天弘安康养老混合型证券投资基金

【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2016年10月1日起至2016年12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	天弘安康养老混合
基金主代码	420009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年11月28日
报告期末基金份额总额	892,785,752.15份
投资目标	本基金主要投资于债券等固定收益类金融工具,辅助投资于精选的价值型股票,通过灵活的资产配置与严谨的风险管理,力求实现基金资产持续稳定增值,为投资者提供稳健的养老理财工具。
投资策略	本基金采取稳健的投资策略,通过债券等固定收益类资产的投资获取平稳收益,并适度参与股票等权益类资产的投资增强回报,在灵活配置各类资产以及严格的风险管理基础上,力争实现基金资产的持续稳定增值。
业绩比较基准	三年期银行定期存款利率(税后)+0.75%
风险收益特征	本基金为债券投资为主的混合型基金,属于中低风险、中低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

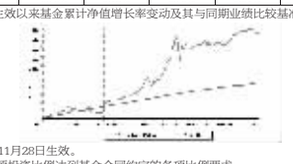
单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2016年10月1日-2016年12月31日)
1.本期已实现收益	20,135,374.84
2.本期利润	-10,264,925.14
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0094
4.期末基金资产净值	1,277,464,576.08
5.期末基金份额净值	1.431

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、本基金合同自2012年11月28日起生效。
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	-0.76%	0.12%	0.76%	0.01%	-1.52%	0.11%

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2012年11月28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		
姜晓丽	本基金基金经理。	2013年1月	-	7年	女,经济学硕士。历任本公司债券研究员兼债券交易员;光大永明人寿保险有限公司债券研究员兼交易员;本公司固定收益研究员、基金经理助理等。
钱文成	本基金基金经理。	2014年1月	-	10年	男,理学硕士。2007年5月加盟本公司,历任本公司行业研究员、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、研究总监、股票投资部副总经理、基金经理助理等。

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,公司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
2016年四季度,经济基本面延续8月份以来的复苏态势,基本面持续向好,下游地产汽车也表现强势,拉动经济增长出现明显改善。通胀方面,CPI整体平稳,但是PPI方面由于基数效应及大宗商品表现强势,同比增速出现快速反弹。政策方面,央行于8、9月份分别重启14天和28天逆回购,拉长提供资金期限,货币政策有所转向,态度明显偏紧。资金面方面,四季度资金利率中枢快速上行,波动明显加大。央行通过拉长提供资金期限以抬升资金成本中枢,同时央行对资金利率波动率容忍程度也明显提高,因此导致四季度资金利率波动率和中枢均较前三季度明显上升。债市方面,多种因素之下,四季度市场出现快速巨幅调整。
本基金在报告期内,总体以债券仓位为主,以稳健风格进行投资,在债市出现波动时适度降仓以进一步防范风险,同时根据对股市判断严格控制权益仓位进行投资,充分把握和参与权益市场的机会,在市场波动的情况下实现了稳健操作。
4.5 报告期内基金的业绩表现
截至2016年12月31日,本基金份额净值为1.431元,本报告期份额净值增长率-0.76%,同期业绩比较基准增长率0.76%。
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2017年一季度,我们认为经济下行压力将逐渐显现,但短期来看,补库存尚未结束,地产销售下行也尚未传导至工业端,因此将维持大致稳定,未来需要持续观察基本面信号等待下行拐点。资金面方面,脉冲式收紧仍将出现,资金利率中枢趋势性抬升,资金利率波动性加大。政策面方面,货币政策边际趋紧,以配合防范金融风险和抑制资产泡沫。
对于债券市场未来的看法,我们认为在基本面向下拐点出现之前,债券市场将维持区间波动的态势,票息收益仍然是债券市场最具有确定性的收益来源。未来收益率有一定的下行空间,但是由于政策边际紧缩以及债市交易结构的不稳定性,未来债市仍将面临一定的波动。
投资策略上,本基金将继续以债券仓位为主,稳健操作,同时适当精选个股参与二级市场的机会,继续为客户贡献稳健正收益。

§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(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	124,706,439.98	9.71
	其中:股票	124,706,439.98	9.71
2	基金投资	-	-
3	固定收益投资	991,379,195.60	77.22
	其中:债券	991,379,195.60	77.22
	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	108,000,000.00	8.41
	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	19,408,355.36	1.51
8	其他资产	40,338,722.89	3.14
9	合计	1,283,832,713.83	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合
5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

序号	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	采矿业	21,640,000.00	1.69
C	制造业	68,548,696.95	5.37
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	37,917.66	-
E	建筑业	15,592.23	-
F	批发和零售业	-	-
G	交通运输、仓储和邮政业	9,458.68	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	16,087,994.46	1.26
J	金融业	106,780.00	0.01
K	房地产业	18,260,000.00	1.43
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	124,706,439.98	9.76

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	600104	上汽集团	999,919	23,448,100.55	1.84
2	000625	长安汽车	1,299,891	22,384,123.02	1.75
3	600028	中国石化	4,000,000	21,640,000.00	1.69
4	600048	保利地产	2,000,000	18,260,000.00	1.43
5	300017	网宿科技	299,966	16,081,177.26	1.26
6	300159	新研股份	999,996	13,579,945.68	1.06
7	600178	东安动力	524,295	5,788,216.80	0.45
8	000951	中国重汽	169,873	2,284,791.85	0.18
9	002831	裕同科技	2,219	153,554.80	0.01
10	601375	中原证券	26,695	106,780.00	0.01

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	59,940,000.00	4.69
	其中:政策性金融债	59,940,000.00	4.69
4	企业债券	854,657,675.20	66.90
5	企业短期融资券	20,098,000.00	1.57
6	中期票据	51,348,000.00	4.02
7	可转债	5,335,520.40	0.42
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	991,379,195.60	77.61

注:可转债项下包含可交换债5,335,520.40元。
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	122298	13亚盛债	600,000	62,004,000.00	4.85
2	160209	16国开09	600,000	59,940,000.00	4.69
3	112208	14华邦01	500,000	52,590,000.00	4.12
4	1380054	13天瑞水泥债	500,000	49,275,000.00	3.86
5	1280092	12桂铁投债	400,000	44,716,000.00	3.50

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	125,504.89
2	应收证券清算款	11,248,584.72
3	应收股利	-
4	应收利息	28,715,417.55
5	应收申购款	249,215.73
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	40,338,722.89

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

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	132004	15国成KB	3,751,573.60	0.29

5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末前十名股票中不存在流通受限情况。
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	1,179,947,898.97
报告期期间基金总申购份额	40,319,052.01
减:报告期期间基金总赎回份额	327,481,198.83
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	892,785,752.15

注:总申购份额含转换转入份额;总赎回份额含转换转出份额。

§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	90,771,558.25
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	90,771,558.25
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	10.17

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§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安康养老混合型证券投资基金募集的文件
2、天弘安康养老混合型证券投资基金基金合同
3、天弘安康养老混合型证券投资基金托管协议
4、天弘安康养老混合型证券投资基金招募说明书
5、报告期内在指定报刊上披露的各项公告
6、中国证监会规定的其他文件
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办公场所及网站或基金托管人的办公场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
二〇一七年一月二十日

天弘创业板指数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:国泰君安证券股份有限公司
报告送出日期: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。
基金托管人国泰君安证券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2016年10月1日起至2016年12月31日止。

§2 基金产品概况

基金简称	天弘创业板	
基金主代码	001592	
基金运作方式	契约型开放式,发起式	
基金合同生效日	2015年7月8日	
报告期末基金份额总额	508,236,889.59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	创业板指数收益率×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	国泰君安证券股份有限公司	
下属分级基金的基金简称	天弘创业板A	天弘创业板C
下属分级基金的交易代码	001592	001593
报告期末下属分级基金的份额总额	344,921,686.30份	163,315,203.29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(2016年10月1日-2016年12月31日)	
	天弘创业板A	天弘创业板C
1.本期已实现收益	1,212,550.08	162,236.92
2.本期利润	-19,207,481.86	-10,546,765.11
3.加权平均基金份额本期利润	-0.0725	-0.0981
4.期末基金资产净值	269,286,248.87	126,733,147.67
5.期末基金份额净值	0.7807	0.7760

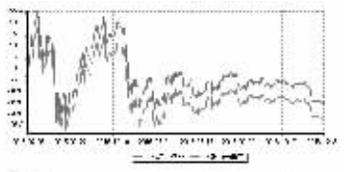
注:1.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
2.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如,开放式基金的申购赎回费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
3.本基金合同于2015年7月8日生效。
3.2 基金净值表现
3.2.1 本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较
天弘创业板A

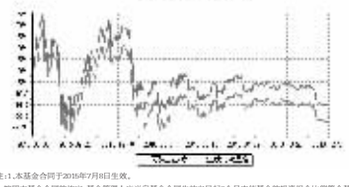
阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	-8.67%	0.99%	-8.30%	1.01%	-0.37%	-0.02%

天弘创业板C

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	-8.76%	0.99%	-8.30%	1.01%	-0.46%	-0.02%

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7月8日生效。
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7月8日-2016年1月7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。

§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		
刘冬	本基金基金经理。	2015年7月	-	10年	男,经济学硕士。2007年7月至2008年10月在长江证券股份有限公司研究部任宏观策略研究员。2008年11月加盟本公司,历任本公司投资部固定收益研究员、宏观策略研究员、基金经理助理等。

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,公司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
2016年四季度,经济基本面延续8月份以来的复苏态势,基本面持续向好,下游地产汽车也表现强势,拉动经济增长出现明显改善。通胀方面,CPI整体平稳,但是PPI方面由于基数效应及大宗商品表现强势,同比增速出现快速反弹。政策方面,央行于8、9月份分别重启14天和28天逆回购,拉长提供资金期限,货币政策有所转向,态度明显偏紧。资金面方面,四季度资金利率中枢快速上行,波动明显加大。央行通过拉长提供资金期限以抬升资金成本中枢,同时央行对资金利率波动率容忍程度也明显提高,因此导致四季度资金利率波动率和中枢均较前三季度明显上升。债市方面,多种因素之下,四季度市场出现快速巨幅调整。
本基金在报告期内,整体维持低杠杆短久期的谨慎态度,在债市出现波动时适度降仓以进一步防范风险,在市场波动的情况下实现了稳健操作。
4.5 报告期内基金的业绩表现
截至2016年12月31日,本基金的基金份额净值为1.1186元,本报告期份额净值增长率为-0.95%,同期业绩比较基准增长率为-2.32%。
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2017年一季度,我们认为经济下行压力将逐渐显现,但短期来看,补库存尚未结束,地产销售下行也尚未传导至工业端,因此将维持大致稳定,未来需要持续观察基本面信号等待下行拐点。资金面方面,脉冲式收紧仍将出现,资金利率中枢趋势性抬升,资金利率波动性加大。政策面方面,货币政策边际趋紧,以配合防范金融风险和抑制资产泡沫。
对于债券市场未来的看法,我们认为在基本面向下拐点出现之前,债券市场将维持区间波动的态势,票息收益仍然是债券市场最具有确定性的收益来源。未来收益率有一定的下行空间,但是由于政策边际紧缩以及债市交易结构的不稳定性,未来债市仍将面临一定的波动。
投资策略上,本基金将密切跟踪宏观经济形势,及时调整组合策略,同时信用风险暴露阶段,细心甄别个券,降低组合信用风险,继续为投资者赚取稳健收益。

§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	374,894,586.88	92.36
	其中:股票	374,894,586.88	92.36
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	26,179,415.57	6.45
8	其他资产	4,835,147.97	1.19
9	合计	405,909,150.42	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

金额单位:人民币元

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	4,699,510.26	1.19
B	采矿业	-	-
C	制造业	176,168,690.55	44.48
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	3,887,874.90	0.98
F	批发和零售业	2,149,440.00	0.54
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	127,804,106.43	32.27
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	7,221,028.17	1.82
M	科学研究和技术服务业	-	-
N	水利、环境和公共设施管理业	10,272,852.00	2.59
O	居民服务、修理和其他服务业	-	-
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	11,086,256.92	2.80
R	文化、体育和娱乐业	26,333,165.72	6.65
S	综合	-	-
	合计	369,622,924.95	93.33

5.2.2 报告期末(非股投资)按行业分类的股票投资组合

金额单位:人民币元

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	采矿业	-	-
C	制造业	4,404,822.00	1.11
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	-	-
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	866,839.93	0.22
J	金融业	-	-
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	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	5,271,661.93	1.33

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
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

金额单位:人民币元

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	300059	东方财富	837,535	14,179,467.55	3.58
2	300104	乐视网	329,102	11,781,851.60	2.98
3	300072	三聚环保	225,476	10,437,284.04	2.64
4	300017	网宿科技	193,973	10,398,892.53	2.63
5	300070	碧水源	586,350	10,272,852.00	2.59
6	300024	机器人	438,966	9,385,093.08	2.37
7	300124	汇川技术	399,251	8,116,772.83	2.05
8	300136	信维通信	271,297	7,731,964.50	1.95
9	300027	华谊兄弟	641,886	7,060,746.00	1.78
10	300408	三环集团	431,148	6,846,630.24	1.73

5.3.2 本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股票投资明细

金额单位:人民币元

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	300458	全志科技	9,900	905,157.00	0.23
2	300474	景嘉微	16,500	888,855.00	0.22
3	300185	通裕重工	286,600	885,594.00	0.22
4	300292	吴通控股	99,500	868,635.00	0.22
5	300377	赢时胜	23,221	866,839.93	0.22

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
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	1,054,996.59
2	应收证券清算款	2,088,604.54
3	应收股利	-
4	应收利息	13,885.84
5	应收申购款	1,677,661.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,835,147.97

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

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	300104	乐视网	11,781,851.60	2.98	重大事项

5.11.5.2 期末非指投资前五名股票中存在流通受限情况的说明
本基金本报告期末非指投资前五名股票不存在流通受限情况。
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

	天弘创业板A	天弘创业板C
报告期期初基金份额总额	266,714,535.05	179,953,787.74
报告期期间基金总申购份额	359,706,848.99	367,646,075.90
减:报告期期间基金总赎回份额	281,499,697.74	384,284,660.35
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	344,921,686.30	163,315,203.29

注:总申购份额含转换转入份额;总赎回份额含转换转出份额。

§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

	天弘创业板A	天弘创业板C
报告期期初管理人持有的本基金份额	5,000,000.00	5,000,000.00
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	5,000,000.00	5,000,000.00
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	0.98	0.98

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细
本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。
7.8 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	1.97%	10,000,000.00	1.97%	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	1.97%	10,000,000.00	1.97%	

§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创业板指数型发起式证券投资基金募集