天弘普惠养老保本混合型证券投资基金 2016年年度报告摘要

基金管理人:天弘基金管理有限公司
基金托管人:平安银行股份有限公司
送出日期:2017年03月30日

§1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年3月28日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本基金第一个保本周期到期日为2016年11月28日。本基金出现《基金合同》终止事由,因此本基金第一个保本周期到期,基金管理人依法对基金财产进行清算。

本报告期自2016年1月1日起至2016年12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	天弘普惠养老保本混合	
基金主代码	001292	
基金运作方式	契约型开放式,以定期开放的方式运作	
基金合同生效日	2015年05月27日	
基金管理人	天弘基金管理有限公司	
基金托管人	平安银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,041,159.25份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	天弘普惠养老保本混合A	天弘普惠养老保本混合B
下属分级基金的交易代码	001292	001293
报告期末下属分级基金的份额总额	-份	1,041,159.25份

2.2 基金产品说明

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,综合运用投资组合保险策略,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	本基金将采用恒定比例组合保本策略(CPPI, Constant Proportion Portfolio Insurance),对资产配置建立和运用数量化的分析模型,动态地监控和调整本基金在安全资产与风险资产上的投资比例,确保投资者的投资本金的安全性。同时,本基金通过影视板块的选择市场时机和精选个股进行投资,争取为基金资产获取更高的投资回报。具体而言,本基金的投资策略包括大类资产配置策略、安全资产投资策略和风险资产投资策略。
业绩比较基准	(一年期银行定期存款利率(税后)+0.50%)×2
风险收益特征	本基金为保本混合型基金,属于证券投资基金中的中低风险品种,其预期风险和预期收益低于股票型基金和非保本的混合型基金,高于货币市场基金和债券型基金。投资者投资于保本基金并不等于将资金作为存款放在银行或存款类金融机构,保本基金在极端情况下仍然存在本金损失的风险。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		天弘基金管理有限公司	平安银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	童建林	方琦
	联系电话	022-83310208	0755-22160168
	电子邮箱	service@thfundcom.cn	PANGO12754@pingan.com.cn
客户服务电话		4007109999	95511-3
传真		022-83895569	0755-82080387

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.thfundcom.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公地址

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	天弘普惠养老保本混合A	
	2016年	2015年06月27日-2015年12月31日
本期已实现收益	36,892,396.32	4,668,521.57
本期利润	26,135,674.83	15,425,063.90
加权平均基金份额本期利润	0.0660	0.0351
本期基金份额净值增长率	5.76%	3.51%
3.1.2 期末数据和指标	2016年末	2015年末
期末可供分配基金份额利润	-	0.0106
期末基金资产净值	-	454,494,893.43
期末基金份额净值	-	1.0351

3.1.4 期间数据和指标	天弘普惠养老保本混合B	
	2016年	2015年06月27日-2015年12月31日
本期已实现收益	544,052.08	62,131.96
本期利润	387,815.71	218,547.49
加权平均基金份额本期利润	0.0661	0.0342
本期基金份额净值增长率	5.61%	3.42%
3.1.5 期末数据和指标	2016年末	2015年末
期末可供分配基金份额利润	0.0912	0.0097
期末基金资产净值	1,136,183.39	6,607,847.91
期末基金份额净值	1.0913	1.0342

注:1、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。

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。

3、本基金《基金合同》2015年05月27日起生效。本基金第一个保本周期到期日为2016年11月28日,由于出现《基金合同》终止事由,因此第一个保本周期到期,基金管理人依法对基金财产进行清算。(下同)

4、净值增长率统计期间截止至2016年11月28日。

3.2 基金净值表现

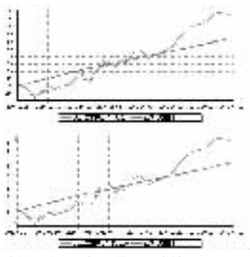
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段 (天弘普惠养老保本混合A)	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	0.22%	0.07%	0.62%	0.02%	-0.40%	0.05%
过去六个月	3.72%	0.07%	1.60%	0.01%	2.12%	0.06%
过去一年	5.76%	0.11%	3.60%	0.01%	2.16%	0.10%
自基金合同生效日起至基金最后运作日(2015年05月27日-2016年11月28日)	9.47%	0.13%	6.51%	0.01%	2.96%	0.12%

阶段 (天弘普惠养老保本混合B)	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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	0.19%	0.07%	0.62%	0.02%	-0.43%	0.05%
过去六个月	3.66%	0.07%	1.60%	0.01%	2.06%	0.06%
过去一年	5.61%	0.11%	3.60%	0.01%	2.01%	0.10%
自基金合同生效日起至基金最后运作日(2015年05月27日-2016年11月28日)	9.22%	0.13%	6.51%	0.01%	2.71%	0.12%

注:天弘普惠养老保本混合基金业绩比较基准:(一年期银行定期存款利率(税后)+0.50%)×2。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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《基金合同》于2015年05月27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。

3、本表统计期间为2015年05月27日至2016年11月28日。(下同)

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

注:本基金合同于2015年5月27日生效。基金合同生效当年2015年的净值增长率按照基金合同生效后当年的实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金于2015年5月27日成立。本基金自基金合同生效以来无利润分配情况,符合相关法规及基金合同的规定。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

天弘基金管理有限公司(以下简称"公司"或"本基金管理人")经中国证监会证监基金字[2004]164号文批准,于2004年11月8日正式成立。注册资本金为5.143亿元人民币,总部设在天津,在北京、上海、广州、天津设有分公司。公司股权结构为:

股东名称	股权比例
浙江蚂蚁小微金融服务集团股份有限公司	51%
天津信托有限责任公司	16.8%
内蒙古君正能源化工集团股份有限公司	15.6%
芜湖高新投资有限公司	5.6%
新疆天瑞博丰股权投资合伙企业(有限合伙)	3.5%
新疆天惠新盟股权投资合伙企业(有限合伙)	2%
新疆天阜恒基股权投资合伙企业(有限合伙)	2%
新疆天聚诚兴股权投资合伙企业(有限合伙)	3.5%
合计	100%

截至2016年12月31日,本基金管理人共管理53只基金:天弘精选混合型证券投资基金、天弘永利债券型证券投资基金、天弘永定价值成长混合型证券投资基金、天弘周期策略混合型证券投资基金、天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金、天弘添利债券型证券投资基金(LOF)、天弘丰利债券型证券投资基金(LOF)、天弘现金管家货币市场基金、天弘债券型发起式证券投资基金、天弘安康养老混合型证券投资基金、天弘余额宝货币市场基金、天弘稳利定期开放债券型证券投资基金、天弘弘利债券型证券投资基金、天弘通利混合型证券投资基金、天弘同利债券型证券投资基金(LOF)、天弘瑞利分级债券型证券投资基金、天弘沪深300指数型发起式证券投资基金、天弘中证500指数型发起式证券投资基金、天弘增益宝货币市场基金、天弘云端生活优选灵活配置混合型证券投资基金、天弘新活力灵活配置混合型发起式证券投资基金、天弘普惠养老保本混合型证券投资基金、天弘互联网灵活配置混合型证券投资基金、天弘惠利灵活配置混合型证券投资基金、天弘新价值灵活配置混合型证券投资基金、天弘云商宝货币市场基金、天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金、天弘中证医药100指数型发起式证券投资基金、天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金、天弘中证全指运输指数型发起式证券投资基金、天弘中证移动互联网指数型发起式证券投资基金、天弘中证证券保险指数型发起式证券投资基金、天弘中证银行指数型发起式证券投资基金、天弘创业板指数型发起式证券投资基金、天弘中证高端装备制造指数型发起式证券投资基金、天弘上证50指数型发起式证券投资基金、天弘中证100指数型发起式证券投资基金、天弘中证800指数型发起式证券投资基金、天弘中证环保产业指数型发起式证券投资基金、天弘中证电子指数型发起式证券投资基金、天弘中证休闲娱乐指数型发起式证券投资基金、天弘中证计算机指数型发起式证券投资基金、天弘中证食品饮料指数型发起式证券投资基金、天弘弘运宝货币市场基金、天弘鑫安宝保本混合型证券投资基金、天弘裕利灵活配置混合型证券投资基金、天弘乐享保本混合型证券投资基金、天弘价值精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、天弘安盈灵活配置混合型证券投资基金、天弘喜利灵活配置混合型证券投资基金、天弘信利债券型证券投资基金、天弘聚利灵活配置混合型证券投资基金、天弘金利灵活配置混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理(或基金经理小组)及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理(助理)期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
陈钢	本基金基金经理;本公司副总经理、固定收益总监兼固定收益部总经理。	2015年05月	-	14年	男,工商管理硕士。历任华龙证券公司固定收益部高级经理;北京辰星投资管理公司投资经理;兴业证券公司债券总部研究部经理;银华基金管理有限公司机构理财部高级经理;中国人寿资产管理有限公司固定收益部高级投资经理等。2011年7月加盟本公司。
钱文成	本基金基金经理。	2015年06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。

本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其配套规则和其他相关法律法规、基金合同的有关规定,勤勉尽责地管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。

本报告期内,本基金运作合法合规,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

基金管理人一直坚持公平对待旗下所有基金的原则,严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度,在研究分析、投资决策和交易执行等各个环节落实公平交易原则。公平交易范围包括各类投资组合、所有投资交易品种、以及一级市场申购、二级市场交易等所有投资交易管理活动及授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

针对公司旗下所有投资组合的交易所公开竞价交易,通过交易系统中的公平交易程序,对于不同投资组合同日同向买卖同一证券的指令自动进行比例分配。针对场外网下交易业务,依照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部场外、网下交易业务的相关规定,确保各投资组合享有公平的交易执行机会。对于以公司名义进行的交易严格按照发行分配的原则或价格优先、比例分配的原则在各投资组合间进行分配。

4.3.2 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。

4.3.3 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016年,经济基本面呈现企稳改善态势,前期货币宽松累积效应显现,名义GDP增速触底回升,通缩改善带动企业收入及利润改善,下游地产汽车也成为需求亮点。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。政策面方面,货币政策真正转向稳健中性。全年央行仅于2月末降准一次,主要通过OMO和MLF相结合的方式来提供基础货币。资金面方面,前三季度资金中枢在波动中维持稳定,但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,前三季度整体震荡中上涨,市场在乐观心态中消灭各种利差,进入四季度,多种因素之下,市场出现快速巨幅调整。

本基金在报告期内,前半段为应对产品第一个运作周期到期,逐步降低仓位,增强组合流动性,此后由于产品决定终止,按照要求进行产品清盘操作。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2016年11月28日,普惠养老保本混合A基金份额净值为1.0947元,普惠养老保本混合B基金份额净值为1.0922元。报告期内份额净值增长率普惠养老保本混合A为5.76%,普惠养老保本混合B为5.61%,同期业绩比较基准增长率为3.60%。

4.5 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,基本面大概率呈现前高后低,我们认为未来经济仍然面临下行压力,一方面前期货币宽松效应趋于消散,货币政策边际趋于紧缩将导致未来经济面临下行压力,另一方面,下游需求地产和汽车都面临需求透支的问题,形成对经济周期的下拉压力,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,整体走势可能是前高后低。

投资策略上,由于产品合同终止,因此未来将持续配合产品终止工作。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构,负责制定公司所管理基金的基本估值政策,对公司旗下基金已采用的估值政策、方法、流程的执行情况进行审核监督,对因经营环境或市场变化等导致需调整已实施的估值政策、方法和流程的,负责审查批准基金估值政策、方法和流程的变更和执行。确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定,确保基金资产估值的公平、合理,有效维护投资人的利益。估值委员会由公司分管固定收益投资的高级管理人员、督察长、分管估值业务的IT运维总监、投资研究部负责人组成。

公司基金估值委员会下设基金估值工作小组,由具备丰富专业知识、两年以上基金行业相关领域工作经历、熟悉基金投资品种定价及基金估值法律法规、具备较强专业胜任能力的基金经理、基金会计、风险管理人员及监察稽核人员组成。

基金经理作为估值工作小组的成员之一,在基金估值定价过程中,充分表达对相关问题及定价方案的意见或建议,参与估值方案提议的制定。但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。

参与估值流程的各方还包括本基金托管银行和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

报告期内,本基金管理人未与任何第三方签定与估值相关的定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配,符合相关法规及基金合同的规定。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内本基金管理人无应说明预警信息。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,平安银行股份有限公司(以下称"本托管人")在天弘普惠养老保本混合型证券投资基金(以下称"本基金")的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的有关规定,不存在损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内,本托管人根据《证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对本基金的投资运作进行了必要的监督,对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核,未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本报告期内,由天弘基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2016)第1909号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	天弘基金管理有限公司
引言段	我们审计了后附的天弘普惠养老保本混合型证券投资基金(以下简称"天弘普惠养老保本混合基金")的财务报表,包括2016年11月28日(基金最后运作日)的资产负债表,2016年1月1日至2016年11月28日(基金最后运作日)止期间的利润表、所有者权益(基金净值)变动表和财务报表附注(以下简称"财务报表")。
管理层对财务报表的责任段	贵公司管理层负责编制财务报表,并负责设计、执行和维护必要的内部控制,以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	我们的责任是在实施审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则,计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序,以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断,包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时,注册会计师考虑与财务报表编制相关的内部控制,以设计恰当的审计程序,但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性,以及评价财务报表的总体列报。 我们相信,我们获取的审计证据是充分、适当的,为发表审计意见提供了基础。
审计意见段	我们认为,上述天弘普惠养老保本混合基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制,公允反映了天弘普惠养老保本混合基金2016年11月28日(基金最后运作日)的财务状况以及2016年1月1日至2016年11月28日(基金最后运作日)止期间的经营成果和基金净值变动情况。
注册会计师的姓名	薛竞 周祎
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)
会计师事务所的地址	中国上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
审计报告日期	2016-12-23

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:天弘普惠养老保本混合型证券投资基金

报告截止日:2016年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
资 产:			
银行存款	7.4.7.1	1,441,517.62	991,404.47
结算备付金		38,640.19	6,058,191.73
存出保证金		-	76,732.01
交易性金融资产	7.4.7.2	-	668,777,471.96
其中:股票投资		-	31,637,541.76
基金投资		-	-
债券投资		-	637,139,930.20
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	336.27	12,093,289.07
应收股利		-	-
应收申购款		-	-
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		1,480,494.08	687,997,089.24
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	225,599,357.00
应付证券清算款		-	611,961.56
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		-	270,954.51
应付托管费		-	38,707.78
应付销售服务费		-	39,539.90
应付交易费用	7.4.7.7	1,425.00	94,386.83
应交税费		-	-
应付利息		-	30,440.32
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	342,885.69	219,000.00
负债合计		344,310.69	226,904,347.90
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	1,041,159.25	445,449,129.95
未分配利润	7.4.7.10	95,024.14	15,643,611.39
所有者权益合计		1,136,183.39	461,092,741.34
负债和所有者权益总计		1,480,494.08	687,997,089.24

注:1.报告截止日2016年12月31日,本基金A类无份额余额,本基金B类基金份额净值1.0913元,B类基金份额1,041,159.25份。

2.本财务报表的比较期间为2015年5月27日(基金合同生效日)至2015年12月31日。

7.2 利润表

会计主体:天弘普惠养老保本混合型证券投资基金

本报告期:2016年01月01日至2016年12月31日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2016年01月01日至2016年12月31日	上年度可比期间2015年05月27日至2015年12月31日
一、收入		32,483,671.56	19,615,499.43
1.利息收入		25,289,301.11	13,546,278.92
其中:存款利息收入	7.4.7.11	126,791.79	1,070,899.05
债券利息收入		25,159,946.89	12,457,796.26
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		2,562.43	17,583.61
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		18,107,328.31	-4,843,737.25
其中:股票投资收益	7.4.7.12	6,550,320.72	-6,928,232.58
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	10,947,825.71	2,081,134.18
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.14	-	-
衍生工具收益	7.4.7.15	-	-
股利收益	7.4.7.16	609,181.88	3,361.05
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	7.4.7.17	-10,912,957.86	10,912,957.86
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	7.4.7.18	-	-
减:二、费用		5,960,181.02	3,971,888.04
1. 管理人报酬		3,008,400.69	1,868,545.40
2. 托管费		429,771.52	266,935.09
3. 销售服务费		439,003.76	272,675.68
4. 交易费用	7.4.7.19	155,761.65	149,701.16
5. 利息支出		1,553,157.71	1,183,930.71
其中:卖出回购金融资产支出		1,553,157.71	1,183,930.71
6. 其他费用	7.4.7.20	374,085.69	230,100.00
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		26,523,490.54	15,643,611.39
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		26,523,490.54	15,643,611.39

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:天弘普惠养老保本混合型证券投资基金

本报告期:2016年01月01日至2016年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2016年01月01日至2016年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	445,449,129.95	15,643,611.39	461,092,741.34
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	26,523,490.54	26,523,490.54
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-444,407,970.70	-42,072,077.79	-486,480,048.49
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-444,407,970.70	-42,072,077.79	-486,480,048.49
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	1,041,159.25	95,024.14	1,136,183.39
项 目	上年度可比期间2015年05月27日至2015年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	445,449,129.95	-	445,449,129.95
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	15,643,611.39	15,643,611.39
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
其中:1.基金申购款	-	-	-
2.基金赎回款	-	-	-
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	-	-	-
五、期末所有者权益(基金净值)	445,449,129.95	15,643,611.39	461,092,741.34

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

郭树强	韩海潮	薄贺龙
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

天弘普惠养老保本混合型证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2015]729号《关于准予天弘普惠养老保本混合型证券投资基金注册的批复》准予注册,由天弘基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘普惠养老保本混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限为不定期,首次募集期间为2015年5月19日至2015年5月25日,首次设立募集不包括认购资金利息共募集445,434,592.00元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第570号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《天弘普惠养老保本混合型证券投资基金基金合同》于2015年5月27日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为445,449,129.95份基金份额,其中认购资金利息折合14,537.95份基金份额。本基金的基金管理人为天弘基金管理有限公司,基金托管人为平安银行股份有限公司。

根据《天弘普惠养老保本混合型证券投资基金招募说明书》的规定,本基金根据销售方式及销售服务费率的不同,将基金份额分为A 类基金份额和 B 类基金份额,其中,A 类基金份额销售服务费年费率为0.10%,B 类基金份额销售服务费年费率为 0.25%。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘普惠养老保本混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的债券、股票(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、货币市场工具、权证以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具,但需符合中国证监会的相关规定。本基金股票、权证等风险资产占基金资产的比例不高于 30%,其中投资于权证的比例不超过基金资产的 3%;债券、货币市场工具等安全资产占基金资产的比例不低于 70%。在开放期,本基金持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的 5%,在保本周期内(保本周期到期日除外),本基金不受该比例的限制。本基金的业绩比较基准:(一年期银行定期存款利率(税后)+0.50%)×2。根据《天弘普惠养老保本混合型证券投资基金基金合同》以及天弘基金管理有限公司于2016年11月24日发布的《天弘基金管理有限公司关于天弘普惠养老保本混合型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》,本基金第一个保本周期期满后,不再进行第二个保本周期的合作事宜,基金管理人也未能找到其他适合的担保机构,故本基金因未能符合保本基金存续条件,出现基金合同终止事由。本基金第一个保本周期的到期日(即最后开放日)为2016年11月28日且已触发基金合同终止事由,基金管理人已依据相关法律法规和本基金基金合同的规定,组织成立基金财产清算小组履行基金财产清算程序。

本财务报表由本基金的基金管理人天弘基金管理有限公司于2017年3月30日批准报出。

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日及以后期间颁布的《企业会计准则-基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会(以下简称"中国基金业协会")颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《天弘普惠养老保本混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2016年度财务报表符合企业会计准则的要求,真实、完整地反映了本基金2016年12月31日的财务状况以及2016年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表相一致。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》、财税[2012]85号《关于实施上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2015]101号《关于上市公司股息红利差别化个人所得税政策有关问题的通知》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的补充通知》、及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)于2016年5月1日前,以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围,不征收营业税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起,金