

天弘中证食品饮料指数型发起式证券投资基金2016年半年度报告

2016年06月30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

送出日期：2016年08月29日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 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2016年8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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2016年01月01日起至2016年06月30日止。

## 1.2 目录

§1 重要提示及目录.....	2
1.1 重要提示.....	2
1.2 目录.....	3
§2 基金简介.....	5
2.1 基金基本情况.....	5
2.2 基金产品说明.....	5
2.3 基金管理人和基金托管人.....	6
2.4 信息披露方式.....	6
2.5 其他相关资料.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	6
3.1 主要会计数据和财务指标.....	6
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告.....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
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.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	12
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	12
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	13
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.....	13
§5 托管人报告.....	13
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	13
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.....	13
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.....	13
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	15
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	18
§7 投资组合报告.....	38
7.1 期末基金资产组合情况.....	38
7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合.....	39
7.3 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.....	41
7.4 报告期内股票投资组合的重大变动.....	44
7.5 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	46
7.6 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.....	46
7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细.....	46
7.8 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.....	46
7.9 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.....	46
7.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明.....	46
7.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明.....	46
7.12 投资组合报告附注.....	46
§8 基金份额持有人信息.....	47
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	47
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况.....	48
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	48
8.4 发起式基金发起资金持有份额情况.....	48
§9 开放式基金份额变动.....	49
§10 重大事件揭示.....	49

10.1	基金份额持有人大会决议 .....	49
10.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 .....	49
10.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 .....	49
10.4	基金投资策略的改变 .....	50
10.5	基金改聘会计师事务所情况 .....	50
10.6	管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况 .....	50
10.7	本期基金租用证券公司交易单元的有关情况 .....	50
10.8	其他重大事件 .....	50
§11	备查文件目录 .....	54
11.1	备查文件目录 .....	54
11.2	存放地点 .....	55
11.3	查阅方式 .....	55

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	天弘中证食品饮料指数型发起式证券投资基金	
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	31,768,097.62份	
基金合同存续期	不定期	
下属两级基金的基金简称	天弘中证食品饮料A	天弘中证食品饮料C
下属两级基金的交易代码	001631	001632
报告期末下属两级基金的份 额总额	25,127,433.71份	6,640,663.91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拟合复制标的指数，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	010-84447272
	电子邮箱	service@thfund.com.cn	yjz@citics.com
客户服务电话		4007109999	010-60836588
传真		022-83865569	010-84447094
注册地址		天津自贸区(中心商务区)响螺湾旷世国际大厦A座1704-241号	广东省深圳市福田区中心三路8号卓越时代广场(二期)北座
办公地址		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	北京市朝阳区亮马桥路甲40号二十一世纪大厦8层
邮政编码		300203	100125
法定代表人		井贤栋	张佑君

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	上海证券报
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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
注册登记机构	天弘基金管理有限公司	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

## § 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

单位：人民币元

	报告期（2016年1月1日-2016年6月30日）	
3.1.1 期间数据和指标	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	-386,005.13	-59,194.54
本期利润	-642,765.12	15,690.02
加权平均基金份额本期利润	-0.0223	0.0027
本期基金加权平均净值利润率	-2.36%	0.29%
本期基金份额净值增长率	-2.25%	-2.32%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016年6月30日)	
期末可供分配利润	-467,079.20	-136,931.11
期末可供分配基金份额利润	-0.0186	-0.0206
期末基金资产净值	26,188,736.01	6,906,206.14
期末基金份额净值	1.0422	1.0400
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2016年6月30日)	
基金份额累计净值增长率	4.22%	4.00%

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、期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

4、本基金合同2015年7月29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 (天弘中证食品饮料A)	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	5.21%	1.37%	5.15%	1.41%	0.06%	-0.04%
过去三个月	7.44%	1.44%	6.67%	1.46%	0.77%	-0.02%
过去六个月	-2.25%	1.97%	-3.05%	1.95%	0.80%	0.02%

自基金合同生效日起至今（2015年07月29日-2016年06月30日）	4.22%	1.87%	-1.00%	1.97%	5.22%	-0.10%
阶段 (天弘中证食品饮料C)	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	5.22%	1.37%	5.15%	1.41%	0.07%	-0.04%
过去三个月	7.44%	1.44%	6.67%	1.46%	0.77%	-0.02%
过去六个月	-2.32%	1.97%	-3.05%	1.95%	0.73%	0.02%
自基金合同生效日起至今（2015年07月29日-2016年06月30日）	4.00%	1.87%	-1.00%	1.97%	5.00%	-0.10%

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7月29日生效。

2、按照本基金《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2015年7月29日-2016年1月29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、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	2%

伙)	
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2016年6月30日,本基金管理人共管理48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、天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金、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、天弘通利债券型证券投资基金、天弘同利分级债券型证券投资基金、天弘瑞利分级债券型证券投资基金、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、天弘增益宝货币市场基金、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、天弘普惠养老保本混合型证券投资基金、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、天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金、天弘中证全指运输指数型发起式证券投资基金、天弘中证移动互联网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、天弘中证高端装备制造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100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、天弘中证环保产业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、天弘中证休闲娱乐指数型发起式证券投资基金、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、天弘鑫安宝保本混合型证券投资基金、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。

#### 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期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
刘冬	本基金基金经理。	2015年07月	—	10年	男,经济学硕士。2007年7月至2008年10月在长江证券股份有限公司研究部任

					宏观策略研究员。 2008年11月加盟本公司， 历任投资部固定收益研究 员、宏观策略研究员、基 金基金经理助理等。
--	--	--	--	--	---

注：1、上述任职日期为基金合同生效日。

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 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明

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

本报告期内，股市在1季度波动较为剧烈，2季度逐渐转为平稳，波动率和振幅都明显下降。本基金根据指数化投资流程和定量研究，进行了基金的日常操作。跟踪误差来源主要是申购赎回、成分股停牌因素影响。根据基金合同的规定，对指数基金操作采取被动复制策略，结合市场趋势预判与量化分析，优化组合结构，使本基金与所跟踪指数的市场表现尽量一致，给投资者提供一个较好的指数投资工具。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2016年6月30日，天弘中证食品饮料A基金份额净值为1.0422元，天弘中证食品饮料C基金份额净值为1.0400元。报告期内份额净值增长率天弘中证食品饮料A为-2.25%，天弘中证食品饮料C为-2.32%，同期业绩比较基准增长率均为-3.05%。

#### 4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

国内经济总体仍然处于偏弱状态，但政策层面在稳经济、调结构方面均有措施出台，且对股票市场也是呵护的意愿；在上半年较大的信贷投放情况下，经济数据的实质性改善状态还是偏弱，经济结构性问题仍然较为突出，总体的盈利水平提升空间有限，市场大概率还是以结构性机会为主，较难有全局性机会。

#### 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、风险管理人员及监察稽核人员组成。

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

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

#### 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

本报告期内，本基金托管人在对天弘中证食品饮料指数型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

#### 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

本报告期内，天弘中证食品饮料指数型证券投资基金的管理人—天弘基金管理有限公司在天弘中证食品饮料指数型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内，天弘中证食品饮料指数型证券投资基金未进行利润分配。

#### 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：天弘中证食品饮料指数型发起式证券投资基金

报告截止日：2016年06月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016年06月30日	上年度末 2015年12月31日
<b>资产：</b>			
银行存款	6.4.7.1	1,687,196.55	2,687,371.85
结算备付金		65,515.01	113,606.04
存出保证金		22,064.26	19,226.88
交易性金融资产	6.4.7.2	31,295,755.25	31,401,599.75
其中：股票投资		31,295,755.25	31,401,599.75
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	6.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	—	—
应收证券清算款		967,138.05	—
应收利息	6.4.7.5	483.85	709.69
应收股利		—	—
应收申购款		256,407.80	822,593.25
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.6	4,423.04	—
资产总计		34,298,983.81	35,045,107.46
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末</b>	<b>上年度末</b>

		2016年06月30日	2015年12月31日
<b>负 债：</b>			
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		575.95	313,124.02
应付赎回款		1,106,832.36	323,083.83
应付管理人报酬		14,359.36	11,591.19
应付托管费		2,871.88	2,318.23
应付销售服务费		1,466.63	1,100.19
应付交易费用	6.4.7.7	5,708.89	6,042.00
应交税费		—	—
应付利息		—	—
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	6.4.7.8	72,226.59	73,888.61
负债合计		1,204,041.66	731,148.07
<b>所有者权益：</b>			
实收基金	6.4.7.9	31,768,097.62	32,190,741.27
未分配利润	6.4.7.10	1,326,844.53	2,123,218.12
所有者权益合计		33,094,942.15	34,313,959.39
负债和所有者权益总计		34,298,983.81	35,045,107.46

注：1、报告截止日2016年6月30日，天弘中证食品饮料指数型证券投资基金A类基金份额净值1.0422元，天弘中证食品饮料指数型证券投资基金C类基金份额净值1.0400元；基金份额总额31,768,097.62份，其中中证食品饮料指数型证券投资基金A类基金份额25,127,433.71份，中证食品饮料指数型证券投资基金C类基金份额6,640,663.91份。

2、本基金合同生效日为2015年7月29日，本财务报表的实际编制期间为2016年1月1日至2016年6月30日，无上一年度可比期间(下同)。

## 6.2 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：2016年01月01日-2016年06月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016年01月01日-2016年06月30日
<b>一、收入</b>		-415,923.48
1. 利息收入		9,659.04
其中：存款利息收入	6.4.7.11	9,659.04
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		-262,445.99
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-541,890.73
基金投资收益		—
债券投资收益	6.4.7.13	—
资产支持证券投资收益		—
贵金属投资收益	6.4.7.14	—
衍生工具收益	6.4.7.15	—
股利收益	6.4.7.16	279,444.74
3. 公允价值变动收益	6.4.7.17	-181,875.43
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	6.4.7.18	18,738.90
<b>减：二、费用</b>		211,151.62
1. 管理人报酬		81,171.57
2. 托管费		16,234.30
3. 销售服务费		6,757.85



4. 交易费用	6.4.7.19	27,810.97
5. 利息支出		—
其中：卖出回购金融资产支出		—
6. 其他费用	6.4.7.20	79,176.93
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		-627,075.10
减：所得税费用		—
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		-627,075.10

### 6.3 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：2016年01月01日-2016年06月30日

单位：人民币元

项目	本期 2016年01月01日-2016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)	32,190,741.27	2,123,218.12	34,313,959.39
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	-627,075.10	-627,075.10
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)	-422,643.65	-169,298.49	-591,942.14
其中：1. 基金申购款	65,543,950.48	-2,326,997.47	63,216,953.01
2. 基金赎回款	-65,966,594.13	2,157,698.98	-63,808,895.15
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)	31,768,097.62	1,326,844.53	33,094,942.15

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

韩海潮

薄贺龙

基金管理人

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

天弘中证食品饮料指数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[2015]1392号《关于核准天弘天弘中证食品饮料指数型发起式证券投资基金募集的批复》核准,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《天弘中证食品饮料指数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,存续期限不定,首次募集期间为2015年7月28日,首次设立募集不包括认购资金利息共募集10,000,000.00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(2015)第988号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《天弘中证食品饮料指数型发起式证券投资基金基金合同》于2015年7月29日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为10,000,000.00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,基金托管人为中信证券股份有限公司。

本基金为发起式基金,基金募集份额总额不少于1,000万份,基金募集金额不少于1,000万元,其中基金管理人作为发起资金的提供方认购的金额为1,000万元且承诺持有期限不少于三年。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘中证食品饮料指数型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,以中证食品饮料指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象。为更好地实现投资目标,本基金也可少量投资于其他股票(非标的指数成份股及其备选成份股,含中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、银行存款、债券、债券回购、权证、股指期货、资产支持证券、货币市场工具以及法律法规或中国证监会允许本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)。基金的投资组合比例为:本基金投资于股票的资产比例不低于基金资产的90%,投资于中证食品饮料指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的80%;本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。本基金的业绩比较基准:中证食品饮料指数收益率 $\times$ 95%+银行活期存款利率(税后) $\times$ 5%。

## 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>》、中国证券投资基金业协会(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》、《天弘中证食品饮料指数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列报。

## 6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2016年上半年度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截止2016年6月30日的财务状况以及2016年上半年度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[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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补充政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1) 于2016年5月1日前,以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起,金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。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，对金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(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。

#### 6.4.7 重要财务报表项目的说明

##### 6.4.7.1 银行存款

项目	本期末 2016年06月30日
活期存款	1,687,196.55
定期存款	—
其中：存款期限1-3个月	—
其他存款	—
合计	1,687,196.55

##### 6.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末2016年06月30日		
	成本	公允价值	估值增值
股票	30,058,129.95	31,295,755.25	1,237,625.30
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—
债券	交易所市场	—	—
	银行间市场	—	—
	合计	—	—

资产支持证券	—	—	—
其他	—	—	—
合计	30,058,129.95	31,295,755.25	1,237,625.30

#### 6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融工具。

#### 6.4.7.4 买入返售金融资产

##### 6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本报告期末未持有买入返售金融资产。

##### 6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有因买断式逆回购而取得的债券。

#### 6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年06月30日
应收活期存款利息	444.35
应收定期存款利息	—
应收其他存款利息	—
应收结算备付金利息	29.50
应收债券利息	—
应收买入返售证券利息	—
应收申购款利息	—
应收黄金合约拆借孳息	—
其他	10.00
合计	483.85

#### 6.4.7.6 其他资产

单位：人民币元

项目	本期末 2016年06月30日
其他应收款	—

待摊费用	4,423.04
合计	4,423.04

注：本基金本报告期末未持有其他资产。

#### 6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年06月30日
交易所市场应付交易费用	5,708.89
银行间市场应付交易费用	—
合计	5,708.89

#### 6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年06月30日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	2,068.13
预提费用	62,158.46
其他应付	8,000.00
合计	72,226.59

#### 6.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目 (天弘中证食品饮料A)	本期 2016年01月01日-2016年06月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	27,190,741.27	27,190,741.27
本期申购	53,433,499.58	53,433,499.58
本期赎回	-55,496,807.14	-55,496,807.14
期末数	25,127,433.71	25,127,433.71
项目 (天弘中证食品饮料C)	基金份额(份)	账面金额
上年度末	5,000,000.00	5,000,000.00

本期申购	12,110,450.90	12,110,450.90
本期赎回	-10,469,786.99	-10,469,786.99
期末数	6,640,663.91	6,640,663.91

注：申购含转换转入份额；赎回含转换转出份额。

#### 6.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目 (天弘中证食品饮料A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-172,214.37	1,971,808.81	1,799,594.44
本期利润	-386,005.13	-256,759.99	-642,765.12
本期基金份额交易产生的变动数	91,140.30	-186,667.32	-95,527.02
其中：基金申购款	-997,242.96	-1,212,332.47	-2,209,575.43
基金赎回款	1,088,383.26	1,025,665.15	2,114,048.41
本期已分配利润	—	—	—
本期末	-467,079.20	1,528,381.50	1,061,302.30

单位：人民币元

项目 (天弘中证食品饮料C)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	-38,350.84	361,974.52	323,623.68
本期利润	-59,194.54	74,884.56	15,690.02
本期基金份额交易产生的变动数	-39,385.73	-34,385.74	-73,771.47
其中：基金申购款	-308,482.29	191,060.25	-117,422.04
基金赎回款	269,096.56	-225,445.99	43,650.57

本期已分配利润	—	—	—
本期末	-136,931.11	402,473.34	265,542.23

#### 6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年01月01日-2016年06月30日
活期存款利息收入	9,122.07
定期存款利息收入	—
其他存款利息收入	—
结算备付金利息收入	328.57
其他	208.40
合计	9,659.04

#### 6.4.7.12 股票投资收益

##### 6.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2016年01月01日-2016年06月30日
股票投资收益——买卖股票 差价收入	-541,890.73
股票投资收益——赎回差价 收入	—
合计	-541,890.73

##### 6.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年01月01日-2016年06月30日
卖出股票成交总额	16,840,974.67
减：卖出股票成本总额	17,382,865.40
买卖股票差价收入	-541,890.73



#### 6.4.7.13 债券投资收益

本基金本报告期未取得债券投资收益。

#### 6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期未取得贵金属投资收益。

#### 6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期未取得衍生工具投资收益。

#### 6.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期
	2016年01月01日-2016年06月30日
股票投资产生的股利收益	279,444.74
基金投资产生的股利收益	—
合计	279,444.74

#### 6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期
	2016年01月01日-2016年06月30日
1. 交易性金融资产	-181,875.43
——股票投资	-181,875.43
——债券投资	—
——资产支持证券投资	—
——贵金属投资	—
2. 衍生工具	—
——权证投资	—
3. 其他	—
合计	-181,875.43

#### 6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期
	2016年01月01日-2016年06月30日
基金赎回费收入	18,639.47
天弘中证食品饮料C	11.52
天弘中证食品饮料A	87.91
合计	18,738.90

注：本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额中归入基金资产的比例按持有期间递减且不低于25%。

#### 6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期
	2016年01月01日-2016年06月30日
交易所市场交易费用	27,810.97
银行间市场交易费用	—
合计	27,810.97

#### 6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期
	2016年01月01日-2016年06月30日
审计费用	13,009.38
信息披露费	49,726.04
汇划手续费	441.51
指数使用费	16,000.00
合计	79,176.93

#### 6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 6.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至本财务报表批准报出日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

#### 6.4.9 关联方关系

##### 6.4.9.1 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。

##### 6.4.9.2 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
中信证券股份有限公司(“中信证券”)	基金托管人

注：上述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

#### 6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

###### 6.4.10.1.1 股票交易

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年01月01日-2016年06月30日	
	成交金额	占当期股票成交总额的比例
中信证券	34,274,861.00	100.00%

###### 6.4.10.1.2 权证交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行权证交易。

###### 6.4.10.1.3 应支付关联方的佣金

金额单位：人民币元

关联方名称	本期 2016年01月01日-2016年06月30日			
	当期佣金	占当期佣金总量的比例	期末应付佣金余额	占应付佣金余额的比例
中信证券	7,928.37	100.00%	5,708.89	100.00%

注：1、上述佣金参考市场价格经本基金的基金管理人与对方协商确定，以扣除由中国证券登记结算有限责任公司收取的证管费和经手费的净额列示。

2、该类佣金协议的服务范围还包括佣金收取方为本基金提供的证券投资研究成果和市场信息服务等。

#### 6.4.10.2 关联方报酬

##### 6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

关联方名称	本期
	2016年01月01日-2016年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	81,171.57
其中：支付销售机构的客户维护费	21,520.28

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0.50%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 0.50% / 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。

##### 6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

关联方名称	本期
	2016年01月01日-2016年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	16,234.30

注：支付基金托管人中信证券的托管费按前一日基金资产净值0.1%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 0.1% / 当年天数。

##### 6.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期		
	2016年01月01日-2016年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	天弘中证食品饮料 A	天弘中证食品饮料 C	合计
天弘基金管理有限公	—	5,864.46	5,864.46

司			
合计	—	5,864.46	5,864.46

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给天弘基金管理有限公司，再由天弘基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：

日销售服务费=前一日基金资产净值 X 0.25%/ 当年天数。

#### 6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

#### 6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 6.4.10.4.1 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 2016年01月01日-2016年06月30日	
	天弘中证食品饮料A	天弘中证食品饮料C
期初持有的基金份额	5,000,000.00	5,000,000.00
期间申购/买入总份额	—	—
期间因拆分变动份额	—	—
减：期间赎回/卖出总份额	—	—
期末持有的基金份额	5,000,000.00	5,000,000.00
占基金总份额比例	15.74%	15.74%

注：基金管理人天弘基金管理有限公司在本年度申购本基金的交易委托直销柜台办理，适用费率为每笔1000元。

##### 6.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

##### 6.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期
-------	----

	2016年01月01日-2016年06月30日	
	期末余额	当期利息收入
中信证券活期存款	1,687,196.55	9,122.07

注：本基金的银行存款存放在具有基金托管资格的中国工商银行股份有限公司，按银行同业利率计息。

#### 6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期未在承销期内参与关联方承销证券交易。

#### 6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

#### 6.4.11 利润分配情况

本基金本报告期未进行利润分配。

#### 6.4.12 期末（2016年06月30日）本基金持有的流通受限证券

##### 6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 6.4.12.2 期末持有的暂时停牌股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量	期末成本总额	期末估值总额
002567	唐人神	2016-05-16	拟披露重大事项	13.98	2016-07-29	13.23	13,000	139,756.97	181,740.00
000639	西王食品	2016-05-27	重大资产重组	14.12			9,400	143,552.80	132,728.00
002387	黑牛食品	2016-05-25	重大资产重组	16.26	2016-08-03	17.55	15,600	250,603.55	253,656.00
002447	壹桥海参	2016-03-09	重大资产重组	7.19			28,300	279,150.40	203,477.00
002515	金字火腿	2016-02-03	重大资产重组	9.59	2016-07-27	10.55	13,770	180,868.00	132,054.30

注：本基金截至2016年6月30日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

##### 6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2016年6月30日，本基金未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2016年6月30日，本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

### 6.4.13 金融工具风险及管理

#### 6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具，以中证食品饮料指数的成份股及其备选成份股为主要投资对象，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拟合复制标的指数，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。

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。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以审计与风险控制委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，董事会负责监督检查公司的合法合规运营、内部控制、风险管理，从而控制公司的整体运营风险。在董事会下设立审计与风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理委员会，主要负责根据公司总体风险控制目标，将交易、运营风险控制目标和要求分配到各部门；讨论、协调各部门之间的风险管理过程；听取各部门风险管理工作方面的汇报，确定未来一段时间各部门应重点关注的风险点，并调整与改进相关的风险处理和策略；讨论向公司高级管理层提交的基金运作风险报告。在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部负责，对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理提供合规控制标准，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标；监察稽核部对公司总经理负责，并由督察长分管。风险管理部通过投资交易系统的风控参数设置，保证各投资组合的投资比例合规；参与各投资组合新股申购、一级债申购、银行间交易等场外交易的风险识别

与评估，保证各投资组合场外交易的事中合规控制；负责各投资组合投资绩效、风险的计量和控制。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制可在可承受的范围内。

#### 6.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在具有基金托管资格的中国工商银行股份有限公司，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

于2016年6月30日，本基金未持有债券。

#### 6.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场上出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理



方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此除附注6.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于2016年6月30日，本基金所持有的其他金融负债的合同约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

#### 6.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 6.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金及存出保证金等。

##### 6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计

2016年06月30日					
资产					
银行存款	1,687,196.55	—	—	—	1,687,196.55
结算备付金	65,515.01	—	—	—	65,515.01
存出保证金	22,064.26	—	—	—	22,064.26
交易性金融资产	—	—	—	31,295,755.25	31,295,755.25
应收证券清算款	—	—	—	967,138.05	967,138.05
应收利息	—	—	—	483.85	483.85
应收申购款	—	—	—	256,407.80	256,407.80
其他资产	—	—	—	4,423.04	4,423.04
资产总计	1,774,775.82	—	—	32,524,207.99	34,298,983.81
负债					
应付证券清算款	—	—	—	575.95	575.95
应付赎回款	—	—	—	1,106,832.36	1,106,832.36
应付管理人报酬	—	—	—	14,359.36	14,359.36
应付托管费	—	—	—	2,871.88	2,871.88
应付销售服务费	—	—	—	1,466.63	1,466.63
应付交易费用	—	—	—	5,708.89	5,708.89
其他负债	—	—	—	72,226.59	72,226.59
负债总计	—	—	—	1,204,041.66	1,204,041.66
利率敏感度缺口	1,774,775.82	—	—	31,320,166.33	33,094,942.15

上年度末 2015年12月31 日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	2,687,371.85	—	—	—	2,687,371.85
结算备付金	113,606.04	—	—	—	113,606.04
存出保证金	19,226.88	—	—	—	19,226.88
交易性金融资产	—	—	—	31,401,599.75	31,401,599.75
应收利息	—	—	—	709.69	709.69
应收申购款	—	—	—	822,593.25	822,593.25
资产总计	2,820,204.77	—	—	32,224,902.69	35,045,107.46
负债					
应付证券清算款	—	—	—	313,124.02	313,124.02
应付赎回款	—	—	—	323,083.83	323,083.83
应付管理人报酬	—	—	—	11,591.19	11,591.19
应付托管费	—	—	—	2,318.23	2,318.23
应付销售服务费	—	—	—	1,100.19	1,100.19
应付交易费用	—	—	—	6,042.00	6,042.00
其他负债	—	—	—	73,888.61	73,888.61
负债总计	—	—	—	731,148.07	731,148.07
利率敏感度缺口	2,820,204.77	—	—	31,493,754.62	34,313,959.39

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

#### 6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于 2016年6月30日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

#### 6.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 6.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金投资于股票的资产比例不低于基金资产的90%，投资于中证食品指数成份股和备选成份股的资产比例不低于非现金基金资产的80%；本基金每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后，应当保持不低于基金资产净值5%的现金或到期日在一年以内的政府债券。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

#### 6.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

单位：人民币元

项目	本期末 2016年06月30日		上年度末 2015年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例 (%)	公允价值	占基金资产净值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	31,295,755.25	94.56	31,401,599.75	91.51

交易性金融资产-债券投资	—	—	—	—
交易性金融资产-贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产-权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	31,295,755.25	94.56	31,401,599.75	91.51

#### 6.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注6.4.1)以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币元)	
		本期末 2016年06月30日	上年度末 2015年12月31日
1	业绩比较基准(附注6.4.1)上升5%	1,497,711.61	1,406,872.33
2	业绩比较基准(附注6.4.1)下降5%	-1,497,711.61	-1,406,872.33

#### 6.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1) 公允价值

##### (a) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次,由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:

第一层次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次:除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次:相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b) 持续的以公允价值计量的金融工具

## (i) 各层次金融工具公允价值

于2016年6月30日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为30,392,099.95元，属于第二层次的余额为903,655.30元，无属于第三层次的余额。(2015年12月31日，属于第一层次的余额为29,894,174.75元，属于第二层次的余额为1,507,425.00元，无属于第三层次的余额。)

## (ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间及交易不活跃期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

## (iii) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

## (c) 非持续的以公允价值计量的金融工具

于2016年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。(2015年12月31日：同)

## (d) 不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 7 投资组合报告

### 7.1 期末基金资产组合情况

金额单位：人民币元

序号	项目	金额	占基金总资产的比例 (%)
1	权益投资	31,295,755.25	91.24
	其中：股票	31,295,755.25	91.24
2	固定收益投资	—	—

	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
3	贵金属投资	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
6	银行存款和结算备付金合计	1,752,711.56	5.11
6	其他资产	1,250,517.00	3.65
7	合计	34,298,983.81	100.00

## 7.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

### 7.2.1 报告期末指数投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	4,161,013.94	12.57
B	采矿业	—	—
C	制造业	26,696,076.31	80.67
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	256,925.00	0.78
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	31,114,015.25	94.01

### 7.2.2 报告期末积极投资按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A	农、林、牧、渔业	—	—
B	采矿业	—	—
C	制造业	181,740.00	0.55
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	181,740.00	0.55

注：由于指数成份股调整，上表所列示股票被调出成份股后停牌，故以积极投资股票列示（下同）。



### 7.3 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

#### 7.3.1 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所有股票投资明细

金额单位：人民币元

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	11,918	3,479,102.56	10.51
2	600887	伊利股份	200,323	3,339,384.41	10.09
3	000858	五粮液	89,000	2,895,170.00	8.75
4	002304	洋河股份	29,800	2,143,216.00	6.48
5	000568	泸州老窖	35,000	1,039,500.00	3.14
6	000895	双汇发展	48,800	1,018,944.00	3.08
7	300498	温氏股份	16,364	592,704.08	1.79
8	600873	梅花生物	91,050	565,420.50	1.71
9	002299	圣农发展	20,100	520,590.00	1.57
10	002714	牧原股份	10,200	515,406.00	1.56
11	000729	燕京啤酒	64,500	489,555.00	1.48
12	300146	汤臣倍健	35,700	483,378.00	1.46
13	002477	雏鹰农牧	77,100	460,287.00	1.39
14	000860	顺鑫农业	18,300	435,174.00	1.31
15	600597	光明乳业	30,200	382,936.00	1.16
16	603288	海天味业	12,400	376,960.00	1.14
17	600600	青岛啤酒	12,800	372,096.00	1.12
18	600073	上海梅林	32,100	367,545.00	1.11
19	600298	安琪酵母	19,800	353,232.00	1.07
20	000848	承德露露	27,700	331,015.00	1.00
21	600872	中炬高新	25,700	317,138.00	0.96
22	002505	大康农业	80,220	312,858.00	0.95
23	600702	沱牌舍得	12,300	310,452.00	0.94
24	600559	老白干酒	12,600	301,896.00	0.91
25	002570	贝因美	23,600	301,844.00	0.91

26	600809	山西汾酒	12,800	283,904.00	0.86
27	000596	古井贡酒	5,600	268,520.00	0.81
28	000869	张裕A	6,400	257,152.00	0.78
29	600238	海南椰岛	21,500	256,925.00	0.78
30	002387	黑牛食品	15,600	253,656.00	0.77
31	600186	莲花味精	46,900	249,039.00	0.75
32	000735	罗牛山	36,700	236,715.00	0.72
33	300149	量子高科	12,500	230,625.00	0.70
34	600059	古越龙山	22,300	229,467.00	0.69
35	002329	皇氏集团	15,280	229,047.20	0.69
36	002650	加加食品	31,400	223,254.00	0.67
37	600300	维维股份	36,700	217,998.00	0.66
38	600084	中葡股份	32,700	210,261.00	0.64
39	002447	壹桥海参	28,300	203,477.00	0.61
40	000911	南宁糖业	7,700	193,116.00	0.58
41	600305	恒顺醋业	16,500	190,080.00	0.57
42	600965	福成五丰	14,600	189,508.00	0.57
43	002568	百润股份	8,600	189,200.00	0.57
44	600257	大湖股份	16,900	188,097.00	0.57
45	600199	金种子酒	16,900	187,590.00	0.57
46	000752	西藏发展	11,800	186,676.00	0.56
47	000019	深深宝A	13,650	185,094.00	0.56
48	002086	东方海洋	20,002	175,017.50	0.53
49	002286	保龄宝	11,500	172,270.00	0.52
50	002604	龙力生物	15,700	169,403.00	0.51
51	002646	青青稞酒	7,900	162,819.00	0.49
52	600132	重庆啤酒	10,500	159,495.00	0.48
53	600197	伊力特	10,600	159,424.00	0.48
54	600616	金枫酒业	15,500	158,410.00	0.48
55	600429	三元股份	20,100	157,383.00	0.48

56	002321	华英农业	16,200	152,604.00	0.46
57	000972	中基健康	27,100	152,302.00	0.46
58	600467	好当家	39,000	151,710.00	0.46
59	600543	莫高股份	11,100	151,626.00	0.46
60	600365	通葡股份	11,400	150,366.00	0.45
61	600381	青海春天	10,400	142,376.00	0.43
62	600975	新五丰	15,500	141,825.00	0.43
63	603020	爱普股份	6,100	139,629.00	0.42
64	002495	佳隆股份	17,800	135,280.00	0.41
65	002216	三全食品	15,500	133,300.00	0.40
66	000639	西王食品	9,400	132,728.00	0.40
67	002515	金字火腿	13,770	132,054.30	0.40
68	002746	仙坛股份	3,002	125,123.36	0.38
69	002548	金新农	6,900	121,164.00	0.37
70	300094	国联水产	7,800	114,036.00	0.34
71	300175	朗源股份	12,300	111,192.00	0.34
72	000529	广弘控股	12,800	104,704.00	0.32
73	002461	珠江啤酒	8,800	102,256.00	0.31
74	603589	口子窖	2,700	97,767.00	0.30
75	002719	麦趣尔	2,001	97,208.58	0.29
76	603866	桃李面包	2,101	94,040.76	0.28
77	002770	科迪乳业	7,100	86,123.00	0.26
78	000929	兰州黄河	5,800	85,666.00	0.26
79	002726	龙大肉食	5,400	81,702.00	0.25
80	603198	迎驾贡酒	3,400	81,294.00	0.25
81	300106	西部牧业	5,440	81,056.00	0.24
82	002330	得利斯	6,400	68,736.00	0.21
83	603696	安记食品	1,600	66,720.00	0.20

### 7.3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002567	唐人神	13,000	181,740.00	0.55

## 7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 7.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例（%）
1	600887	伊利股份	1,374,091.00	4.00
2	600519	贵州茅台	974,098.00	2.84
3	000858	五粮液	946,301.00	2.76
4	002304	洋河股份	904,127.00	2.63
5	300498	温氏股份	672,718.68	1.96
6	000895	双汇发展	563,000.96	1.64
7	300146	汤臣倍健	408,747.00	1.19
8	002714	牧原股份	374,317.00	1.09
9	000972	中基健康	365,122.00	1.06
10	000568	泸州老窖	360,679.00	1.05
11	002329	皇氏集团	360,097.08	1.05
12	002286	保龄宝	339,896.00	0.99
13	002568	百润股份	336,164.00	0.98
14	600873	梅花生物	298,050.00	0.87
15	600073	上海梅林	286,067.00	0.83
16	600238	海南椰岛	268,068.00	0.78
17	002299	圣农发展	262,436.00	0.76
18	600597	光明乳业	261,901.00	0.76
19	000729	燕京啤酒	243,321.40	0.71
20	002477	雏鹰农牧	240,644.00	0.70

注：本项的“买入金额”均按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 7.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例 (%)
1	600519	贵州茅台	2,262,687.20	6.59
2	600887	伊利股份	1,628,138.96	4.74
3	000858	五粮液	1,061,961.00	3.09
4	002304	洋河股份	857,693.00	2.50
5	000895	双汇发展	446,970.00	1.30
6	603369	今世缘	421,243.55	1.23
7	000568	泸州老窖	380,375.00	1.11
8	002329	皇氏集团	319,728.00	0.93
9	002568	百润股份	308,247.60	0.90
10	002714	牧原股份	277,860.00	0.81
11	600298	安琪酵母	274,680.00	0.80
12	002557	洽洽食品	264,551.00	0.77
13	600090	啤酒花	260,247.00	0.76
14	002299	圣农发展	252,888.00	0.74
15	300146	汤臣倍健	245,842.00	0.72
16	600238	海南椰岛	228,559.00	0.67
17	600597	光明乳业	209,196.00	0.61
18	000729	燕京啤酒	206,639.00	0.60
19	603288	海天味业	205,427.00	0.60
20	002477	雏鹰农牧	200,054.08	0.58

注：本项“卖出金额”均按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	17,458,896.33
卖出股票收入（成交）总额	16,840,974.67

注：本项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

## 7.5 期末按债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。

## 7.6 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。

## 7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

## 7.8 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。

## 7.9 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。

## 7.10 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。

## 7.11 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。

## 7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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。

## 7.12.3 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	22,064.26
2	应收证券清算款	967,138.05
3	应收股利	—

4	应收利息	483.85
5	应收申购款	256,407.80
6	其他应收款	—
7	待摊费用	4,423.04
8	其他	—
9	合计	1,250,517.00

#### 7.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

#### 7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

##### 7.12.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限情况。

##### 7.12.5.2 期末积极投资前五名股票中存在流通受限情况的说明

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	002567	唐人神	181,740.00	0.55	披露重大事项 停牌

#### 7.12.6 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。

## § 8 基金份额持有人信息

### 8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额	持有份额	占总份额

				比例		比例
天弘中证食品饮料A	118,138	212.70	5,000,000.00	19.90%	20,127,433.71	80.10%
天弘中证食品饮料C	265	25,059.11	5,000,000.00	75.29%	1,640,663.91	24.71%
合计	118,403	268.30	10,000,000.00	31.48%	21,768,097.62	68.52%

注：机构/个人投资者持有基金份额占总份额比例的计算中，针对A、C类分级基金，比例的分母采用A、C类各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用A、C类分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

## 8.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本开放式基金	天弘中证食品饮料A	5,776.59	0.02%
	天弘中证食品饮料C	—	—
	合计	5,776.59	0.02%

## 8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

本基金本报告期末未有本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人及基金经理持有本开放式基金份额的情况。

## 8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	31.48%	10,000,000.00	31.48%	3年



基金管理人高级管理人员	—	—	—	—	
基金经理等人员	—	—	—	—	
基金管理人股东	—	—	—	—	
其他	—	—	—	—	
合计	10,000,000.00	31.48%	10,000,000.00	31.48%	3年

注：报告期末持有份额总数为发起份额总数。

## § 9 开放式基金份额变动

单位：份

	天弘中证食品饮料A	天弘中证食品饮料C
基金合同生效日(2015年07月29日)基金份额总额	5,000,000.00	5,000,000.00
本报告期期初基金份额总额	27,190,741.27	5,000,000.00
本报告期基金总申购份额	53,433,499.58	12,110,450.90
减：本报告期基金总赎回份额	55,496,807.14	10,469,786.99
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	25,127,433.71	6,640,663.91

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。

## § 10 重大事件揭示

### 10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会决议。

### 10.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，宁辰先生已离任本公司副总经理职务，敬请投资者关注本公司于2016年4月30日披露的《天弘基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

#### 10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略没有改变。

#### 10.5 基金改聘会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生变化。

#### 10.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况

本报告期内本基金管理人、托管人及其高级管理人员没有发生受稽查或处罚的情况。

#### 10.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：

券商名称	交易单元数量	股票交易		债券交易		债券回购交易		权证交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占股票成交总额比例	成交金额	占债券成交总额比例	成交金额	占债券回购成交总额比例	成交金额	占权证成交总额比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
中信证券	2	34,274,861.00	100.00%	—	—	—	—	—	—	7,928.37	100.00%	

注：1、基金专用交易单元的选择标准为：该证券经营机构财务状况良好，各项财务指标显示公司经营情况稳定；经营行为规范，内控制度健全，最近两年未因重大违规行为受到监管机关的处罚；研究实力较强，能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、市场分析报告、行业研究报告、个股分析报告及全面的信息服务等；

2、基金专用交易单元的选择程序：本基金管理人根据上述标准进行考察后，确定选用交易席位的证券经营机构。然后基金管理人和被选用的证券经营机构签订交易席位租用协议；

3、本期新租用交易单元情况：本期无新租用交易单元；

4、本基金报告期内停止租用交易单元：无。

#### 10.8 其他重大事件

序号	公告事项	信息披露方式	披露日期
1	天弘基金管理有限公司关于2016年1月4日指数熔断期间调整旗下部分基金开放时间的公告	中国证监会指定媒介	2016-01-04

2	天弘基金管理有限公司关于在指数熔断实施期间调整旗下交易所场内基金开放时间的公告	中国证监会指定媒介	2016-01-06
3	天弘基金管理有限公司关于2016年1月7日指数熔断期间调整旗下部分基金开放时间的公告	中国证监会指定媒介	2016-01-07
4	天弘基金管理有限公司关于增加上海长量基金销售投资顾问有限公司为旗下基金代销机构并开通定投及转换业务以及参加其相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-01-08
5	天弘基金管理有限公司关于增加深圳市新兰德证券投资咨询有限公司为旗下基金代销机构并开通定投及转换业务以及参加其相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-01-14
6	天弘基金管理有限公司关于增加中经北证（北京）资产管理有限公司为旗下基金代销机构并开通定投及转换业务以及参加其相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-01-20
7	天弘中证食品饮料指数型发起式证券投资基金2015年第4季度报告	中国证监会指定媒介	2016-01-22
8	天弘基金管理有限公司关于对使用余额宝支付功能申购的投资者开展费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-01-28
9	天弘基金管理有限公司关于增加上海好买基金销售有限公司为旗下基金代销机构并开通定投及转换业务以及参加其相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-02-01
10	天弘基金管理有限公司关于增加	中国证监会指定媒介	2016-02-15

	上海陆金所资产管理有限公司为旗下基金代销机构并参加其相关费率优惠活动的公告		
11	天弘基金管理有限公司关于对使用“财富通”银联支付渠道进行申（认）购的投资者开展费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-02-24
12	天弘基金管理有限公司关于增加北京葱次方资产管理有限公司为旗下基金代销机构并开通定投及转换业务以及参加其相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-03-04
13	天弘中证食品饮料指数型发起式证券投资基金招募说明书(更新)	中国证监会指定媒介	2016-03-04
14	天弘中证食品饮料指数型发起式证券投资基金招募说明书(更新)摘要	中国证监会指定媒介	2016-03-04
15	天弘基金管理有限公司关于提醒客户谨防虚假客服电话诈骗的风险提示公告	中国证监会指定媒介	2016-03-05
16	天弘基金管理有限公司关于对使用余额宝支付功能申（认）购的投资者开展费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-03-09
17	天弘基金管理有限公司关于增加上海中正达广投资管理有限公司为旗下基金代销机构并开通定投及转换业务以及参加其相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-03-11
18	天弘中证食品饮料指数型发起式证券投资基金2015年年度报告摘要	中国证监会指定媒介	2016-03-30
19	天弘中证食品饮料指数型发起式证券投资基金2015年年度报告	中国证监会指定媒介	2016-03-30

20	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金参加深圳市新兰德证券投资咨询有限公司申购及定投费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-04-01
21	天弘基金管理有限公司广州分公司关于营业场所变更的公告	中国证监会指定媒介	2016-04-07
22	天弘基金管理有限公司关于增加上海利得基金销售有限公司为旗下基金代销机构以及参加其相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-04-08
23	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金参加北京葱次方资产管理有限公司申购等费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-04-13
24	天弘基金管理有限公司关于增加珠海盈米财富管理有限公司为旗下基金代销机构并开通定投业务以及参加其相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-04-21
25	天弘中证食品饮料指数型发起式证券投资基金2016年第1季度报告	中国证监会指定媒介	2016-04-21
26	天弘基金管理有限公司关于增加上海天天基金销售有限公司为旗下基金代销机构并开通定投业务以及参加其相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-04-22
27	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会指定媒介	2016-04-23
28	天弘基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会指定媒介	2016-04-30
29	天弘基金管理有限公司关于参加中证金牛（北京）投资咨询有限公司相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-05-09

30	天弘基金管理有限公司关于增加泰信财富投资管理有限公司为旗下基金代销机构并开通转换业务以及参加其相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-05-11
31	天弘基金管理有限公司关于开展指定基金份额转换业务费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-05-18
32	天弘基金管理有限公司关于旗下基金参加杭州数米基金销售有限公司（认）申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-05-30
33	天弘基金管理有限公司关于增加北京蛋卷基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构并开通定投及转换业务以及参加其相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-05-30
34	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金开通基金转换业务的公告	中国证监会指定媒介	2016-06-07
35	天弘基金管理有限公司关于增加北京广源达信投资管理有限公司为旗下基金销售机构并开通转换业务以及参加其相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-06-16
36	天弘基金管理有限公司关于在网上交易系统开通易宝支付的第三方支付业务并实施申购费率优惠的公告	中国证监会指定媒介	2016-06-24

## § 11 备查文件目录

### 11.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准中证食品饮料指数型发起式证券投资基金募集的文件
- 2、天弘中证食品饮料指数型发起式证券投资基金基金合同

- 3、天弘中证食品饮料指数型发起式证券投资基金招募说明书（更新）
- 4、天弘中证食品饮料指数型发起式证券投资基金托管协议
- 5、天弘基金管理有限公司批准成立批件
- 6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告

## 11.2 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

## 11.3 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](http://www.thfund.com.cn)

天弘基金管理有限公司  
二〇一六年八月二十九日