天弘增益宝货币市场基金

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:恒丰银行股份有限公司
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一以上独立董事签字同意,并由董事长签发。
基金托管人恒丰银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年3月26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。
本报告期自2015年3月6日起至2015年12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	天弘增益宝货币市场基金
基金简称	天弘增益宝货币
基金主代码	001038
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年03月06日
基金管理人	天弘基金管理有限公司
基金托管人	恒丰银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	5,169,649,127.69
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在保持基金资产的低风险和高流动性的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金根据对短期利率变动的预测,采用投资组合平均剩余期限控制下的主动性投资策略,利用定性分析和定量分析方法,通过对短期金融工具的积极投资,在控制风险和保证流动性的基础上,力争获得稳定的当期收益。
业绩比较基准	活期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为货币市场基金,属于证券投资基金中的低风险品种,其预期收益和风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。

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	恒丰银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	童建林	刘金平
	联系电话	022-83310208	021-61001262
	电子邮箱	service@thfund.com.cn	liujinping@ecfbank.com.cn
客户服务电话		4007109999	95395
传真		022-83995569	021-38996338
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	烟台市南大街248号
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	上海市浦东新区源深路419号
邮政编码		300203	200135
法定代表人		井贤栋	蔡国华

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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
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、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

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2015年
本期已实现收益	7,028,018.83
本期利润	7,028,018.83
本期净值收益率	2.1430%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末
期末基金资产净值	5,169,649,127.69
期末基金份额净值	1.0000
3.1.3 累计期末指标	2015年末
累计净值收益率	2.1430%

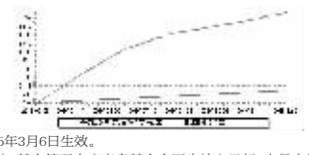
注:1、本基金无持有人认购或交易基金的各项费用。
2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。
3、本基金的利润分配是按日结转份额。
4、本基金合同自2015年3月6日起生效,报告期为2015年3月6日至2015年12月31日。

3.2 基金净值表现

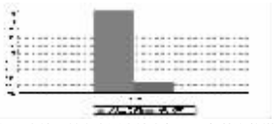
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差②	业绩比较基准收益率标准差③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.3564%	0.0019%	0.0895%	0.0000%	0.2669%	0.0019%
过去六个月	0.8056%	0.0043%	0.1790%	0.0000%	0.6266%	0.0043%
自基金合同生效日起至今(2015年03月06日-2015年12月31日)	2.1430%	0.0049%	0.2931%	0.0000%	1.8499%	0.0049%

注:1、基金业绩比较基准:活期存款利率(税后)
2、本基金合同于2015年3月6日生效。
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3月6日生效。
2、按照本基金合同的约定,基金管理人应当自基金合同生效之日起3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3月6日至2015年6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约定的各项比例要求。
3.2.3 自基金合同生效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



注:本基金合同于2015年3月6日生效。基金合同生效当年2015年的净值增长率按照基金合同生效后当年的实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

单位:人民币元

年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2015年	7,028,018.83			7,028,018.83	无
合计	7,028,018.83			7,028,018.83	

§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(有限合伙)	2%
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2015年12月31日,本基金管理人共管理46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、天弘通利混合型证券投资基金、天弘同利分级债券型证券投资基金、天弘季加利理财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、天弘中证银行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、天弘中证休闲娱乐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。

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		
王登峰	本基金基金经理。	2015年03月	-	6年	历任中信建投证券股份有限公司固定收益部高级经理。2012年5月加盟本公司,历任固定收益研究负责。

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。

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、基金合同和托管协议的规定,诚信、尽责地履行了基金托管人义务,不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算等情况的说明

本报告期内,本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支、利润分配情况等方面进行了必要的监督、复核和审查,未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为。

5.3 托管人对本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年度报告中的财务指标、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,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 审计报告

本报告期本基金财务会计报告经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计,该所出具了"无保留意见的审计报告",且在审计报告中无强调事项。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:天弘增益宝货币市场基金
报告截止日:2015年12月31日
单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2015年12月31日
资 产:		
银行存款	7.4.7.1	4,204,162,191.04
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	7.4.7.2	1,284,703,143.94
其中:股票投资		-
基金投资		-
债券投资		1,284,703,143.94
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-
应收证券清算款		-
应收利息	7.4.7.5	6,484,287.86
应收股利		-
应收申购款		-
递延所得税资产		-
其他资产	7.4.7.6	-
资产总计		5,495,349,622.84
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年12月31日
负 债:		
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		324,599,517.70
应付证券清算款		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		384,187.73
应付托管费		116,420.54
应付销售服务费		291,051.29
应付交易费用	7.4.7.7	10,994.85
应交税费		-
应付利息		19,323.04
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	279,000.00
负债合计		325,700,495.15
所有者权益:		
实收基金	7.4.7.9	5,169,649,127.69
未分配利润	7.4.7.10	-
所有者权益合计		5,169,649,127.69
负债和所有者权益总计		5,495,349,622.84

注:1、报告截止日2015年12月31日,基金份额净值1.00元,基金份额总额5,169,649,127.69份。
2、本财务报表的比较期间为2015年3月6日(基金合同生效日)至2015年12月31日,无上一年度可比期间(下同)。

7.2 利润表

会计主体:天弘增益宝货币市场基金
本报告期:2015年03月06日(基金合同生效日)-2015年12月31日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期2015年03月06日(基金合同生效日)-2015年12月31日
一、收入		9,050,541.08
1.利息收入		8,913,953.85
其中:存款利息收入	7.4.7.11	8,120,079.88
债券利息收入		598,465.23
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		195,418.74
其他利息收入		-
2.投资收益(损失以"-"填列)		136,587.23
其中:股票投资收益	7.4.7.12	-
基金投资收益		-
债券投资收益	7.4.7.13	136,587.23
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.3	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-
股利收益	7.4.7.16	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	7.4.7.17	-
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	7.4.7.18	-
减:二、费用		2,022,522.25
1. 管理人报酬		801,537.34
2. 托管费		243,725.29
3. 销售服务费		609,312.93
4. 交易费用	7.4.7.19	14.67
5. 利息支出		76,232.02
其中:卖出回购金融资产支出		76,232.02
6. 其他费用	7.4.7.20	291,700.00
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		7,028,018.83
减:所得税费用		-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		7,028,018.83

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:天弘增益宝货币市场基金
本报告期:2015年03月06日-2015年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2015年03月06日-2015年12月31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)	200,004,221.00	-	200,004,221.00
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	7,028,018.83	7,028,018.83
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)	4,969,644,906.69	-	4,969,644,906.69
其中:1.基金申购款	5,576,995,614.93	-	5,576,995,614.93
2.基金赎回款	-607,350,708.24	-	-607,350,708.24
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)	-	-7,028,018.83	-7,028,018.83
五、期末所有者权益(基金净值)	5,169,649,127.69	-	5,169,649,127.69

报表附注为财务报表的组成部分。
本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

郭树强 基金管理人负责人	韩海潮 主管会计工作负责人	薄贺龙 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 重要会计政策和会计估计

7.4.1.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本期财务报表的实际编制期间为2015年3月6日(基金合同生效日)至2015年12月31日。

7.4.1.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.1.3 金融资产和金融负债的分类

(1)金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的债券投资和资产支持证券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项,包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2)金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为:以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.1.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时,按公允价值在资产负债表内确认。对于取得债券投资或资产支持证券投资支付的价款中包含的债券或资产支持证券起息日或上次除息日至购买日止的利息,单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

债券投资和资产支持证券投资按票面利率或商定利率每日计提应收利息,按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价;同时于每一计价日计算影子价格,以避免债券投资或资产支持证券投资的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的,予以终止确认:(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止;(2)该金融资产已转移,且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方;或者(3)该金融资产已转移,虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬,但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时,其账面价值与收到的对价的差额,计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时,终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额,计入当期损益。

7.4.1.5 金融资产和金融负债的估值原则

为了避免债券投资或资产支持证券投资的账面价值与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离,从而对基金持有人的利益产生稀释或不公平的结果,基金管理人于每一计价日采用债券投资和资产支持证券投资的公允价值计算影子价格。当基金资产净值与影子价格的偏离达到或超过基金资产净值的0.25%时,基金管理人应根据风险控制的需要调整组合,使基金资产净值更能公允地反映基金资产价值。

计算影子价格时按如下原则确定债券投资和资产支持证券投资的公允价值:

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值;估值日无交易,但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的,按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2)存在活跃市场的金融工具,如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化,参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素,调整最近交易市价以确定公允价值。

(3)当金融工具不存在活跃市场,采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时,尽可能最大程度使用市场参数,减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.1.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1)具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的;且2)交易双方准备按净额结算时,金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.1.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额。每份基金份额面值为1.00元。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

7.4.1.8 收入/(损失)的确认和计量

债券投资在持有期间按实际利率计算确定的金额扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。资产支持证券在持有期间收到的款项,根据资产支持证券的预计收益率区分属于资产支持证券投资本金部分和投资收益部分,将本金部分冲减资产支持证券投资成本,并将投资收益部分确认为利息收入。

债券投资和资产支持证券投资处置时其处置价格扣除相关交易费用后的净额与账面价值之间的差额确认为投资收益。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.1.9 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算,实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.1.10 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。申购的基金份额享有确认当日的分红权益,而赎回的基金份额不享有确认当日的分红权益。本基金以份额面值1.00元固定份额净值交易方式,每日计算当日收益并全部分配结转至应付收益科目,同时以红利再投资方式进行支付。

7.4.1.11 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作,本基金计算影子价格过程中确定债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下:

在银行间同业市场交易的债券品种,根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值,具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

7.4.2 关联方关系

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
恒丰银行股份有限公司("恒丰银行")	基金托管人、基金销售机构
天津信托有限责任公司	基金管理人的股东
内蒙古君正能源化工集团股份有限公司	基金管理人的股东
芜湖高新投资有限公司	基金管理人的股东
浙江蚂蚁小微金融服务集团有限公司	基金管理人的股东
新疆天瑞博丰股权投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
新疆天聚宸兴股权投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
新疆天惠新盟股权投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
新疆天阜恒基股权投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
天弘创新资产管理有限公司("天弘创新")	基金管理人的全资子公司

注:1、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。
2、2015年度内,本基金管理人股东"内蒙古君正能源化工股份有限公司"的名称变更为"内蒙古君正能源化工集团股份有限公司"。
3、根据本基金管理人于2015年2月26日披露的关于完成增资扩股相关工商变更登记的公告,浙江蚂蚁小微金融服务集团有限公司、新疆天瑞博丰股权投资合伙企业(有限合伙)、新疆天惠新盟股权投资合伙企业(有限合伙)、新疆天阜恒基股权投资合伙企业(有限合伙)、新疆天聚宸兴股权投资合伙企业(有限合伙)为本基金管理人新增股东。

7.4.3 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.3.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.3.2 关联方报酬

7.4.3.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2015年03月06日(基金合同生效日)-2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	801,537.34
其中:支付销售机构的客户维护费	-

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的0.33%年费率计提。基金管理费每日计算,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X0.33%/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。

7.4.3.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2015年03月06日(基金合同生效日)-2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	243,725.29

注:支付基金托管人恒丰银行的托管费按前一日基金资产净值0.10%的年费率计提,基金托管费每日计算,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X0.10%/当年天数。

7.4.3.2.3 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 2015年03月06日(基金合同生效日)-2015年12月31日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
天弘基金管理有限公司	553,760.31
恒丰银行	50,821.61
合计	604,581.92

注:支付基金管理人天弘基金管理有限公司销售服务费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提,基金销售服务费每日计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日销售服务费=前一日基金资产净值X0.25%/当年天数。

7.4.3.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期未参与关联方进行银行间同业市场的债券交易。

7.4.3.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.3.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.4.10.4.2 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。

7.4.3.5 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 2015年03月06日-2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
恒丰银行	4,162,191.04	1,085,562.36

注:1、本基金的活期银行存款由基金托管人恒丰银行保管,按银行同业利率计息。
2、当期利息收入含存放于基金托管人恒丰银行的协议存款利息收入。

7.4.3.6 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。

7.4.3.7 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。

7.4.4 期末(2015年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.4.1 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。

7.4.4.2 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.4.2.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2015年12月31日,本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额324,599,517.70元,于2016年01月04日到期是以如下债券作为抵押:

金额单位:人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量(张)	期末估值总额
041559039	15盐源ZP001	2016-01-04	100.78	600,000	60,468,000.00
159909	15粘现国债09	2016-01-04	99.56	1,500,000	149,340,000.00
159923	15粘现国债23	2016-01-04	99.51	200,000	19,902,000.00
155924	15粘现国债24	2016-01-04	99.47	1,000,000	99,470,000.00
合计				3,300,000.00	329,180,000.00

7.4.4.2.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2015年12月31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。

§8 投资组合报告

8.1 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	固定收益投资	1,284,703,143.94	23.38
	其中:债券	1,284,703,143.94	23.38
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	4,204,162,191.04	76.50
4	其他各项资产	6,484,287.86	0.12
5	合计	5,495,349,622.84	100.00

8.2债券回购融资情况

金额单位:人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	0.13
	其中:买断式回购融资	-
序号	项目	金额 / 占基金资产净值的比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	324,599,517.70 / 6.28
	其中:买断式回购融资	- / -

报告期内债券回购融资余额占基金资产净值比例应取报告期内每个交易日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值;对于货币市场基金,只要其投资的市场(如银行间市场)可交易,即可视为交易日。
债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明
在本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	84
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	104
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	0

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明
根据本货币市场基金基金合同的约定,其投资组合的平均剩余期限在每个交易日都不得超过120天。本报告期内,本货币市场基金投资组合平均剩余期限未发生超过120天的情况。

8.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	0.08	6.28
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	104.15	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	1.95	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
合计		106.18	6.28

8.4 期末按债券品种分类的债券投资组合

金额单位:人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	268,671,656.64	5.20
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	321,060,006.57	6.21
6	中期票据	-	-
7	同业存单	694,971,480.73	13.44
8	其他	-	-
9	合计	1,284,703,143.94	24.85
10	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

8.5期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	111511323	15平安CD323	4,000,000.00	397,131,314.47	7.68
2	111518071	15华夏CD071	3,000,000.00	297,840,166.26	5.76
3	159909	15粘现国债09	1,500,000.00	149,309,730.51	2.89
4	159924	15粘现国债24	1,000,000.00	99,462,636.80	1.92
5	041559039	15盐源ZP001	800,000.00	80,540,818.28	1.56
6	011573005	15鲁高速SCP005	500,000.00	50,208,337.68	0.97
7	071506003	15安信CP003	500,000.00	50,002,016.75	0.97
8	071508006	15东方证券CP006	500,000.00	50,001,342.08	0.97
9	011581129	15苏国信SCP007	400,000.00	39,993,640.79	0.77
10	041561025	15盐源ZP002	200,000.00	20,135,101.43	0.39

8.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况(%)
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	-
报告期内偏离度的最高值	0.0506
报告期内偏离度的最低值	-0.0017
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0059

注:表内各项数据均按报告期内的交易日统计。

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

8.8 投资组合报告附注

8.8.1 基金计价方法说明。
本基金估值采用摊余成本法,即估值对象以买入成本列示,按票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余存续期内按照实际利率法进行摊销,每日计提损益。本基金通过每日计算基金收益并分配的方式,使基金份额净值保持在人民币1.00元。
为了避免采用摊余成本法计算的基金资产净值与按市场利率和交易市价计算的基金资产净值发生重大偏离,从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果,基金管理人于每一估值日,采用估值技术,对基金持有的估值对象进行重新评估,即"影子定价"。投资组合的摊余成本与其他可参考公允价值指标产生重大偏离的,应按其他公允指标对组合的账面价值进行调整,调整差额确认为"公允价值变动损益",并按其他公允价值指标进行后续计量。如基金份额净值恢复至1.00元,可恢复使用摊余成本法