天弘季加利理财债券型证券投资基金

【2015】第三季度报告

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10月24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10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7月1日起至2015年9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,基本保持大类品种配置的比例恒定。如果需要,在封闭期之间的短暂开放期内,本基金将采用流动性管理与组合调整相结合的策略。 本基金主要投资于银行定期存款、协议存款及大额存单、债券回购和短期债券(包括短期融资券、即将到期的中期票据等)三类利率市场化程度较高的金融工具。在封闭期,根据市场情况和可投资品种的容量,在严谨深入的研究分析基础上,综合考量市场资金面走向、信用债券的信用评级、协议存款交易对手的信用资质以及各类资产的收益率水平等,确定各类货币市场工具的配置比例,主要采取持有到期的投资策略。
业绩比较基准	3个月银行定期存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为采用固定组合策略的短期理财债券型基金,属于证券投资基金中较低风险、预期收益较为稳定的品种,其预期的风险水平低于股票型基金、混合型基金和普通债券型基金。
基金管理人	天弘基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
下属分级基金的基金简称	天弘季加利理财A / 天弘季加利理财B
下属分级基金的交易代码	000670 / 000671
报告期末下属分级基金的份额总额	-份 / -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07月01日-2015年09月30日)	
	天弘季加利理财A	天弘季加利理财B
1.本期已实现收益	158.21	-
2.本期利润	158.21	-
3.期末基金资产净值	-	-

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,由于短期理财债券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、本报告期末,本基金已暂停运作,并正在依法履行基金财产清算程序。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1、天弘季加利理财A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.0000%	0.0000%	0.0000%	0.0000%	0.0000%	0.0000%

注:本报告期末,本基金已暂停运作,并正在依法履行基金财产清算程序。

2、天弘季加利理财B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	0.0000%	0.0000%	0.0000%	0.0000%	0.0000%	0.0000%

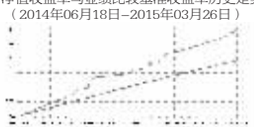
注:本报告期末,本基金已暂停运作,并正在依法履行基金财产清算程序。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

天弘季加利理财A

份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

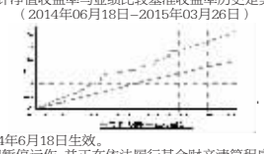
(2014年06月18日-2015年03月26日)



天弘季加利理财B

份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2014年06月18日-2015年03月26日)



注:1、本基金合同于2014年6月18日生效。

2、本报告期末,本基金已暂停运作,并正在依法履行基金财产清算程序。

§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		
王登峰	本基金基金经理;天弘现金管家货币市场基金基金经理;天弘余额宝货币市场基金基金经理;天弘增益宝货币市场基金基金经理;天弘云商宝货币市场基金基金经理。	2014年06月	-	6年	男,经济学硕士。历任中信建投证券股份有限公司固定收益部高级经理。2012年加盟本公司,历任固定收益研究员。

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 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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

2015年3季度,经济延续偏弱走势,并有加速下行趋势,总需求层面消费走势平稳,投资需求除基建投资保持较高增长外,制造业、房地产投资受低迷的经济预期及长周期因素影响,延续下行趋势,外需受外围经济较弱及实际汇率偏高影响,增速低迷;政策层面,受经济下行影响及担忧6月底以来股票市场急剧下跌带来的系统性风险,财政政策总体更加积极,货币政策加大了放松力度,央行陆续采取了降息、降准、贬值等多种货币政策工具,悉心呵护货币市场;三季度债市总体表现来看,流动性方面总体维持平稳,7天回购利率稳定在2.4左右中枢,隔夜回购利率略有上行,向7天回购利率靠拢,稳定在2.0左右中枢,银行体系资金总体宽松;债券市场走势上,在基本面支撑、资金面平稳、政策面呵护,风险偏好降低,大类资产配置转移的背景下,三季度债券市场总体延续牛市格局,尤其是信用债收益率在打新暂停、银行理财资金回流债市的影响下迅速下行,目前信用利差已经处于历史低位。

本基金在报告期内,本基金无操作。

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年四季度,基本面方面,经济下行压力仍存,房地产销售向投资的传导大概率依然不畅,基建投资虽然受到稳增长扶持,但是受制于财政收入下滑、地方政府投融资政策限制等因素难以发挥更大的作用,未来经济大概率将继续维持低位,通胀虽然出现基数效应下的同比回升,但是我们认为不会对债券市场构成太大的压力。政策方面货币政策料将延续宽松态势,对于债券市场而言有利好作用;目前来看,前期过剩的资金大部分流入债券市场而非实体领域,催生了债券市场的较高杠杆,从近期的政策走势上,我们也观测央行对实体领域的关注度在提升,因此尽管基本面条件利于继续宽松,但从防风险角度考虑,流动性泛滥的局面难以出现,预期资金仍将维持平稳的态势,货币市场工具相应的利率水平短期难有大幅下降,总体有望维持平稳。

投资策略上,本基金无操作。

§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	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	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	135,019.34	99.98
4	其他资产	27.00	0.02
5	合计	135,046.34	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

金额单位:人民币元

序号	项目	占基金资产净值比例(%)	
1	报告期内债券回购融资余额		-
	其中:买断式回购融资		-
序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	-	-
	其中:买断式回购融资	-	-

注: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;对于理财债券型基金,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

本基金合同约定:"本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%;",本报告期内,本基金未发生超标情况。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

不适用。

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

不适用。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

不适用。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本报告期末,本基金已暂停运作,资产负债均已清算。

5.5 报告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

本报告期末,本基金已暂停运作,未持有债券。

5.6 "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	0
报告期内偏离度的最高值	-%
报告期内偏离度的最低值	-%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	-%

注:截至本报告期末,本基金已暂停运作,并正在依法履行基金财产清算程序。

5.7 报告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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 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,按照票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价,在剩余存续期内平均摊销,每日计提损益。本基金不采用市场利率和上市交易的债券和票据的市价计算基金资产净值。

5.8.2 本报告期内,本基金持有的剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券的说明。

不适用。

5.8.3 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。

5.8.4 其他资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	27.00
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	27.00

5.8.5 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

	天弘季加利理财A	天弘季加利理财B
报告期基金总申购份额	-	-
减:报告期基金总赎回份额	-	-
报告期期末基金份额总额	-	-

注:根据基金合同约定,本基金管理人在运作期赎回日(2015年3月26日)自动为各类基金份额持有人发起全部赎回申请并正在依法履行基金财产清算程序。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本基金本报告期末未有基金管理人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

1、基金管理人住址于2015年8月27日由"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"变更为"天津自贸区(中心商务区)响螺湾旷世国际大厦A座1704-241号",上述住所变更已办理完毕工商变更登记。

2、本基金已于第三个运作期(2015年3月26日)届满后暂停运作并正在依法履行基金财产清算程序。

§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季加利理财债券型证券投资基金募集的文件

2、天弘季加利理财债券型证券投资基金基金合同

3、天弘季加利理财债券型证券投资基金招募说明书

4、天弘季加利理财债券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

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
二〇一五年十月二十四日

天弘沪深300指数型发起式证券投资基金

【2015】第三季度报告

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10月24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。

基金托管人招商证券股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年10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7月1日起至2015年9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01月20日
报告期末基金份额总额	484,434,603.45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07月01日-2015年09月30日)
1.本期已实现收益	-53,596,417.02
2.本期利润	-199,637,175.12
3.加权平均基金份额本期利润	-0.3819
4.期末基金资产净值	445,652,564.32
5.期末基金份额净值	0.9199

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。

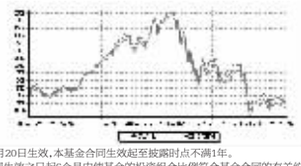
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如,开放式基金的申购赎回费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

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	-28.53%	3.27%	-27.06%	3.18%	-1.47%	0.09%

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、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,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。

§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		
李蕴炜	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、Ophedge 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、天弘永定价值成长混合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

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9月30日,本基金份额净值为0.9199元,本报告期份额净值增长率-28.53%,同期业绩比较基准增长率-27.06%。

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	404,046,590.96	90.29
	其中:股票	404,046,590.96	90.29
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	38,434,042.13	8.59
8	其他资产	5,023,089.92	1.12
9	合计	447,503,723.01	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	959,133.00	0.22
B	采矿业	16,412,858.03	3.68
C	制造业	131,395,365.86	29.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	15,779,116.68	3.54
E	建筑业	17,738,902.98	3.98
F	批发和零售业	9,286,585.04	2.08
G	交通运输、仓储和邮政业	15,323,154.62	3.44
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	21,942,516.63	4.92
J	金融业	142,873,720.25	32.06
K	房地产业	18,201,221.04	4.08
L	租赁和商务服务业	3,683,550.48	0.83
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	3,379,743.00	0.76
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	526,459.08	0.12
R	文化、体育和娱乐业	5,571,140.88	1.25
S	综合	973,123.39	0.22
	合计	404,046,590.96	90.66

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	567,400	16,942,564.00	3.80
2	600036	招商银行	872,200	15,498,994.00	3.48
3	600016	民生银行	1,562,137	13,200,057.65	2.96
4	600000	浦发银行	587,712	9,773,650.56	2.19
5	601166	兴业银行	573,900	8,355,984.00	1.87
6	000002	万 科A	488,979	6,224,702.67	1.40
7	601766	中国中车	470,708	6,105,082.76	1.37
8	601328	交通银行	981,500	5,967,520.00	1.34
9	600030	中信证券	392,800	5,334,224.00	1.20
10	601398	工商银行	1,216,078	5,253,456.96	1.18

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

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

代码	名称	持仓量(买/卖)	合约市值(元)	公允价值变动(元)	风险说明
IF1512	沪深300期货1512合约	10	8,971,200.00	-1,902,900.00	买入股指期货多头合约的目的是进行更有效地流动性管理。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

本基金为指数型基金,主要投资标的为指数成份股和备选成份股。基金留存的现金头寸根据基金合同规定,投资于标的指数为基础资产的股指期货,旨在配合基金日常投资管理需要,更有效地进行流动性管理,以更好地跟踪标的指数,实现投资目标。

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	3,966,877.48
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	14,110.05
5	应收申购款	1,042,102.39
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	5,023,089.92

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	550,329,699.90
报告期期间基金总申购份额	444,377,207.03
减:报告期期间基金总赎回份额	510,272,303.48
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	484,434,603.45

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	9,190,331.77
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	19,190,331.77
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	3.96

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07月29日	9,190,331.77	10,001,000.00	-
合计			9,190,331.77	10,001,000.00	

注:上述申购金额达500万元以上,申购费率为固定费用,每笔1000元。

§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	19,190,331.77	3.96%	10,000,000.00	2.06%	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	19,190,331.77	3.96%	10,000,000.00	2.06%	-

§9 影响投资者决策的其他重要信息

基金管理人住址于2015年8月27日由"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"变更为"天津自贸区(中心商务区)响螺湾旷世国际大厦A座1704-241号",上述住所变更已办理完毕工商变更登记。

§10 备查文件目录

10.1 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

10.2 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

10.3 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
二〇一五年十月二十四日

天弘互联网灵活配置混合型证券投资基金

【2015】第三季度报告

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:2015年10月24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。

基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2015年10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7月1日起至2015年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	天弘互联网混合
基金主代码	001210
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年5月29日
报告期末基金份额总额	2,327,464,757.80份
投资目标	在严格控制风险的前提下,本基金通过股票与债券等资产的合理配置,利用公司大数据研究优势优选引领互联网技术发展升级的信息产业及相关受益行业的优质企业进行投资,力求为基金份额持有人获取超过业绩比较基准的收益。
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;其次是充分发挥公司大数据研究平台的优势,通过建立量化模型优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	60%×中证TMT产业主题指数收益率+40%×中证综合债指数收益率。
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。
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

§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7月1日-2015年9月30日)
1.本期已实现收益	-658,652,519.32
2.本期利润	-383,739,819.79
3.加权平均基金份额本期利润	-0.1543
4.期末基金资产净值	1,488,445,633.57
5.期末基金份额净值	0.6395

3.1.1 主要财务指标_上期

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2015年5月29日-2015年6月30日)
1.本期已实现收益	-109,492,968.18
2.本期利润	-541,070,590.13
3.加权平均基金份额本期利润	-0.2095
4.期末基金资产净值	2,041,128,544.44
5.期末基金份额净值	0.7905

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、本基金合同生效日为2015年5月29日,截止2015年6月30日本基金合同生效不足二个月,依据相关法律法规,未编制当期季度