

天弘债券型发起式证券投资基金

【2016】第四季度报告

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：2017年01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2017年1月18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、误导性陈述或者重大遗漏。

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，也不保证基金份额持有人本金不受损失或者本金不受损失。

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，也不保证基金份额持有人本金不受损失或者本金不受损失。

本财务报表资料未经审计。

本报告自2016年10月1日起至2016年12月31日止。

基金概况	
基金名称	天弘债券型发起式
基金代码	420008
基金运作方式	契约型开放式、发起式
基金合同生效日	2012年07月10日
报告期末基金份额总额	602,046,730.27份
投资目标	本基金在追求基金资产长期稳健增值的基础上，力争获取高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金通过对宏观经济、利率走势、债券供求、信用风险状况、证券市场走势等方面的分析判断，在严格控制风险的基础上，采用积极主动的投资策略，力求实现基金资产的长期稳定增值。
业绩比较基准	中证100指数收益率×90%+银行人民币活期存款利率×10%
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中风险较低的种类，其风险收益预期高于货币型基金，低于混合型基金和股票型基金。
基金管理人	天弘基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
下属二级基金名称	天弘债券型发起式A
下属二级基金代码	420009
下属二级基金资产净值	601,238,186.03份

§3 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

主要财务指标		报告期（2016年10月01日-2016年12月31日）	
1.本期已实现收益	58,675.01	-	417,588.94
2.本期净利润	-2,010,700.28	-	-17,312,302.26
3.本期基金费用总额	-	-	-409.09
4.本期基金资产净值	73,028,766.60	-	597,124,390.07
5.本期基金净值增长率	1.12%	-	1.12%

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。

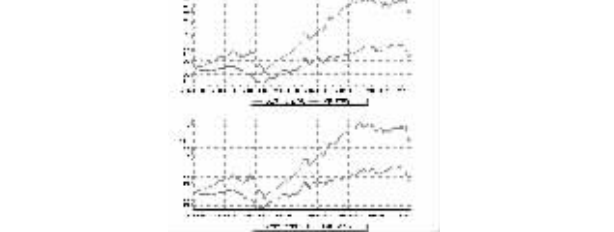
2、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费）等，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3、基金净值表现

3.1 本报告期末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

期间	净值增长率①	业绩比较基准收益率②	①-②
过去三个月	-2.50%	0.23%	-2.23%
过去六个月	-0.23%	0.15%	-0.38%
过去一年	0.08%	0.08%	0.00%

3.2 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2012年07月10日生效。

2、本报告期，本基金的业绩比较基准达到基金合同约定的业绩比较基准。

4.1 基金管理人（或基金托管人）简介

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

注：1、上述任期为自本报告期末起算的最近任期。

2、证券投资基金的基金管理人（或基金托管人）的任职日期，是指其首次被任命为基金管理人（或基金托管人）的日期。

4.2 基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准

基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准为：中证100指数收益率×90%+银行人民币活期存款利率×10%。

4.3 基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准

基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准为：中证100指数收益率×90%+银行人民币活期存款利率×10%。

4.4 基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准

基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准为：中证100指数收益率×90%+银行人民币活期存款利率×10%。

4.5 基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准

基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准为：中证100指数收益率×90%+银行人民币活期存款利率×10%。

4.6 基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准

基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准为：中证100指数收益率×90%+银行人民币活期存款利率×10%。

4.7 基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准

基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准为：中证100指数收益率×90%+银行人民币活期存款利率×10%。

4.8 基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准

基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准为：中证100指数收益率×90%+银行人民币活期存款利率×10%。

4.9 基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准

基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准为：中证100指数收益率×90%+银行人民币活期存款利率×10%。

4.10 基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准

基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准为：中证100指数收益率×90%+银行人民币活期存款利率×10%。

4.11 基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准

基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准为：中证100指数收益率×90%+银行人民币活期存款利率×10%。

4.12 基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准

基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准为：中证100指数收益率×90%+银行人民币活期存款利率×10%。

4.13 基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准

基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准为：中证100指数收益率×90%+银行人民币活期存款利率×10%。

4.14 基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准

基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准为：中证100指数收益率×90%+银行人民币活期存款利率×10%。

4.15 基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准

基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准为：中证100指数收益率×90%+银行人民币活期存款利率×10%。

4.16 基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准

基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准为：中证100指数收益率×90%+银行人民币活期存款利率×10%。

4.17 基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准

基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准为：中证100指数收益率×90%+银行人民币活期存款利率×10%。

4.18 基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准

基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准为：中证100指数收益率×90%+银行人民币活期存款利率×10%。

4.19 基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准

基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准为：中证100指数收益率×90%+银行人民币活期存款利率×10%。

4.20 基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准

基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准为：中证100指数收益率×90%+银行人民币活期存款利率×10%。

4.21 基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准

基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准为：中证100指数收益率×90%+银行人民币活期存款利率×10%。

4.22 基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准

基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准为：中证100指数收益率×90%+银行人民币活期存款利率×10%。

4.23 基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准

基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准为：中证100指数收益率×90%+银行人民币活期存款利率×10%。

4.24 基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准

基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准为：中证100指数收益率×90%+银行人民币活期存款利率×10%。

4.25 基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准

基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准为：中证100指数收益率×90%+银行人民币活期存款利率×10%。

4.26 基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准

基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准为：中证100指数收益率×90%+银行人民币活期存款利率×10%。

4.27 基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准

基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准为：中证100指数收益率×90%+银行人民币活期存款利率×10%。

4.28 基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准

基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准为：中证100指数收益率×90%+银行人民币活期存款利率×10%。

4.29 基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准

基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准为：中证100指数收益率×90%+银行人民币活期存款利率×10%。

4.30 基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准

基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准为：中证100指数收益率×90%+银行人民币活期存款利率×10%。

4.31 基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准

基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准为：中证100指数收益率×90%+银行人民币活期存款利率×10%。

4.32 基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准

基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准为：中证100指数收益率×90%+银行人民币活期存款利率×10%。

4.33 基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准

基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准为：中证100指数收益率×90%+银行人民币活期存款利率×10%。

4.34 基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准

基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准为：中证100指数收益率×90%+银行人民币活期存款利率×10%。

4.35 基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准

基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准为：中证100指数收益率×90%+银行人民币活期存款利率×10%。

4.36 基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准

基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准为：中证100指数收益率×90%+银行人民币活期存款利率×10%。

4.37 基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准

基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准为：中证100指数收益率×90%+银行人民币活期存款利率×10%。

4.38 基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准

基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准为：中证100指数收益率×90%+银行人民币活期存款利率×10%。

4.39 基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准

基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准为：中证100指数收益率×90%+银行人民币活期存款利率×10%。

4.40 基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准

基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准为：中证100指数收益率×90%+银行人民币活期存款利率×10%。

4.41 基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准

基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准为：中证100指数收益率×90%+银行人民币活期存款利率×10%。

4.42 基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准

基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准为：中证100指数收益率×90%+银行人民币活期存款利率×10%。

4.43 基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准

基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准为：中证100指数收益率×90%+银行人民币活期存款利率×10%。

4.44 基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准

基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准为：中证100指数收益率×90%+银行人民币活期存款利率×10%。

4.45 基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准

基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准为：中证100指数收益率×90%+银行人民币活期存款利率×10%。

4.46 基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准

基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准为：中证100指数收益率×90%+银行人民币活期存款利率×10%。

4.47 基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准

基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准为：中证100指数收益率×90%+银行人民币活期存款利率×10%。

4.48 基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准

基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准为：中证100指数收益率×90%+银行人民币活期存款利率×10%。

4.49 基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准

基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准为：中证100指数收益率×90%+银行人民币活期存款利率×10%。

4.50 基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准

基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准为：中证100指数收益率×90%+银行人民币活期存款利率×10%。

4.51 基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准

基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准为：中证100指数收益率×90%+银行人民币活期存款利率×10%。

4.52 基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准

基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准为：中证100指数收益率×90%+银行人民币活期存款利率×10%。

4.53 基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准

基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准为：中证100指数收益率×90%+银行人民币活期存款利率×10%。

4.54 基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准

基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准为：中证100指数收益率×90%+银行人民币活期存款利率×10%。

4.55 基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准

基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准为：中证100指数收益率×90%+银行人民币活期存款利率×10%。

4.56 基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准

基金管理人（或基金托管人）的业绩比较基准为：中证100指数收益率×90%+银行人民币活期存款利率×10%。

代码	行业类别	公允价值	占基金资产净值比例（%）
A 农林、牧、渔	-	3,346,062.00	0.50
B 采矿业	-	-	-
C 制造业	-	1,146,028.00	0.17
D 电力、热力、燃气及生产供应业	-	-	-
E 建筑业	-	-	-
F 批发和零售业	-	-	-
G 金融业	-	-	-
H 交通运输、仓储和邮政业	-	-	-
I 住宿和餐饮业	-	-	-
J 房地产业	-	104,560.00	0.02
K 房地产业	-	-	-
L 租赁和商务服务业	-	-	-
M 科学研究和技术服务业	-	-	-
N 水利、环境和公共设施管理业	-	-	-
O 金融业	-	-	-
P 信息、软件和信息技术服务业	-	-	-
Q 教育	-	-	-
R 文化、体育和娱乐业	-	-	-
S 综合	-	-	-
合计	-	4,507,652.00	0.69

§3 主要财务指标和基金净值表现

单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	数量（股）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	002714	双钱股份	142,727	3,346,062.00	0.50
2	600308	宁波能源	22,200	1,146,028.00	0.17
3	300096	中润资源	2,000	104,560.00	0.02

§4 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债券投资明细

单位：人民币元

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	144002	14天石转债	500,000	55,075,000.00	7.98
2	01000001	01国债01	400,000	40,726,000.00	5.91
3	120001	12国债01	272,000	42,220,000.00	6.21
4	120003	12国债03	400,000	40,380,000.00	6.02
5	100204	10国债04	400,000	39,380,000.00	5.65

§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

单位：人民币元

3	应付债券		26,214,847.81
4	应收利息		7,708,369.92
5	应收申购款		8,433.60
6	其他应收款		--
7	待摊费用		--
8	其他		--
9	合计		31,931,759.36

11.14 报告期末持有的处于转股期可转换债券明细

金额单位：人民币元				
序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	123001	14国债01	42,200,000.00	6.21
2	110001	电气转债	22,622,920.20	3.32
3	110002	二一转债	22,500,282.00	3.36
4	110003	新昌转债	21,143,753.40	3.15
5	130003	14国债03	20,467,400.00	3.06
6	130004	14国债04	19,536,000.00	2.91
7	120003	12国债03	8,004,122.00	1.21

11.15 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

§6 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	130001	13国债01	42,200,000.00	6.21
2	110001	11国债01	22,200,000.00	3.26
3	110003	11国债03	21,140,750.00	3.15
4	130003	13国债03	20,467,400.00	3.06
5	130004	13国债04	19,536,000.00	2.91
6	120003	12国债03	8,004,122.00	1.21

§7 基金管理人持有的其他资产情况

单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	130001	13国债01	42,200,000.00	6.21
2	110001	11国债01	22,200,000.00	3.26
3	110003	11国债03	21,140,750.00	3.15
4	130003	13国债03	20,467,400.00	3.06
5	130004	13国债04	19,536,000.00	2.91
6	120003	12国债03	8,004,122.00	1.21

§8 基金管理人持有的其他资产情况

单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	130001	13国债01	42,200,000.00	6.21
2	110001	11国债01	22,200,000.00	3.26
3	110003	11国债03	21,140,750.00	3.15
4	130003	13国债03	20,467,400.00	3.06
5	130004	13国债04	19,536,000.00	2.91
6	120003	12国债03	8,004,122.00	1.21

§9 基金管理人持有的其他资产情况

单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	130001	13国债01	42,200,000.00	6.21
2	110001	11国债01	22,200,000.00	3.26
3	110003	11国债03	21,140,750.00	3.15
4	130003	13国债03	20,467,400.00	3.06
5	130004	13国债04	19,536,000.00	2.91
6	120003	12国债03	8,004,122.00	1.21

§10 基金管理人持有的其他资产情况

单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	130001	13国债01	42,200,000.00	6.21
2	110001	11国债01	22,200,000.00	3.26
3	110003	11国债03	21,140,750.00	3.15
4	130003	13国债03	20,467,400.00	3.06
5	130004	13国债04	19,536,000.00	2.91
6	120003	12国债03	8,004,122.00	1.21

§11 基金管理人持有的其他资产情况

单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例（%）
1	130001	13国债01	42,200,000.00	6.21
2	110001	11国债01	22,200,000.00	3.26
3	110003	11国债03	21,140,750.00	3.15
4	130003	13国债03	20,467,400.00	3.06
5	130004	13国债04	19,536,000.00	2.91
6	120003	12国债03	8,004,122.00	1.21

天弘增益宝货币市场基金

【2016】第四季度报告

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
报告送出日期：2017年01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。

基金托管人恒丰银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年1月18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、误导性陈述或者重大遗漏。

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，也不保证基金份额持有人本金不受损失或者本金不受损失。

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，也不保证基金份额持有人本金不受损失或者本金不受损失。

本财务报表资料未经审计。

本报告自2016年10月1日起至2016年12月31日止。

基金概况	
基金名称	天弘增益宝货币
基金代码	001008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年03月09日
报告期末基金份额总额	126,711,032.09份
投资目标	在保持基金资产的低风险和流动性的前提下，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走势的判断，采取投资组合平均期限策略，在严格控制风险的基础上，力求实现基金资产的长期稳定增值。
业绩比较基准	银行人民币活期存款利率（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，其预期收益和风险低于股票型基金、混合型基金及债券型基金。