

天弘喜利灵活配置混合型证券投资基金

2018年第二季度报告

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2018年2季度，10年期国债收益率逐月累计下行40bp。市场走牛有3条主线：第一，经济数据走弱进一步得到确认，且金融收缩对经济的影响已经开始体现；第二，经济数据不佳叠加贸易战等多重压力下，货币政策开始明显放松，2次定向降准（第二次于6月公布，7月初执行）引爆市场行情；第三，信用危机和股市暴跌引发市场风险偏好降低，利率债和高等级信用债遭遇市场追捧。

本基金在报告期内，账户积极配置了长久期利率债，赚取资本利得，为客户创造了稳健收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2018年6月30日，本基金份额净值为0.8765元，本报告期份额净值增长率为-12.57%，同期业绩比较基准增长率为-4.07%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

自上一报告期至2018年5月17日止，本基金已连续60个工作日基金资产净值低于5000万元，已按照约定程序依法进入基金财产清算程序，无需召开基金份额持有人大会审议。具体信息请参见基金管理人于2018年5月18日在指定媒介披露的《关于天弘喜利灵活配置混合型证券投资基金发生基金合同终止事由并进入基金财产清算程序的公告》。

§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)	占基金资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	贵金属投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	310,915.00	98.04
8	其他资产	6,204.80	0.04
9	其他负债	377,120.00	100.00
10	合计	-	-

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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

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

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。

11.1 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，未发现在报告期编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.11.2 本基金本报告期末未持有股票，故不存在所投资的前十名股票中超出基金合同规定之备选股票库的情况。

5.11.3 其他资产构成

序号	项目/证券名称	金额(元)
1	存出保证金	6,120.40
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	62.00
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	预付款项	-
8	其他	-
9	合计	6,204.40

5.11.4 报告期末未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
本基金本报告期末未持有股票。

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	
报告期初基金份额总额	1079,047.62
报告期内基金份额净增加额	-
减:报告期内基金份额净减少额	426,431.71
报告期末基金份额总额	652,615.91

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息
8.1 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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息
本报告期内，本基金已连续60个工作日基金资产净值低于5000万元，已按照约定程序依法进入基金财产清算程序，无需召开基金份额持有人会议审议。具体信息请参见基金管理人于2018年5月18日在指定媒介披露的《关于天弘喜利灵活配置混合型证券投资基金发生基金合同终止事由并进入基金财产清算程序的公告》。

9.1 备查文件目录
1. 中国证监会批准天弘喜利灵活配置混合型证券投资基金募集的文件

2. 天弘喜利灵活配置混合型证券投资基金基金合同
3. 天弘喜利灵活配置混合型证券投资基金托管协议
4. 天弘喜利灵活配置混合型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
9.2 存放地点
天津市河西区马场道50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印件或复印件。

公司网站: www.thfund.com.cn

天弘基金管理有限公司
二〇一八年七月十九日

天弘金利灵活配置混合型证券投资基金

2018年第二季度报告

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2018年2季度，10年期国债收益率逐月累计下行40bp。市场走牛有3条主线：第一，经济数据走弱进一步得到确认，且金融收缩对经济的影响已经开始体现；第二，经济数据不佳叠加贸易战等多重压力下，货币政策开始明显放松，2次定向降准（第二次于6月公布，7月初执行）引爆市场行情；第三，信用危机和股市暴跌引发市场风险偏好降低，利率债和高等级信用债遭遇市场追捧。

本基金在报告期内，账户积极配置了长久期利率债，赚取资本利得，为客户创造了稳健收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2018年6月30日，本基金份额净值为0.9321元，本报告期份额净值增长率为-7.76%，同期业绩比较基准增长率为-4.07%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

自2018年4月24日至2018年6月30日止，本基金连续20个工作日以上基金资产净值低于人民币5000万元，但并未连续60个工作日出现上述情形。

§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)	占基金资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	贵金属投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	622,090.48	91.76
8	其他资产	62,002.88	9.24
9	其他负债	1,006,018.30	100.00
10	合计	-	-

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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

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

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说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

11.1 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，未发现在报告期编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.11.2 本基金本报告期末未持有股票，故不存在所投资的前十名股票中超出基金合同规定之备选股票库的情况。

5.11.3 其他资产构成

序号	项目/证券名称	金额(元)
1	存出保证金	289,071.00
2	应收证券清算款	2,094,500.97
3	应收股利	-
4	应收利息	300,341,425.80
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	预付款项	-
8	其他	-
9	合计	526,003.33

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息
8.1 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

投资者名称	持有基金份额比例达到或超过20%的时间段	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1 2018/4/1-2018/4/23	289,071.00	0.00	289,071.00	-	-
个人	1 2018/4/1-2018/4/23	0.00	0.00	0.00	-	-
产品特有风险						

基金管理人承诺遵循诚实、勤勉、独立、客观、公正的原则，为基金份额持有人提供真实、准确、及时、完整的基金信息。基金管理人承诺，为基金份额持有人提供真实、准确、及时、完整的基金信息。基金管理人承诺，为基金份额持有人提供真实、准确、及时、完整的基金信息。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息
本基金可能在基金合同生效后满三年后基金规模低于两亿元，故已披露两次本基金可能触发基金合同终止情形的提示性公告，具体信息请参见基金管理人分别于2018年7月7日及7月14日在指定媒介披露的《关于天弘金利灵活配置混合型证券投资基金可能触发基金合同终止情形的第一次提示性公告》、《关于天弘金利灵活配置混合型证券投资基金可能触发基金合同终止情形的第二次提示性公告》。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录
1. 中国证监会批准天弘金利灵活配置混合型证券投资基金募集的文件
2. 天弘金利灵活配置混合型证券投资基金基金合同
3. 天弘金利灵活配置混合型证券投资基金托管协议
4. 天弘金利灵活配置混合型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
9.2 存放地点
天津市河西区马场道50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印件或复印件。

公司网站: www.thfund.com.cn

天弘基金管理有限公司
二〇一八年七月十九日

天弘金明灵活配置混合型证券投资基金

2018年第二季度报告

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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2018年2季度，10年期国债收益率逐月累计下行40bp。市场走牛有3条主线：第一，经济数据走弱进一步得到确认，且金融收缩对经济的影响已经开始体现；第二，经济数据不佳叠加贸易战等多重压力下，货币政策开始明显放松，2次定向降准（第二次于6月公布，7月初执行）引爆市场行情；第三，信用危机和股市暴跌引发市场风险偏好降低，利率债和高等级信用债遭遇市场追捧。

本基金在报告期内，账户积极配置了长久期利率债，赚取资本利得，为客户创造了稳健收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2018年6月30日，本基金份额净值为1.0552元，本报告期份额净值增长率为-0.06%，同期业绩比较基准增长率为-4.07%。

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)	占基金资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
	其中：股票	-	-
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	-	-
	其中：债券	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	贵金属投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	20,000,000.00	17.03
8	其他资产	20,000,000.00	17.03
9	其他负债	100,000,000.00	82.94
10	合计	60,000,000.00	50.93

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

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

本基金本报告期末未持有股票。

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十名资产支持证券投资明细

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

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说明

本基金本报告期末未持有国债期货。

11.1 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，未发现在报告期编制日前一年内受到公开谴责、处罚。

5.11.2 本基金本报告期末未持有股票，故不存在所投资的前十名股票中超出基金合同规定之备选股票库的情况。

5.11.3 其他资产构成

序号	项目/证券名称	金额(元)
1	存出保证金	97,469.23
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	1,181,284.97
5	应收申购款	6,662.03
6	其他应收款	-
7	预付款项	-
8	其他	-
9	合计	1,184,524.00

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
本基金本报告期末未持有股票。

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	
报告期初基金份额总额	111,464,600.04
报告期内基金份额净增加额	4,442,471.00
减:报告期内基金份额净减少额	4,442,471.00
报告期末基金份额总额	111,464,600.04

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况
本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 影响投资者决策的其他重要信息
8.1 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。

8.2 影响投资者决策的其他重要信息
本报告期内，本基金已连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元，已按照约定程序依法进入基金财产清算程序，无需召开基金份额持有人会议审议。具体信息请参见基金管理人于2018年5月18日在指定媒介披露的《关于天弘金明灵活配置混合型证券投资基金发生基金合同终止事由并进入基金财产清算程序的公告》。

9.1 备查文件目录
1. 中国证监会批准天弘金明灵活配置混合型证券投资基金募集的文件

2. 天弘金明灵活配置混合型证券投资基金基金合同
3. 天弘金明灵活配置混合型证券投资基金托管协议
4. 天弘金明灵活配置混合型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
9.2 存放地点
天津市河西区马场道50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印件或复印件。

公司网站: www.thfund.com.cn

天弘基金管理有限公司
二〇一八年七月十九日

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:2018年7月19日

§1 重要提示

基金管理人及董事承诺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承诺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。
基金管理人承诺本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或