天弘安康养老混合型证券投资基金

【2015】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:中国工商银行股份有限公司
报告送出日期:2016年1月22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。
基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年1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。
本报告财务资料未经审计。
本报告期自2015年10月1日起至2015年12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	天弘安康养老混合
基金主代码	420009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年11月28日
报告期末基金份额总额	2,080,066,562.43份
投资目标	本基金主要投资于债券等固定收益类金融工具,辅助投资于精选的价值型股票,通过灵活的资产配置与严谨的风险管理,力求实现基金资产持续稳定增值,为投资者提供稳健的养老理财工具。
投资策略	本基金采取稳健的投资策略,通过债券等固定收益类资产的投资获取平稳收益,并适度参与股票等权益类资产的投资增强回报,在灵活配置各类资产以及严格的风险管理基础上,力争实现基金资产的持续稳定增值。
业绩比较基准	三年期银行定期存款利率(税后)+0.75%
风险收益特征	本基金为债券投资为主的混合型基金,属于中低风险、中低收益预期的基金品种,其风险收益预期高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金。
基金管理人	天弘基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

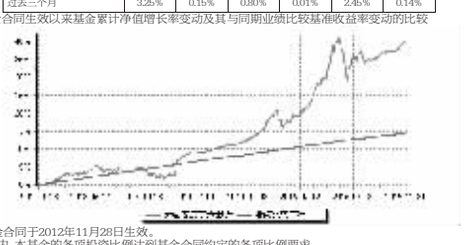
单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年10月1日-2015年12月31日)
1.本期已实现收益	99,960,801.79
2.本期利润	137,507,890.72
3.加权平均基金份额本期利润	0.0428
4.期末基金资产净值	2,906,536,484.21
5.期末基金份额净值	1.397

注:1、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。
2、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。
3.2 基金净值表现
3.2.1 本报告期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	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	3.25%	0.15%	0.80%	0.01%	2.45%	0.14%

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



注:1、本基金合同于2012年11月28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	任本基金的基金经理期限		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。	2013年1月	-	6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;本公司固定收益研究员、天弘永利债券型证券投资基金基金经理助理。
钱文成	本基金基金经理。	2014年1月	-	9年	男,理学硕士。2007年5月加盟本公司,历任行业研究员、高级研究员、策略研究员、研究主管助理、研究部副主管、研究副总监、研究总监、股票投资部副总经理、天弘精选混合恒证券投资基金基金经理助理。

注:1、上述任职日期为本基金管理人对外披露的任职日期。
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。
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。
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 报告期内基金的投资策略和运作分析
2015年4季度,经济基本面整体延续疲弱,虽然后半段经济有一定企稳迹象,但是弱势格局短期内无法根本性扭转。以基建投资扩张为核心的经济托底政策,无法充分对冲内需快速回落的冲击,只能在一定程度上延缓经济增速回落的速度,无法扭转整体的趋势。政策方面,经济下行压力大以及外汇流出加剧等因素使得货币政策依然处于宽松途中,央行于四季度继续进行了降准降息等宽松操作,呵护二季度以来流动性的宽松局面。资金面方面,得益于央行构建利率走廊的政策意图,资金利率稳定性显著提升。在基本面、政策面和资金面三方配合,以及资产荒格局下增量资金的涌入,债券收益率出现显著下行,尤其是利率债收益率一举突破前期低点,走出了一轮牛市。
本基金在报告期内,以债券仓位为主,同时在权益市场也加强了股票投资,重点投向了消费品、天然气、工业4.0、环保、TMT等行业,取得了一定的正收益。
4.5 报告期内基金的业绩表现
截至2015年12月31日,本基金份额净值为1.397元,本报告期份额净值增长率3.25%,同期基金业绩比较基准收益率0.80%。
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。
4.7 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望
展望2016年1季度,基本面方面,虽然前期稳增长政策的累积效应逐渐显现,对经济有一定支撑作用,但是经济下行压力仍存,且中央有意推进供给侧结构性改革,去产能过程将对经济增长形成进一步冲击,并且对CPI通胀也将形成制约,基本面对债市仍属利好。政策方面,虽然目前货币政策有转趋稳健的迹象,但在经济杠杆率较高、企业还本付息压力仍大的情况下宽松基调仍是应有之义,预计货币政策仍将维持稳健偏松态势。资金面方面,央行对于资金面的控制能力已经经过2015年的多重考验,而且目前央行也有动力维持资金面稳定,因此2016年资金面仍将维持相对稳定的态势,如果后续有进一步降息的操作,当前相对较高的资金利率大概率也将相应下调,从而打开债券收益率进一步下行的空间。除此之外,我们认为资产稀缺的状况难以发生根本性的扭转,资产荒的状况依旧具有持续性,债市仍有增量资金入场。综合以上因素,债券市场一季度行情整体仍将趋暖。
投资策略上,本基金将继续以债券仓位为主,同时将积极参与一级市场打新的机会,加强对二级市场个股投资,在风格偏成长,选股注重估值与增长相匹配,重点看好消费品、服务业以及TMT。

§5 投资组合报告

5.1 报告期末基金资产组合情况

金额单位:人民币元

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	279,618,066.86	8.62
	其中:股票	279,618,066.86	8.62
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	2,846,968,017.36	87.79
	其中:债券	2,846,968,017.36	87.79
	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	30,188,999.37	0.93
8	其他资产	86,243,404.82	2.66
9	合计	3,243,018,488.41	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

序号	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	143,306,953.25	4.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	19,565,880.95	0.67
E	建筑业	195,136.20	0.01
F	批发和零售业	18,562,769.44	0.64
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	26,588,208.18	0.91
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	14,548,254.00	0.50
M	科学研究和技术服务业	109,392.21	-
N	水利、环境和公共设施管理业	41,415,948.23	1.42
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	15,325,524.40	0.53
S	综合	-	-
	合计	279,618,066.86	9.62

5.3 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	603001	奥康国际	1,399,949	47,066,285.38	1.62
2	300070	碧水源	799,999	41,415,948.23	1.42
3	002184	海得控制	567,650	24,414,626.50	0.84
4	300182	捷成股份	1,000,000	24,000,000.00	0.83
5	300124	汇川技术	477,425	22,534,460.00	0.78
6	000669	金鸿能源	876,215	19,565,880.95	0.67
7	600153	建发股份	1,248,500	18,340,465.00	0.63
8	300178	腾邦国际	499,940	14,548,254.00	0.50
9	600136	道博股份	230,000	14,342,800.00	0.49
10	600660	福耀玻璃	871,200	13,233,528.00	0.46

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	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	280,771,000.00	9.66
	其中:政策性金融债	280,771,000.00	9.66
4	企业债券	2,006,092,898.03	69.02
5	企业短期融资券	211,234,000.00	7.27
6	中期票据	340,703,000.00	11.72
7	可转债	8,167,119.33	0.28
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,846,968,017.36	97.95

注:可转债项下包含可交换债7,515,162.20元。
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	150206	15国开06	1,500,000	150,645,000.00	5.18
2	1380231	13新郑债	1,000,000	104,710,000.00	3.60
3	011599500	15中油股SCP004	1,000,000	100,250,000.00	3.45
4	150301	15进出01	1,000,000	100,090,000.00	3.44
5	1280298	12奉化债	1,000,000	85,520,000.00	2.94

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

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	822,183.19
2	应收证券清算款	7,440,205.48
3	应收股利	-
4	应收利息	75,424,351.28
5	应收申购款	2,556,664.87
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	86,243,404.82

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

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	600153	建发股份	18,340,465.00	0.63	重大资产重组

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

报告期期初基金份额总额	3,609,417,521.95
报告期期间基金总申购份额	86,562,908.66
减:报告期期间基金总赎回份额	1,615,913,868.18
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	2,080,066,562.43

注:总申购份额含转换入份额;总赎回份额含转换出份额。

§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

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	90,771,558.25
报告期期间买入/申购总份额	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	90,771,558.25
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	4.36

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
本基金本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录
1、中国证监会批准天弘安康养老混合型证券投资基金募集的文件
2、天弘安康养老混合型证券投资基金基金合同
3、天弘安康养老混合型证券投资基金招募说明书
4、天弘安康养老混合型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及营业执照
8.2 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
8.3 查阅方式
投资者可到基金管理人的住所及网站或基金托管人的住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
二〇一六年一月二十二日

天弘创业板指数型发起式证券投资基金

【2015】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:国泰君安证券股份有限公司
报告送出日期:2016年01月22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。
基金托管人国泰君安证券股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年1月21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。
本报告财务资料未经审计。
本报告期自2015年10月1日起至2015年12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	天弘创业板	
基金主代码	001592	
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08日	
报告期末基金份额总额	39,426,430.15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拟的投资收益。	
业绩比较基准	创业板指数收益率×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。	
基金管理人	天弘基金管理有限公司	
基金托管人	国泰君安证券股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	天弘创业板A	天弘创业板C
下属分级基金的交易代码	001592	001593
报告期末下属分级基金的份额总额	34,426,430.15份	5,000,000.00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(2015年10月01日-2015年12月31日)	
	天弘创业板A	天弘创业板C
1.本期已实现收益	1,015,484.60	163,436.87
2.本期利润	4,730,025.21	1,126,120.91
3.加权平均基金份额本期利润	0.1710	0.2252
4.期末基金资产净值	36,395,234.33	5,270,436.24
5.期末基金份额净值	1.0572	1.0541

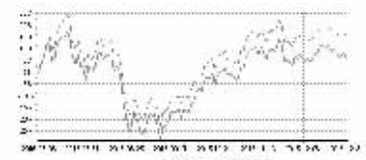
注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如,开放式基金的申购赎回费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
3.2 基金净值表现
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
天弘创业板A

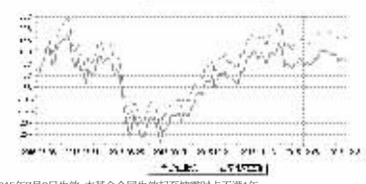
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	27.39%	2.46%	28.73%	2.43%	-1.34%	0.03%

天弘创业板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	27.17%	2.46%	28.73%	2.43%	-1.56%	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





注:1、本基金合同于2015年7月8日生效,本基金合同生效起至披露时点不满1年。
2、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8日-2016年1月7日,截止报告日本基金仍处于建仓期。

§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	-	9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月加入天弘基金管理有限公司,历任投资部固定收益研究员、宏观策略研究员、宏观策略分析师、天弘永利债券型证券投资基金基金经理助理、天弘稳金管家货币市场基金基金经理、天弘债券型发起式证券投资基金基金经理、天弘丰利债券型证券投资基金(LOF)基金经理。

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。
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
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 报告期内基金的投资策略和运作分析
报告期内,本基金尚在建仓期,年中股市剧烈波动造成较多的停牌股票,在四季度逐步开始复牌,由估值法对本基金造成的跟踪误差较大偏离的压力逐步开始缓解。后续,本基金依然会根据基金合同的规定,采取对指数的被动复制策略,结合市场趋势预判与量化分析的基础上,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投资工具性产品。
4.5 报告期内基金的业绩表现
截至2015年12月31日,天弘创业板A基金份额净值为1.0572元,天弘创业板C基金份额净值为1.0541元。报告期内份额净值增长率天弘创业板A为27.39%,天弘创业板C为27.17%,同期业绩比较基准增长率为28.73%。
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。
4.7 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,尽管之前货币政策与财政政策均已有较大宽松支持,但经济基本面的改善并不明显,总体经济效率的提升仍然取决于产业结构的重构与升级;同时,由于美联储进行了危机以来的第一次加息,以及后续仍然有一定加息预期,造成了近期人民币贬值压力较大,对股票市场有一定冲击影响。股票市场的机会仍然需要看到产业结构与经济基本面的改善,否则在此之前,股票市场难有全面性机会,更多的是以结构性机会,或新兴成长类行业机会为主。

§5 投资组合报告

5.1 报告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	38,195,384.20	89.79
	其中:股票	38,195,384.20	89.79
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	4,244,645.11	9.98
8	其他资产	97,763.40	0.23
9	合计	42,537,792.71	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(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(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	443,678.00	1.06
B	采矿业	190,476.00	0.46
C	制造业	16,163,885.00	38.79
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	200,080.00	0.48
E	建筑业	345,189.00	0.83
F	批发和零售业	99,000.00	0.24
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	14,555,618.00	34.93
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	954,102.00	2.29
M	科学研究和技术服务业	231,146.00	0.55
N	水利、环境和公共设施管理业	1,071,639.00	2.57
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	1,014,488.00	2.43
R	文化、体育和娱乐业	2,926,083.20	7.02
S	综合	-	-
	合计	38,195,384.20	91.67

5.2.2 报告期末(积极投资)按行业分类的股票投资组合
本基金本报告期末未持有积极投资股票。
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 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

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	300104	乐视网	37,000	2,226,660.00	5.34
2	300059	东方财富	36,100	1,878,283.00	4.51
3	300027	华谊兄弟	26,900	1,115,812.00	2.68
4	300024	机器人	15,700	1,075,450.00	2.58
5	300070	碧水源	20,700	1,071,639.00	2.57
6	300017	网宿科技	15,900	953,841.00	2.29
7	300168	万达信息	25,600	848,128.00	2.04
8	300058	蓝色光标	46,400	683,472.00	1.64
9	300124	汇川技术	13,100	618,320.00	1.48
10	300003	乐普医疗	16,000	617,600.00	1.48

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
本基金本报告期末未持有积极投资股票。
5.4 报告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。
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
本基金本报告期末未持有债券。
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

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	36,741.67
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,966.72
5	应收申购款	59,055.01
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	97,763.40

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

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	300104	乐视网	2,226,660.00	5.34	重大资产重组

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
本基金本报告期末未持有积极投资股票。
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

	天弘创业板A	天弘创业板C
报告期期初基金份额总额	15,061,078.71	5,000,000.00
报告期期间基金总申购份额	91,095,267.88	-
减:报告期期间基金总赎回份额	71,729,916.44	-
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	34,426,430.15	5,000,000.00

注:总申购份额含红利再投、转换入份额;总赎回份额含转换出份额。

§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

单位:份

	天弘创业板A	天弘创业板C
报告期期初管理人持有的本基金份额	5,000,000.00	5,000,000.00
报告期期间买入/申购总份额	-	-
报告期期间卖出/赎回总份额	-	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	5,000,000.00	5,000,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	12.68	12.68

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 备查文件目录

8.1 备查文件目录
1、中国证监会批准天弘创业板指数型发起式证券投资基金募集的文件
2、天弘创业板指数型发起式证券投资基金基金合同
3、天弘创业板指数型发起式证券投资基金招募说明书
4、天弘创业板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及营业执照
9.2 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
9.3 查阅方式
投资者可到基金管理人的注册登记地及网站或基金托管人的注册登记地免费查阅备查文件,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
二〇一六年一月二十二日

天弘丰利债券型证券投资基金(LOF)

【2015】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:中国邮政储蓄银行股份有限公司
报告送出日期:2016年1月22日

§1 重要提示及目录

1.1 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。
基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年1月21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。
本报告财务资料未经审计。
本报告期自2015年10月1日起至2015年12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	天弘丰利债券(LOF)
场内简称	天弘丰利
基金主代码	164208
交易代码	164208
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年11月23日
报告期末基金份额总额	1,354,393,886.91份
投资目标	本基金在追求基金资产稳定增值的基础上,力求获得高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金通过对宏观经济、利率走势、资金供求、信用风险状况、证券市场走势等方面的分析和预测,采取自上而下和自下而上相结合的投资策略,构建和调整固定收益证券投资组合并适度参与新股投资,力求实现风险与收益的优化平衡。
业绩比较基准	中债综合指数
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中较低风险的基金品种,其风险收益预期高于货币市场基金,低于混合型基金和股票型基金。