

天弘中证食品饮料指数型发起式证券投资基金

2021年第3季度报告

2021年09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

报告送出日期:2021年10月27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。

基金托管人中信证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2021年10月25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2021年07月01日起至2021年09月30日止。

§ 2 基金产品概况

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
报告期末基金份额总额	2,919,462,382.49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。本基金产品投资策略主要包括大类资产配置策略、股票投资策略、债券投资策略、资产支持证券投资策略、参与融资及转融通证券出借业务策略、存托凭证投资策略、其他金融工具投资策略等。
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，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。	
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	
下属分级基金的基金简称	天弘中证食品饮料A	天弘中证食品饮料C
下属分级基金的交易代码	001631	001632
报告期末下属分级基金的份额总额	613,417,832.47份	2,306,044,550.02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(2021年07月01日 - 2021年09月30日)	
	天弘中证食品饮料A	天弘中证食品饮料C
1. 本期已实现收益	4,464,243.64	11,413,475.54
2. 本期利润	-162,220,659.62	-488,713,979.95
3. 加权平均基金份额本期利润	-0.2981	-0.2499
4. 期末基金资产净值	1,928,595,602.80	7,153,402,792.05
5. 期末基金份额净值	3.1440	3.1020

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。

3.2 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

天弘中证食品饮料A净值表现

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	-10.89%	2.09%	-11.46%	2.11%	0.57%	-0.02%

过去六个月	-2.22%	1.83%	-3.50%	1.84%	1.28%	-0.01%
过去一年	10.20%	1.90%	8.51%	1.91%	1.69%	-0.01%
过去三年	130.84%	1.76%	110.00%	1.78%	20.84%	-0.02%
过去五年	213.69%	1.58%	178.92%	1.60%	34.77%	-0.02%
自基金合同生效日起至至今	231.03%	1.61%	178.37%	1.64%	52.66%	-0.03%

天弘中证食品饮料C净值表现

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	-10.94%	2.09%	-11.46%	2.11%	0.52%	-0.02%
过去六个月	-2.32%	1.83%	-3.50%	1.84%	1.18%	-0.01%
过去一年	9.98%	1.90%	8.51%	1.91%	1.47%	-0.01%
过去三年	129.47%	1.76%	110.00%	1.78%	19.47%	-0.02%
过去五年	210.30%	1.58%	178.92%	1.60%	31.38%	-0.02%
自基金合同生效日起至至今	226.62%	1.61%	178.37%	1.64%	48.25%	-0.03%

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

天弘中证食品饮料A累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2015年07月29日-2021年09月30日)



天弘中证食品饮料C累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2015年07月29日-2021年09月30日)



- 注：1、本基金合同于2015年07月29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	证	说明
----	----	--------	---	----

		基金经理期限		券从业年限	
		任职日期	离任日期		
沙川	本基金基金经理	2019年10月	-	10年	男，数学硕士。历任中国中投证券有限责任公司量化分析师。2013年9月加盟本公司，历任金融工程研究员。

注：1、上述任职日期/离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

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。

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

本基金本报告期内不存在异常交易行为。本报告期内，本公司所有投资组合参与的交易所公开竞价交易中，未产生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%的交易，未导致不公平交易和利益输送。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

本基金在2021年3季度按照基金合同约定采用完全复制的投资策略来控制跟踪误差。并适当减少交易成本，以及参与新股申购和转融通证券出借业务，从而力争在跟踪误差允许范围内获取超额收益。

期间基金整体运行平稳，日均跟踪偏离和年化跟踪误差均控制在合理范围内，并取得了一定的超额收益。其中日均跟踪偏离和跟踪误差主要来自基金每日的申购赎回导致的基金仓位变化，指数成分股调整导致的结构偏离、指数成分股分红，以及持有的新股上市后涨幅与基准指数涨幅的差异。超额收益主要来自指数成分股分红、转融通证券出借业务产生的利息收入、基金所申购新股上市后的较大幅度涨幅。不过由于基金规模增加，新股贡献的超额收益下降。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2021年09月30日，天弘中证食品饮料A基金份额净值为3.1440元，天弘中证食品饮料C基金份额净值为3.1020元。报告期内份额净值增长率天弘中证食品饮料A为-10.89%，同期业绩比较基准增长率为-11.46%；天弘中证食品饮料C为-10.94%，同期业绩比较基准增长率为-11.46%。

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	8,602,368,786.09	93.42
	其中：股票	8,602,368,786.09	93.42
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	12,457,496.80	0.14
	其中：债券	12,457,496.80	0.14
	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	497,831,648.66	5.41
8	其他资产	95,683,663.70	1.04
9	合计	9,208,341,595.25	100.00

注：本报告期末，本基金参与转融通证券出借业务出借证券的公允价值为 830,624,500.00 元，占基金资产净值的比例为 9.15%。

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（指数投资）按行业分类的境内股票投资组合

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	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	8,597,518,235.79	94.67
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	-	-
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	8,597,518,235.79	94.67
--	----	------------------	-------

5.2.2 报告期末（积极投资）按行业分类的境内股票投资组合

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	18,116.82	0.00
B	采矿业	-	-
C	制造业	2,992,237.05	0.03
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	20,183.39	0.00
F	批发和零售业	70,022.52	0.00
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	3,345.12	0.00
I	信息传输、软件和信息技术服务业	1,679,635.36	0.02
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	19,443.64	0.00
N	水利、环境和公共设施管理业	38,613.78	0.00
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	8,952.62	0.00
S	综合	-	-
	合计	4,850,550.30	0.05

5.3 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

5.3.1 报告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	600887	伊利股份	27,079,250	1,020,887,725.00	11.24
2	600519	贵州茅台	463,413	848,045,790.00	9.34
3	000858	五粮液	3,362,135	737,618,797.65	8.12
4	000568	泸州老窖	3,261,287	722,635,973.46	7.96
5	600809	山西汾酒	2,172,896	685,548,688.00	7.55
6	603288	海天味业	5,627,459	619,020,490.00	6.82
7	002304	洋河股份	2,684,131	445,780,476.48	4.91
8	000799	酒鬼酒	1,012,863	250,916,550.99	2.76
9	000895	双汇发展	6,171,415	167,553,917.25	1.84
10	600132	重庆啤酒	1,077,662	141,421,584.26	1.56

5.3.2 积极投资按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名股票投资明细

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	601728	中国电信	394,011	1,556,343.45	0.02
2	688187	时代电气	33,865	1,472,788.85	0.02
3	688161	威高骨科	3,069	213,172.74	0.00
4	688772	珠海冠宇	12,960	187,012.80	0.00
5	688613	奥精医疗	2,617	168,194.59	0.00

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	10,129,496.80	0.11

2	央行票据	-	-
3	金融债券	-	-
	其中：政策性金融债	-	-
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	-	-
7	可转债（可交换债）	2,328,000.00	0.03
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	12,457,496.80	0.14

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	019649	21国债01	61,210	6,125,896.80	0.07
2	019645	20国债15	40,000	4,003,600.00	0.04
3	127046	百润转债	23,280	2,328,000.00	0.03

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	3,097,620.33
2	应收证券清算款	24,661.04
3	应收股利	-
4	应收利息	684,254.24
5	应收申购款	91,877,128.09
6	其他应收款	-
7	其他	-
8	合计	95,683,663.70

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

5.11.5.1 期末指数投资前十名股票中存在流通受限情况的说明

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	603288	海天味业	70,477,000.00	0.78	转融通证券出借
2	002304	洋河股份	63,409,344.00	0.70	转融通证券出借
3	000799	酒鬼酒	58,266,096.00	0.64	转融通证券出借
4	000568	泸州老窖	49,345,866.00	0.54	转融通证券出借
5	000858	五粮液	44,974,950.00	0.50	转融通证券出借
6	600887	伊利股份	37,341,850.00	0.41	转融通证券出借
7	60080	山西	24,987,600.00	0.28	转融通证券

	9	汾酒			出借
8	600132	重庆啤酒	12,506,219.00	0.14	转融通证券出借
9	000895	双汇发展	10,919,730.00	0.12	转融通证券出借

5.11.5.2 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	601728	中国电信	1,556,343.45	0.02	新股锁定
2	688187	时代电气	1,472,788.85	0.02	科创板打新限售
3	688161	威高骨科	213,172.74	0.00	科创板打新限售
4	688772	珠海冠宇	187,012.80	0.00	新股未上市
5	688613	奥精医疗	168,194.59	0.00	科创板打新限售

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

	天弘中证食品饮料A	天弘中证食品饮料C
报告期期初基金份额总额	443,368,245.62	1,428,416,926.17
报告期期间基金总申购份额	377,008,968.79	1,882,583,279.91
减：报告期期间基金总赎回份额	206,959,381.94	1,004,955,656.06
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	613,417,832.47	2,306,044,550.02

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

本报告期基金管理人未持有本基金份额。

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 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

本基金成立后有10,000,000份为发起份额，发起份额承诺的持有期限为2015年07月29日至2018年07月29日。截至本报告期末，发起资金持有份额为0.00份。

§ 9 影响投资者决策的其他重要信息

9.1 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。

9.2 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。

§ 10 备查文件目录

10.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准天弘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托管协议
- 4、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
- 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

10.2 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

10.3 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
二〇二一年十月二十七日