

## 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、监事、高级管理人员和基金经理等人员不存在虚假记载、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。  
本基金的基金合同由基金管理人和基金托管人订立，对双方具有同等法律约束力。基金合同正本在基金管理人和基金托管人处各存有一份，基金合同副本经公证机关公证后由基金管理人和基金托管人各执一份，基金管理人和基金托管人承诺按照基金合同的规定履行各自的义务，但不保证基金一定盈利。  
基金财产独立于基金管理人、基金托管人和代销机构的财产，并由基金托管人保管。  
基金募集期间产生的利息归基金份额持有人所有，投资有风险，投资人应当在投资决策前仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金份额自2016年10月1日起至2016年12月31日止。

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

## § 2 基金产品概况

基金管理人的董事、监事、高级管理人员和基金经理等人员不存在虚假记载、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。  
本基金的基金合同由基金管理人和基金托管人订立，对双方具有同等法律约束力。基金合同正本在基金管理人和基金托管人处各存有一份，基金合同副本经公证机关公证后由基金管理人和基金托管人各执一份，基金管理人和基金托管人承诺按照基金合同的规定履行各自的义务，但不保证基金一定盈利。  
基金财产独立于基金管理人、基金托管人和代销机构的财产，并由基金托管人保管。  
基金募集期间产生的利息归基金份额持有人所有，投资有风险，投资人应当在投资决策前仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金份额自2016年10月1日起至2016年12月31日止。

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

## § 3 主要财务指标

基金管理人的董事、监事、高级管理人员和基金经理等人员不存在虚假记载、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。  
本基金的基金合同由基金管理人和基金托管人订立，对双方具有同等法律约束力。基金合同正本在基金管理人和基金托管人处各存有一份，基金合同副本经公证机关公证后由基金管理人和基金托管人各执一份，基金管理人和基金托管人承诺按照基金合同的规定履行各自的义务，但不保证基金一定盈利。  
基金财产独立于基金管理人、基金托管人和代销机构的财产，并由基金托管人保管。  
基金募集期间产生的利息归基金份额持有人所有，投资有风险，投资人应当在投资决策前仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金份额自2016年10月1日起至2016年12月31日止。

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

## 代码 行业类别 公允价值 占基金资产净值比例(%)

A 林、农、渔、畜牧业	3,346,662.96	0.06
B 矿业	-	-
C 制造业	1,146,421.00	0.03
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E 建筑业	-	-
F 批发零售业	-	-
G 交通运输、仓储和邮政业	-	-
H 住宿和餐饮业	-	-
I 信息传输、软件和信息技术服务业	104,360.00	0.02
J 金融业	-	-
K 房地产业	-	-
L 租赁和商务服务业	-	-
M 科学研究、技术服务与地质勘查业	-	-
N 水利、环境和公共设施管理业	-	-
O 居民服务、修理和其他服务业	-	-
P 教育	-	-
Q 卫生、社会保障和社会福利业	-	-
R 文化、体育和娱乐业	-	-
S 综合	-	-
合计	4,569,662.96	0.09

## 5.2 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	占基金资产净值比例(%)
1	002714	丽珠集团	143,767	3,346,662.96	0.06
2	600338	中航黑豹	22,000	1,146,421.00	0.03
3	300406	中科创达	2,000	104,360.00	0.02

## 5.3 报告期末按债券品种的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债	59,968,000.00	0.04
4	企业债券	299,754,630.00	0.03
5	企业短期融资券	69,569,000.00	0.03
6	中期票据	-	-
7	可转债(含权)	186,063,444.70	0.02
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	606,346,063.00	0.09

## 5.4 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

序号	品种	名称	数量(克)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	黄金	100.00	100.00	0.00	0.00%

## 5.5 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)
	天弘债券型发起式A	天弘债券型发起式B
	1.本期初至报告期期末的已实现收益总额	50,675,051.00
	2.本期利润	417,990.04
	3.加权平均基金份额本期利润	-0.0210,702.00
	4.期末基金份额净值	-0.0294
	5.期末基金资产净值	73,036,966.08
	6.期末基金份额净值	0.97134,306.07
	7.期末可供分配基金份额利润	0.0000
	8.期末基金资产净值	73,036,966.08
	9.期末基金份额净值	0.97134,306.07

## 5.6 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)
	天弘债券型发起式A	天弘债券型发起式B
	1.本期初至报告期期末的已实现收益总额	50,675,051.00
	2.本期利润	417,990.04
	3.加权平均基金份额本期利润	-0.0210,702.00
	4.期末基金份额净值	-0.0294
	5.期末基金资产净值	73,036,966.08
	6.期末基金份额净值	0.97134,306.07
	7.期末可供分配基金份额利润	0.0000
	8.期末基金资产净值	73,036,966.08
	9.期末基金份额净值	0.97134,306.07

## 5.7 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)
	天弘债券型发起式A	天弘债券型发起式B
	1.本期初至报告期期末的已实现收益总额	50,675,051.00
	2.本期利润	417,990.04
	3.加权平均基金份额本期利润	-0.0210,702.00
	4.期末基金份额净值	-0.0294
	5.期末基金资产净值	73,036,966.08
	6.期末基金份额净值	0.97134,306.07
	7.期末可供分配基金份额利润	0.0000
	8.期末基金资产净值	73,036,966.08
	9.期末基金份额净值	0.97134,306.07

## 5.8 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)
	天弘债券型发起式A	天弘债券型发起式B
	1.本期初至报告期期末的已实现收益总额	50,675,051.00
	2.本期利润	417,990.04
	3.加权平均基金份额本期利润	-0.0210,702.00
	4.期末基金份额净值	-0.0294
	5.期末基金资产净值	73,036,966.08
	6.期末基金份额净值	0.97134,306.07
	7.期末可供分配基金份额利润	0.0000
	8.期末基金资产净值	73,036,966.08
	9.期末基金份额净值	0.97134,306.07

## 5.9 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)
	天弘债券型发起式A	天弘债券型发起式B
	1.本期初至报告期期末的已实现收益总额	50,675,051.00
	2.本期利润	417,990.04
	3.加权平均基金份额本期利润	-0.0210,702.00
	4.期末基金份额净值	-0.0294
	5.期末基金资产净值	73,036,966.08
	6.期末基金份额净值	0.97134,306.07
	7.期末可供分配基金份额利润	0.0000
	8.期末基金资产净值	73,036,966.08
	9.期末基金份额净值	0.97134,306.07

## 5.10 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)





<tbl\_r cells="3" ix="5" maxcspan="1" maxr