天弘沪深300指数型发起式证券投资基金

【2015】第二季度报告

基金管理人:天弘基金管理有限公司
基金托管人:招商证券股份有限公司
报告送出日期:2015年7月20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2015年7月17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4月1日起至2015年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	天弘沪深300
基金主代码	000961
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年1月20日
报告期末基金份额总额	550,329,699.90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。
业绩比较基准	沪深300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	招商证券股份有限公司

§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4月1日-2015年6月30日)
1.本期已实现收益	87,770,702.07
2.本期利润	64,551,904.95
3.加权平均基金份额本期利润	0.1013
4.期末基金资产净值	708,373,098.40
5.期末基金份额净值	1.2872

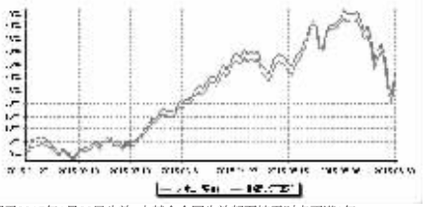
注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如,开放式基金的申购赎回费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	9.47%	2.55%	9.98%	2.48%	-0.51%	0.07%

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1月20日生效,本基金合同生效起至披露时点不满1年。
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1月20日至2015年7月19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		
李磊炜	本基金基金经理;天弘中证500指数型发起式证券投资基金基金经理。	2015年1月	-	9年	男,理学硕士。历任亚洲证券有限责任公司股票分析师、Ophadge investment services运营分析师。2007年加盟本公司,历任交易员、行业研究员、高级研究员、股票研究部副总经理、天弘精选混合型证券投资基金基金经理助理、天弘永定价值成长股票型证券投资基金基金经理、天弘安康养老混合型证券投资基金基金经理、天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

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,保证不同投资组合投资信息的相互隔离;加强对投资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

本基金在成立以来根据基金合同规定,采取了对指数的被动复制策略,将年化跟踪误差和日均跟踪偏离度控制在了基金合同约定的范围之内。

报告期内,本基金跟踪误差主要来自基金所持股票组合与所跟踪标的指数在权重结构上的差异。这种差异源自部分股票由于权重差价及停牌等原因所造成,各股票的权重与标的指数相比有所变化。本基金管理人在量化分析基础上,采取了适当的组合调整策略,尽可能地控制了基金的跟踪误差与偏离度。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2015年6月30日,本基金份额净值为1.2872元,本报告期份额净值增长率9.47%,同期业绩比较基准增长率9.98%。

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

在经济仍将继续下行判断的基础上,国家会进一步出台货币宽松及财政刺激等政策。同时,在中国经济结构性改革的时代,结构性行情及创新板块仍将表现抢眼。本基金管理人将根据基金合同,以量化分析研究为基础,克服各种因素的不利影响,不断优化和改进量化模型,将基金的跟踪误差及偏离度保持在较低水平,保持对指数的紧密跟踪,从而为基金持有人创造满意的投资回报。

§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	664,236,397.61	85.26
	其中:股票	664,236,397.61	85.26
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	20,122,000.00	2.58
	其中:债券	20,122,000.00	2.58
	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	49,057,418.61	6.30
8	其他资产	45,640,119.91	5.86
9	合计	779,055,936.13	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

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	1,567,702.00	0.22
B	采矿业	30,856,214.81	4.36
C	制造业	222,419,647.91	31.40
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	27,920,492.82	3.94
E	建筑业	29,764,413.98	4.20
F	批发和零售业	14,496,361.66	2.05
G	交通运输、仓储和邮政业	27,386,067.29	3.87
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	37,836,803.44	5.34
J	金融业	224,574,453.04	31.70
K	房地产业	24,442,897.63	3.45
L	租赁和商务服务业	6,730,822.04	0.95
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	5,440,809.00	0.77
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	717,688.22	0.10
R	文化、体育和娱乐业	8,164,803.31	1.15
S	综合	1,917,220.46	0.27
	合计	664,236,397.61	93.77

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

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	601318	中国平安	303,500	24,868,790.00	3.51
2	600036	招商银行	938,500	17,568,720.00	2.48
3	600016	民生银行	1,680,237	16,701,555.78	2.36
4	600030	中信证券	463,900	12,483,549.00	1.76
5	600000	浦发银行	687,012	11,651,723.52	1.64
6	601166	兴业银行	675,300	11,648,925.00	1.64
7	600837	海通证券	476,584	10,389,531.20	1.47
8	601766	中国中车	515,408	9,462,890.88	1.34
9	601328	交通银行	1,106,600	9,118,384.00	1.29
10	000651	格力电器	139,838	8,935,648.20	1.26

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

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	20,122,000.00	2.84
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	-	-
8	其他	-	-
9	合计	20,122,000.00	2.84

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	019039	10国债39	200,000	20,122,000.00	2.84

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	1,371,406.68
2	应收证券清算款	43,829,894.40
3	应收股利	-
4	应收利息	438,818.83
5	应收申购款	-
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	45,640,119.91

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

本基金本报告期末指数投资前十名股票不存在流通受限情况。

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

报告期期初基金份额总额	371,522,873.28
报告期期间基金总申购份额	1,652,715,751.04
减:报告期期间基金总赎回份额	1,473,908,924.42
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	550,329,699.90

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	10,000,000.00
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	10,000,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	1.82

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期未有基金管理人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

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,000.00	1.82%	10,000,000.00	1.82%	三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	-
基金经理等人员	-	-	-	-	-
基金管理人股东	-	-	-	-	-
其他	-	-	-	-	-
合计	10,000,000.00	1.82%	10,000,000.00	1.82%	-

§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沪深300指数型发起式证券投资基金募集的文件
2、天弘沪深300指数型发起式证券投资基金基金合同
3、天弘沪深300指数型发起式证券投资基金招募说明书
4、天弘沪深300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
二〇一五年七月二十日

天弘精选混合型证券投资基金

【2015】第二季度报告

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:2015年7月20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2015年7月16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4月1日起至2015年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	天弘精选混合
基金主代码	420001
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2005年10月8日
报告期末基金份额总额	2,490,288,065.96份
投资目标	以资产配置为导向,在股票、债券、短期金融工具等之间进行动态选择,在控制风险的前提下追求基金财产的长期稳健增值。
投资策略	在资产配置层次上,本基金以资产配置为导向,力图通过对股票、债券和短期金融工具进行灵活资产配置,在控制风险基础上,获取收益;在行业配置层次上,根据各个行业的景气程度,进行行业资产配置;在股票选择上,本基金将挖掘行业龙头、投资于有投资价值的行业龙头企业;本基金债券投资坚持以久期管理和凸性分析为核心,以稳健的主动投资为主导,选取价值被低估的券种,以获得更高的收益。
业绩比较基准	上证180指数收益率×55%+上证国债指数收益率×45%
风险收益特征	本基金为主动管理的混合型基金,其长期平均风险程度低于股票型基金,高于货币市场型基金。本基金力争在严格控制风险的前提下,谋求实现基金财产的长期稳定增长。
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4月1日-2015年6月30日)
1.本期已实现收益	477,069,324.38
2.本期利润	520,126,097.68
3.加权平均基金份额本期利润	0.1849
4.期末基金资产净值	2,194,844,149.23
5.期末基金份额净值	0.8814

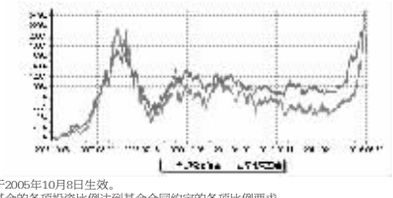
注:1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如,开放式基金的申购赎回费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	22.47%	2.53%	5.60%	1.45%	16.87%	1.08%

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2005年10月8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		
钱文成	本基金基金经理;天弘周期策略股票型证券投资基金基金经理;天弘安康养老混合型证券投资基金基金经理;天弘通利混合型证券投资基金基金经理;天弘新活力灵活配置混合型证券投资基金基金经理;天弘鼎惠保本混合型证券投资基金基金经理;天弘惠利灵活配置混合型证券投资基金基金经理;天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理;天弘新价值灵活配置混合型证券投资基金基金经理。	2013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、股票投资部副总经理、天弘精选混合型证券投资基金基金经理助理。
肖志刚	本基金基金经理;天弘永定价值成长股票型证券投资基金基金经理;天弘周期策略股票型证券投资基金基金经理;天弘端生活优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理;天弘云端生活优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理;天弘互联网灵活配置混合型证券投资基金基金经理;投资研究部总经理。	2013年9月	-	7年	男,经济学硕士。历任富国基金管理有限公司行业研究员。2013年8月加盟本公司,历任股票研究部总经理、天弘周期策略股票型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

2015年2季度,经济基本面依旧较弱,物价水平处于通缩的边缘,货币政策保持宽松的状态,整个资金利率保持在较低水平,3个月SHIBOR利率从1季度的4.8%附近下降至2季度3.2%附近,7天回购利率中枢也降到3%以下,短期债券利率也出现明显的下行,但是受制于地方债供给压力及股市走强对资金的分流,长期债券利率维持区间震荡,期限利差急剧扩大。

本基金在报告期内暂停操作。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2015年3月26日,本基金第三期运作期到期后暂停下一运作期运作,资产负债均已清算。

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2015年三季度,在宽松政策的刺激下,经济基本面将呈现弱复苏,美国经济增长势头较好,年内美联储启动加息的概率较高,在国内经济弱势下,外汇流出的压力加大,需要国内货币政策继续维持宽松,资金利率将维持在较低水平,债券市场方面由于边际上利好减弱,利率品种又面临持续的供给压力,长端利率品种大概率保持区间震荡的态势,由于股市财富效应减弱,IPO暂停将对于信用债的需求有一定支撑,边际上利好信用债的走势。

投资策略上,本基金继续暂停操作。

§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	1,720,144,211.04	75.49
	其中:股票	1,720,144,211.04	75.49
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	203,828,672.75	8.95
	其中:债券	203,828,672.75	8.95
	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	308,425,959.37	13.54
8	其他资产	46,122,092.74	2.02
9	合计	2,278,520,935.90	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

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	27,012,952.21	1.23
B	采矿业	16,445,399.22	0.75
C	制造业	1,074,920,346.60	48.97
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	46,037,715.40	2.10
E	建筑业	1,788,298.16	0.08
F	批发和零售业	80,312,731.84	3.66
G	交通运输、仓储和邮政业	124,728,544.14	5.68
H	住宿和餐饮业	4,223,210.00	0.19
I	信息传输、软件和信息技术服务业	128,872,046.83	5.87
J	金融业	21,973,547.96	1.00
K	房地产业	16,735,690.38	0.76
L	租赁和商务服务业	93,133,381.82	4.24
M	科学研究和技术服务业	27,969,456.69	1.27
N	水利、环境和公共设施管理业	53,484,649.52	2.44
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	2,515,307.28	0.11
S	综合	933.00	-
	合计	1,720,144,211.04	78.37

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	300159	新研股份	6,596,728	125,337,832.00	5.71
2	300152	燃控科技	1,909,242	87,347,821.50	3.98
3	600029	南方航空	3,476,975	50,555,216.50	2.30
4	300223	北京君正	1,406,713	50,078,982.80	2.28
5	002143	印纪传媒	1,506,102	48,210,325.02	2.20
6	600872	中炬高新	2,079,333	48,178,145.61	2.20
7	300431	暴风科技	222,900	47,132,205.00	2.15
8	600153	建发股份	2,600,808	45,540,148.08	2.07
9	300350	华鹏飞	411,385	38,884,110.20	1.77
10	600391	成发科技	585,700	34,286,878.00	1.56

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	20,124,000.00	0.92
	其中:政策性金融债	20,124,000.00	0.92
4	企业债券	153,443,672.75	6.99
5	企业短期融资券	-	-
6	中期票据	30,261,000.00	1.38
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	203,828,672.75	9.29

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	1480546	14攀城投小微债	600,000	60,342,000.00	2.75
2	1480538	14深昆仑债	400,000	40,524,000.00	1.85
3	101551012	15中建租赁MTN001	300,000	30,261,000.00	1.38
4	1380188	13金坛债	200,000	20,508,000.00	0.93
5	150209	15国开09	200,000	20,124,000.00	0.92

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	1,505,707.93
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	4,489,820.77
5	应收申购款	40,126,564.04
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	46,122,092.74

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明细。

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	002143	印纪传媒	48,210,325.02	2.20	按露重大事项
2	600872	中炬高新	48,178,145.61	2.20	重大资产重组
3	300431	暴风科技	47,132,205.00	2.15	按露重大事项
4	600153	建发股份	45,540,148.08	2.07	按露重大事项

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	3,155,454,316.46
报告期期间基金总申购份额	1,051,010,480.46
减:报告期期间基金总赎回份额	1,716,176,730.96
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	2,490,288,065.96

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	-
报告期期间买入/申购总份额	23,012,311.59
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	23,012,311.59
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.92

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	申购	2015年5月13日	23,012,311.59	20,000,000.00	-
合计			23,012,311.59	20,000,000.00	

注:上述申购金额达1000万元以上,申购费率为固定费用,每笔1000元。

§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精选混合型证券投资基金募集的文件
2、天弘精选混合型证券投资基金基金合同
3、天弘精选混合型证券投资基金招募说明书
4、天弘精选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
二〇一五年七月二十日

天弘季加利理财债券型证券投资基金

【2015】第二季度报告

基金管理人:天弘基金管理有限公司
基金托管人:中国农业银行股份有限公司
报告送出日期:2015年07月20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。
基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年7月17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4月1日起至2015年6月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	天弘季加利理财	
基金主代码	000670	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014年06月18日	
报告期末基金份额总额	-份	
投资目标	本基金在追求本金安全的基础上,力求获取较高的当期收益。	
投资策略	在封闭期内,本基金将在坚持组合久期与封闭期基本匹配的原则下,采用持有到期策略构建投资组合,