计提。

本基金的管理费自2017年4月1日起至2017年3月31日止。

\$2 基金产品概况

基金管理人:天弘中证环保产业

基金主代码:001690

基金运作方式:契约型开放式,发起式

基金合同生效日:2016年7月16日

报告期末基金份额总额:126,067,122,648份

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:本基金主要通过投资于标的指数成份股、备选成份股以及权证类资产,并根据对指数成份股及其权重的变动进行相应调整,以复制和追踪标的指数。本基金在严格控制基金的日常操作风险和流动性风险的前提下,力求获得与标的指数相似的投资收益。

业绩比较基准:中证环保产业指数(人民币)×95%+银行存款利率(税后)×5%

风险收益特征:本基金为股票型基金,属于较高风险、较高收益的基金品种,其预期风险与预期收益水平高于货币市场基金、债券基金与货币型理财基金。

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

下分级基金的基本情况:天弘中证环保产业A 001690

天弘中证环保产业C 001691

报告期末下级基金的份额总额:19,700,662.47份

106,280,460.11份

\$3 主要财务指标和基金净值表现

单位:人民币元

主要财务指标

报告期(2017年1月1日-2017年3月31日)

天弘中证环保产业A 天弘中证环保产业C

1.本期已实现收益 -26,792.89 -164,332.04

2.本期利润 277,813.96 88,031.50

3.加权平均基金份额本期利润 0.0133 0.0110

4.期末基金资产净值 16,196,742.94 88,942,910.27

5.期末基金份额净值 0.9221 0.9310

注:1.本期利润为本期已实现收益加上本期利润。

2.本期利润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),计价费用后实际可供分配的利润。

3.本基金的利润指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),计价费用后实际可供分配的利润。

4.基金管理费每日自动扣收。

5.基金净值表现

3.21 本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

天弘中证环保产业A

阶段 净值增长(%) 净值增长标准差(收益类型) 业绩比较基准收益率(收益类型) 收益率差值(%)

过去三个月 1.24% 0.07% 1.72% 0.04% -0.30% 0.03%

天弘中证环保产业C

阶段 净值增长(%) 净值增长标准差(收益类型) 业绩比较基准收益率(收益类型) 收益率差值(%)

过去三个月 1.20% 0.07% 1.72% 0.04% -0.47% 0.03%

3.22 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变化及其与同期业绩比较基准收益率变化的比较

图例:天弘中证环保产业A 天弘中证环保产业C

注:1.本基金合同于2016年7月16日生效。

2.本基金报告期内,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(或基金经理助理)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, 2016年7月 11年 男,经济学硕士。2000年7月至2004年6月就职于某证券公司研究所,历任研究员、行业研究员、高级分析师;2004年7月至今就职于本公司,历任公司宏观经济研究员、宏观策略研究员、宏观经济研究员、宏观策略研究员。

注:1.上述任职日期为基金合同生效日。

2.从事宏观经济从行业协会到证券从业人员资格管理办法的相关规定。

3.本基金基金经理刘冬先生因个人原因辞去本公司基金经理一职,由刘冬先生于2017年4月17日增聘张子江先生为本基金基金经理;由刘冬先生于2017年4月17日离职,不再担任本基金基金经理。

4.2 管理人报告

基金管理人依照法律法规及基金合同的约定定期披露信息,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 公平交易执行情况

本基金公平交易制度健全且符合相关法律法规的规定,不存在利益输送行为。

本基金公平交易制度健全且符合相关法律法规的规定,不存在利益输送行为。