天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金

【2015】年度报告摘要

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
送出日期:2016年03月30日

§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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年3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。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

自2015年5月7日天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)终止上市之日起,原天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)名称变更为天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金。原天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)本报告期自2015年1月1日至2015年5月6日止,天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金本报告期自2015年5月7日至2015年12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

2.1.1 天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金(转型后)	
基金名称	天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	天弘鑫动力混合
基金主代码	164205
交易代码	164205
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年05月07日
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
报告期末基金份额总额	196,809,475.68份
基金合同存续期	不定期
2.1.2 天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)(转型前)	
基金名称	天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)
基金简称	天弘深证成份指数(LOF)
场内简称	天弘深成
基金主代码	164205
交易代码	164205
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年06月12日
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
报告期末基金份额总额	62,053,556.54份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2010年06月17日

2.2 基金产品说明

2.2.1 天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金(转型后)	
投资目标	本基金通过资产配置和灵活运用多种投资策略,把握市场机会,在有效控制风险的前提下力求获取高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金采取灵活资产配置,主动投资管理的投资模式。在投资策略上,本基金从两个层次进行,首先是进行大类资产配置,在一定程度上尽可能地降低证券市场的系统性风险,把握市场波动中产生的投资机会;其次是采取自下而上的分析方法,从定量和定性两个方面,通过深入的基本面研究分析,精选具有良好投资价值的投资品种,构建投资组合。
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	本基金为混合型基金,属于中等风险、中等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。
2.2.2 天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)(转型前)	
投资目标	本基金通过被动的指数化投资管理,实现对深证成份指数的有效跟踪,力求将基金净值收益率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差控制在0.35%以内,年跟踪误差控制在4%以内。
投资策略	本基金为被动式指数基金,采用指数复制投资策略,按照小股东的指数中的基准权重构建投票组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应地调整,以复制和跟踪标的指数。 当预期指数成份股调整和成份股将发生分红、配股、增发等行为时,或者因特殊情况(如成份股停牌、成份股流动性受限等)导致基金无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可以对基金的投资组合进行适当调整,并可在条件允许的情况下,辅以金融衍生工具进行投资管理,以有效控制基金的跟踪误差。
业绩比较基准	深证成份指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金,属于证券投资基金产品中高风险、高收益的基金品种,其风险收益预期高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	崔建林	洪渊
	联系电话	022-83310208	(010)66105799
	电子邮箱	service@thfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4007109999	95588
传真		022-83865669	010-66105798

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.thfund.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公地址

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标(转型后)

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2015年05月07日-2015年12月31日
本期已实现收益	75,767,019.88
本期利润	58,352,435.84
加权平均基金份额本期利润	0.0263
本期基金加权平均净值利润率	2.45%
本期基金份额净值增长率	17.03%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末
期末可供分配利润	-27,408,454.23
期末可供分配基金份额利润	-0.1393
期末基金资产净值	215,248,135.42
期末基金份额净值	1.0940
3.1.3 累计期末指标	2015年末
基金份额累计净值增长率	17.03%

3.2 主要会计数据和财务指标(转型前)

金额单位:人民币元

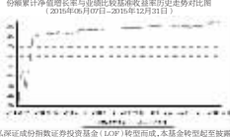
3.2.1 期间数据和指标	2015年01月01日-2015年05月06日	2014年	2013年
本期已实现收益	7,431,669.29	-9,649,589.79	-10,663,609.69
本期利润	18,085,821.33	16,533,914.15	-6,974,538.17
加权平均基金份额本期利润	0.2209	0.1939	-0.0723
本期基金加权平均净值利润率	23.19%	30.82%	-10.49%
本期基金份额净值增长率	25.66%	33.49%	-10.12%
3.2.2 期末数据和指标	2015年06月06日	2014年末	2013年末
期末可供分配利润	-12,061,010.52	-23,429,318.36	-31,945,140.76
期末可供分配基金份额利润	-0.1944	-0.2972	-0.3523
期末基金资产净值	67,462,830.42	68,170,922.48	58,722,274.03
期末基金份额净值	1.0870	0.9650	0.6480
3.2.3 累计期末指标	2015年05月06日	2014年末	2013年末
基金份额累计净值增长率	8.70%	-13.50%	-35.20%

注:1.2015年5月7日,原天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)终止上市之日起,原天弘深证成份指数证券投资基金。
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.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。
4.期末可供分配利润采用期末资产负债表本分配利润中已实现部分的孰低数。
3.3 基金净值表现(天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金)
3.3.1 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(转型后)

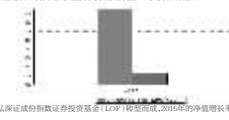
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.83%	0.09%	0.90%	0.01%	-0.07%	0.08%
过去六个月	1.86%	0.08%	1.90%	0.01%	-0.04%	0.07%
自基金合同生效日起至今(2015年05月07日-2015年12月31日)	17.03%	0.53%	2.56%	0.01%	14.47%	0.52%

注:天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金业绩比较基准为:三年期银行定期存款利率(税后)+0.75%,即中国人民银行公布并执行的三年期金融机构人民币存款基准利率(税后)+0.75%。
3.3.2 自基金转型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(转型后)

天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金
份额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05月07日-2015年12月31日)



注:1.本基金于2015年5月7日由天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)转型而成,本基金转型起至披露时点不满1年。
2.基金管理人应当日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5月7日-2015年11月6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的约定的各项比例要求。
3.3.3 自基金转型以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较(转型后)

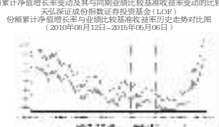


注:本基金于2015年5月7日由天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)转型而成,2015年的净值增长率按照基金合同生效日当年的实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。
3.4 基金净值表现(天弘深证成份指数证券投资基金(LOF))
3.4.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较(转型前)

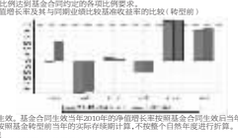
阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	6.78%	1.76%	7.75%	1.68%	-0.97%	0.08%
过去六个月	25.66%	1.70%	27.67%	1.68%	-2.01%	0.02%
过去一年	84.24%	1.44%	87.79%	1.44%	-3.55%	0.00%
过去三年	46.10%	1.36%	47.46%	1.35%	-1.36%	0.01%
自基金合同生效日起至今(2010年06月12日-2015年05月06日)	8.70%	1.31%	30.88%	1.38%	-22.18%	-0.07%

注:天弘深证成份指数(LOF)收益比较基准:深证成份指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%。本基金是以深证成份指数为标的指数的被动式、指数型基金,以此为业绩比较基准,能够准确地反映本基金的投资绩效。
3.4.2 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(转型前)

天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2010年06月12日-2015年05月06日)



注:1.本基金合同于2010年06月12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的约定的各项比例要求。
3.4.3 自基金转型以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较(转型前)



注:本基金合同于2010年06月12日生效,基金合同生效当年2010年的净值增长率按照基金合同生效日当年的实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。2015年的净值增长率按照基金合同生效当年的实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。
3.5 过去三年基金的利润分配情况
3.5.1 天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金(转型后)
本基金于2015年5月7日由天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)转型而成,本基金自基金合同生效以来无利润分配情况,符合相关法规及基金合同的规定。
3.5.2 天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)(转型前)
本基金于2015年5月7日由天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)转型而成,本基金自基金合同生效以来无利润分配情况,符合相关法规及基金合同的规定。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及其投资管理部门
4.1.1 基金管理人及其管理层的经验
天弘基金管理有限公司(以下简称"公司或"本基金管理人")经中国证监会批复(证监许可[2004]164号文批准,于2004年11月8日正式成立,注册资本为7亿元人民币,总部设在天津,在北京、上海、广州、大连设有分公司。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%
新疆汇惠新盟股权投资合伙企业(有限合伙)	2%
新疆天华恒基股权投资合伙企业(有限合伙)	2%
新疆天聚兴股权投资合伙企业(有限合伙)	3.5%
合计	100%

截至2015年12月31日,本基金管理人其管理单位计基金:天弘精选混合型证券投资基金、天弘天利债券型证券投资基金、天弘天宝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、天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)、天弘利鑫债券型证券投资基金、天弘永定价值成长股票型证券投资基金、天弘精选混合型证券投资基金、天弘稳健增长混合型证券投资基金、天弘周利分级债券型证券投资基金、天弘稳利定期开放债券型证券投资基金、天弘利利分级债券型证券投资基金、天弘稳利债券型证券投资基金、天弘周利分级债券型证券投资基金、天弘稳利定期开放债券型证券投资基金、天弘季利定期开放债券型证券投资基金、天弘周利分级债券型证券投资基金、天弘年添利债券型证券投资基金、天弘年增利债券型证券投资基金、天弘年丰利债券型证券投资基金、天弘年盈利债券型证券投资基金、天弘年惠利债券型证券投资基金、天弘年裕利债券型证券投资基金、天弘年顺利债券型证券投资基金、天弘年安利债券型证券投资基金、天弘年康利债券型证券投资基金、天弘年乐利债券型证券投资基金、天弘年福利债券型证券投资基金、天弘年瑞利债券型证券投资基金、天弘年金利债券型证券投资基金、天弘年信利债券型证券投资基金、天弘年益利债券型证券投资基金、天弘年禄利债券型证券投资基金、天弘年欣利债券型证券投资基金、天弘年荣