天弘永定价值成长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:兴业银行股份有限公司
送出日期:2017年3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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017年3月29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	天弘永定价值成长混合
基金主代码	420003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年12月2日
基金管理人	天弘基金管理有限公司
基金托管人	兴业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	473,526,045.44
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在合理控制风险的基础上,追求基金资产的长期稳健增值,为投资人创造超额收益。
投资策略	本基金为主动管理的混合型基金,主要投资于国内A股市场上成长性较好、估值水平具有比较优势的上市公司,以及国内债券市场上的国债、金融债、企业债、可转换债券以及权证、货币市场工具等投资品种。本基金投资坚持"股票为主、精选个股"的投资策略,同时适当运用股票、债券等资产灵活配置的投资策略,以优化基金净值的波动。
业绩比较基准	β*沪深300指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%。
风险收益特征	本基金为主动投资的混合型基金,属于风险较高、收益较高的证券投资基金产品。本基金的风险与预期收益高于债券型基金和货币市场基金,低于股票型基金。

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	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	童建林	张志永
	联系电话	022-83310208	021-62677777*212004
	电子邮箱	service@thfund.com.cn	zhangzhy@cib.com.cn
客户服务电话		4007100999	95561
传真		022-83895689	021-62159217

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.thfund.com.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	2016年	2015年	2014年
本期已实现收益	25,242,482.91	70,584,278.04	36,269,903.51
本期利润	30,809,927.20	70,679,573.74	33,914,644.74
加权平均基金份额本期利润	0.1496	0.4258	0.3109
本期基金份额净值增长率	17.45%	31.43%	41.80%
3.1.2 期末数据和指标	2016年末	2015年末	2014年末
期末可供分配基金份额利润	0.7388	0.5244	0.1904
期末基金资产净值	870,096,066.07	180,852,050.23	143,392,456.06
期末基金份额净值	1.8375	1.5645	1.1904

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。

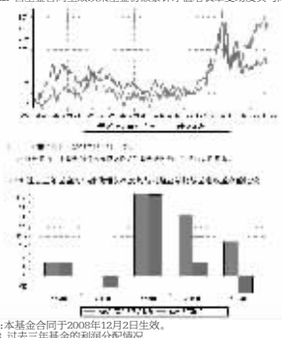
3.2 基金净值表现

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	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	1.28%	0.76%	1.43%	0.57%	-0.15%	0.19%
过去六个月	12.08%	0.83%	4.28%	0.61%	7.80%	0.22%
过去一年	17.45%	1.51%	-8.16%	1.12%	25.61%	0.39%
过去三年	118.88%	1.73%	38.69%	1.43%	80.19%	0.30%
过去五年	135.43%	1.65%	40.58%	1.30%	94.85%	0.35%
自基金合同生效日起至今(2008年12月02日-2016年12月31日)	145.05%	1.61%	75.33%	1.32%	69.72%	0.29%

注:天弘永定价值成长股票基金业绩比较基准:沪深300指数收益率*80%+上证国债指数收益率*20%。沪深300指数和上证国债指数分别由中证指数有限公司和上海证券交易所编制发布,分别反映了中国证券市场和债券市场的整体运行状况,具有可操作性和投资性。本基金股票投资比例范围是60%-95%,债券和短期金融工具的投资比例范围是5%-40%,分别参考上述投资比例范围的中值,确定本基金业绩比较基准中沪深指数占80%,上证国债指数占20%,并且比较基准每日按照80%和20%对沪深300指数和上证国债指数进行再平衡,再用连锁计算的方式得到基准指数的时间序列。

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:本基金合同于2008年12月2日生效。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金过去三年未进行利润分配,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%
新疆天聚宸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、天弘商宝货币市场基金、天弘中证太京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、天弘中证全指证券公司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、天弘沪深300指数型证券投资基金、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)及基金经理的相关信息

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		
肖志刚	本基金基金经理;本公司投资研究部总经理。	2014年1月	-	8年	男,经济学硕士。历任国联基金管理有限公司行业研究员。2013年8月加盟本公司,历任股票研究部总经理、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。

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 公平交易制度和执行情况

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日内进行比例分配。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方的原则或价格优先、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权对独立性的同时,严格执行投资程序,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门检验,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、分析和预警的控措施。

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的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016年A股整体走势以震荡为主,市场机会方面,呈现结构性牛市与结构性熊市并存,上涨的股票集中在生活资料领域,以衣食住行为主线,而下跌的股票集中在传媒、计算机、通信等行业。

本基金在年初重仓配置了券商、白酒两个行业,持仓特点是行业集中,个股分散,顺应市场风格的配置使得上半年实现了较好的收益,将年初受累于券商所的亏损基本弥补回来了。

在上市公司年报、一季报陆续披露后,经济开始启动新一轮上升周期的信号逐渐清晰,因此年中继续加大了生活资料的配置比例,尤其是景气度显著上升的两种车行业,以及地产,都获得了较好的收益。

进入三季度,进一步确认经济上升趋势后,逐步增加了生产资料的配置比例,降低了生活资料的仓位,实现了净值的平稳,回撤幅度可控。

回顾全年的运作,超额收益的实现,除了配置方向的正确以外,更为重要的是规避了市场主要的下跌板块及个股,最后,我们有所为有所不为的策略,重点回避了高估值的TMT股票。

4.4.2 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1.8375元。本报告期本基金份额净值增长率17.45%,同期业绩比较基准增长率-8.16%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对于参与股市的投资者,无论是投资股票还是基金,都需要有一套完整的投资体系,如果再往下细拆,可分为三套有机的子系统,分别是解释系统、应对系统、预测系统,各自对应的任务是解释过去、应对当下、预测未来。

这三套子系统的关系是相辅相成的有机一体,首先要面向未来的一个投资决策时,需要对未来进行各种预测,那我们当然首先需要的就是预测系统,以进行科学、合理的预测。要想预测未来,就要掌握一定的规律,包括经济规律、金融规律、社会规律等,而这些规律一定是在过去某些时候显过灵,否则就不称为规律了。所以我们就得从已经过去的历史中总结规律,要善于从历史中窥察,这就需要我们有一套解释系统,用来科学、合理地解释过去发生的历史。正所谓,我们如何预测这个世界,取决于我们如何看待这个世界。

有了解释系统与预测系统,我们就可以开始构建自己的投资组合了,看好什么就配什么。由于我们对世界的认知是不完备的,随着时间的推移,有些我们以为的规律其实并不准确,有更正确的规律在发生作用,投资的走势往往并不如我们预期的那样,甚至相反,这个时候,我们就要调整组合了,这就需要一套应对系统了。

美国前国防部长拉姆斯菲尔德的传说名为《已知与未知》,正是基于他的一段名言"那我们所知,有'已知的已知',有些事,我们知道。我们也知道,我们知道,有'已知的未知'。也就是说,有些事,我们现在知道我们不知道。但是,同样存在'未知的未知'——有些事,我们不知道我们不知道"。

在股市中每天要接收和处理海量信息,这些信息中,有些是已知的已知,比如保险举牌监管收紧、相关股票也跌了。有些是已知的未知,我们都知特别昔早晚会有针对中国的贸易政策出台,政策是否友好,这就是未知的了。还有一些是未知的未知,比如朝鲜的大型分动同,对于A股投资者都属于此类。事实上,影响A股走向的,是未知的未知,而不是已知的未知,更不是已知的已知。

面对着无法预测的未知的未知,正确的选择是放弃去预测,转而去寻找A股本身运行机理中有机可循的规律,从而提高预测的准确度。

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,对因经济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人和会计师事务所。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

报告期内,本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,诚信、尽责地履行了基金托管人义务,不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内,本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定,对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查,未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为;基金管理人在报告期内,严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认真复核了本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容,认为其真实、准确和完整,不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§6 审计报告

本报告期本基金财务会计报告经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计,该所出具了"无保留意见的审计报告",且在审计报告中无强调事项。投资者可通过年度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:天弘永定价值成长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	106,069,732.71	34,639,698.77
结算备付金		10,257,750.70	2,261,580.63
存出保证金		1,029,334.80	1,044,887.51
交易性金融资产	7.4.7.2	794,063,732.01	148,890,865.44
其中:股票投资		794,063,732.01	148,890,865.44
基金投资		-	-
债券投资		-	-
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		-	2,428,558.44
应收利息	7.4.7.5	62,997.63	24,623.02
应收股利		-	-
应收申购款		4,055,853.76	54,335.48
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		915,539,401.61	189,344,549.29
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		-	-
应付证券清算款		34,347,517.05	5,757,948.47
应付赎回款		4,639,084.61	890,322.97
应付管理人报酬		1,105,977.50	239,773.30
应付托管费		184,329.57	39,962.22
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	4,750,272.48	1,057,608.34
应交税费		39,378.70	39,378.70
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	376,775.63	467,505.06
负债合计		45,443,335.54	8,492,499.06
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	473,526,045.44	115,596,935.37
未分配利润	7.4.7.10	396,570,020.63	65,255,114.86
所有者权益合计		870,096,066.07	180,852,050.23
负债和所有者权益总计		915,539,401.61	189,344,549.29

注:报告截止日2016年12月31日,基金份额净值1.8375元,基金份额总额473,526,045.44份。

7.2 利润表

会计主体:天弘永定价值成长混合型证券投资基金

本报告期:2016年1月1日至2016年12月31日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
一.收入		50,539,921.29	87,438,954.67
1.利息收入		1,028,302.63	1,006,705.26
其中:存款利息收入	7.4.7.11	1,023,302.63	1,006,705.26
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		5,000.00	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		43,320,130.54	85,116,484.19
其中:股票投资收益	7.4.7.12	40,886,995.50	82,899,357.41
基金投资收益	7.4.7.13	-	-
债券投资收益	7.4.7.14	-	-
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-	-
股利收益	7.4.7.17	2,433,135.04	2,217,126.78
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	7.4.7.18	5,567,444.29	95,295.70
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	7.4.7.19	624,043.83	1,220,469.52
减:二.费用		19,729,994.09	16,759,380.93
1. 管理人报酬		5,297,663.44	3,808,389.79
2. 托管费		882,943.85	634,731.60
3. 销售服务费		-	-
4. 交易费用	7.4.7.20	13,184,600.31	11,930,377.15
5. 利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6. 其他费用	7.4.7.21	364,786.49	385,882.39
三.利润总额(亏损总额以"-"号填列)		30,809,927.20	70,679,573.74
减:所得税费用		-	-
四.净利润(净亏损以"-"号填列)		30,809,927.20	70,679,573.74

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:天弘永定价值成长混合型证券投资基金

本报告期:2016年1月1日至2016年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2016年1月1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)	115,596,935.37	65,255,114.86	180,852,050.23
二.本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	30,809,927.20	30,809,927.20
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)	357,929,110.07	300,504,978.57	658,434,088.64
其中:1.基金申购款	654,163,494.54	526,491,095.00	1,180,654,589.54
2.基金赎回款	-296,234,384.47	-225,986,116.43	-522,220,500.90
四.本期向基金分配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)	473,526,045.44	396,570,020.63	870,096,066.07

项 目	上年度可比期间 2015年1月1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)	120,456,640.43	22,935,815.63	143,392,456.06
二.本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	70,679,573.74	70,679,573.74
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)	-4,859,705.06	-28,360,274.51	-33,219,979.57
其中:1.基金申购款	618,293,227.46	344,198,494.52	962,491,721.98
2.基金赎回款	-623,152,932.52	-372,558,769.03	-995,711,701.55
四.本期向基金分配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)	115,596,935.37	65,255,114.86	180,852,050.23

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

天弘永定价值成长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证监许可[2008]755号《关于核准天弘永定价值成长股票型证券投资基金募集的批复》核准,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《天弘永定价值成长股票型证券投资基金募集申请报告书(基金合同)》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集291,076,882.00元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司验字(2008)第184号验资报告予以验证。经中国证监会备案,《天弘永定价值成长股票型证券投资基金基金合同》于2008年12月2日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为291,108,692.74份基金份额,其中认购资金利息折合31,810.74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,基金托管人为兴业银行股份有限公司。

根据2014年中国证监会令第104号《公开募集证券投资基金运作管理办法》,《天弘永定价值成长股票型证券投资基金于2015年08月08日公告启更名为天弘永定价值成长混合型证券投资基金。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《天弘永定价值成长混合型证券投资基金基金合同》和最新公告的《天弘永定价值成长混合型证券投资基金招募说明书(更新)》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券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。本基金股票投资比例范围是基金资产的60%-95%;现金、债券、权证及中国证监会允许基金投资的其他证券品种的投资比例范围是基金资产的5%-40%;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%。本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率X80%+上证国债指数收益率X20%。

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》、《天弘永定价值成长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 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,金融业纳税特定业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税,对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(2)对基金从证券市场中取得的收入,包括买卖股票、债券的差价收入、股票的股息、红利收入、债券的利息收入及其他收入,暂不征收企业所得税。

(3)对基金取得的企业债券利息收入,应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。对基金从上市公司取得的股息红利所得,持股期限在1个月以内(含1个月)的,其股息红利所得全额计入应纳税所得额;持股期限在1个月以上至1年(含1年)的,暂减按50%计入应纳税所得额;持股期限超过1年的,暂免征收个人所得税。对基金持有的上市公司限售股,解禁后取得的股息、红利收入,按照上述规定计算纳税,持股时间自解禁日起计算;解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4)基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税,买入股票不征收股票交易印花税。

7.4.7 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
天弘基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
兴业银行股份有限公司("兴业银行")	基金托管人、基金销售机构
浙江蚂蚁小微金融服务集团股份有限公司	基金管理人的股东
天津信托有限责任公司	基金管理人的股东
内蒙古君正能源化工集团股份有限公司	基金管理人的股东
芜湖高新投资有限公司	基金管理人的股东
新疆天瑞博丰股权投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
新疆天惠新盟股权投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
新疆天阜恒基股权投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
新疆天聚宸兴股权投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
天弘创新资产管理有限公司("天弘创新")	基金管理人的全资子公司

注:1.下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2.2016年度内,本基金管理人股东"浙江蚂蚁小微金融服务集团有限公司"的名称变更为"浙江蚂蚁小微金融服务集团股份有限公司"。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	5,297,663.44	3,808,389.79
其中:支付销售机构的客户维护费	996,221.46	400,627.09

注:1.支付基金管理人天弘基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日管理人报酬=前一日基金资产净值X1.50%/当年天数。

2.客户维护费是指基金管理人与基金销售机构在基金销售协议中约定的依据销售机构持有销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费,用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用,该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支,不属于从基金资产中列支的费用项目。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	882,943.85	634,731.60

注:支付基金托管人兴业银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日托管费=前一日基金资产净值X0.25%/当年天数。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期及上年度可比期间未与关联方进行过银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日
基金合同生效日(2008年12月2日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	6,353,124.04	6,353,124.04
期间申购/买入总份额	-	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	6,353,124.04	6,353,124.04
期末持有的基金份额占基金总份额比例	1.34%	5.50%

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本期末及上年度末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.8.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位:人民币元

关联方名称	本期 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
兴业银行活期存款	106,069,732.71	935,284.44	34,639,698.77	919,799.70

注:本基金的银行存款由基金托管人兴业银行保管,按银行间业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可