

## 天弘价值精选灵活配置混合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:交通银行股份有限公司  
报告期截至日期:2017年1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。  
报告期截至日期:2017年1月10日，于2017年1月10日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资收益等指标，确保所有指标数据真实、准确、完整。有关基金合同、基金招募说明书和基金产品资料概要的最新情况，请登至基金管理人网站：[www.thfund.com](http://www.thfund.com)。

基金管理人对本基金定期报告所载资料的内容负完全责任。  
本报告期间2016年10月1日起至2016年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

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	-	-	-
B 矿业	-	-	-
C 制造业	26,797,010.45	4.16	
D 电力、热力、燃气及水生产和供应业	37,917.66	0.01	
E 建筑业	15,502.23	-	
F 批发和零售业	151,001.62	0.02	
G 交通运输、仓储和邮政业	9,408.68	-	
H 住宿和餐饮业	-	-	
I 信息传输、软件和信息技术服务业	234,375.00	0.04	
J 其他服务业	13,036,640.00	2.52	
K 房地产业	6,506,115.00	1.01	
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 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	-	-	
S 综合	-	-	
合计	46,787,610.64	7.26	

§ 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1日-2016年12月31日)
1.本期已实现收益	10,379,060.71	
2.本期利润	5,960,544.07	
3.期末平均基金份额本期利润	0.0065	
4.期末基金资产净值	644,115,085.32	
5.期末基金份额净值	1.0108	

注:1.本报告期内已实现收益指基金利息收入、股息收益、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。

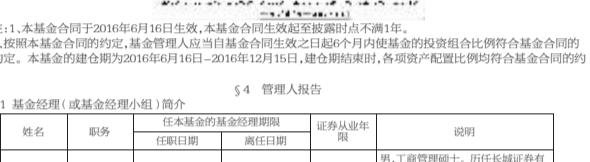
2.所涉基金净值指标不包括持有人认购或申购基金产生的费用(例如,开放式基金的申购赎回费等),计价费用后实际收益水平将低于所列数字。

3.本基金合同于2016年6月16日生效。

3.2 报告期内基金资产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①	净值增长②	净值增长③	业绩比较基准涨跌幅④	业绩比较基准净值涨跌幅⑤	①-③	②-④
过去三个月	0.62%	0.13%	0.01%	0.44%	0.61%	-0.31%	

3.2.2 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2016年6月16日生效,本基金合同生效起至披露日前不足1年。

2.证券业协会的含义遵从行业协会《证券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合规、遵循规定的情况说明

本基金合同规定的基金合同相关的约定进行操作,不存在违法违规及未履行基金合同承诺的情况。

4.2 公平交易专项说明

4.3 公平交易制度的执行情况

公平交易的执行情况包括:以相对的研究平台和公平信息平台,保证各组合得到公平的投资机会;公平对待不同投资组合,禁止不公平交易行为;在投资决策和投资管理过程中公平对待不同投资组合;建立公平交易和合

投资组合的公平交易行为;公平对待不同投资组合的交易分配;建立公平交易和合

投资组合的公平交易行为;公平对待不同投资组合的交易分配;建立