天弘余额宝货币市场基金 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:中信银行股份有限公司
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。
基金托管人中信银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2017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	天弘余额宝货币
基金主代码	000198
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年5月29日
基金管理人	天弘基金管理有限公司
基金托管人	中信银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	808,293,523,026.09份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在保持基金资产的低风险和高流动性的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金根据对短期利率变动的预期,采用投资组合平均剩余期限控制下的主动性投资策略,利用定性分析和定量分析方法,通过对短期金融工具的积极投资,在控制风险和保证流动性的基础上,力争获得稳定的当期收益。
业绩比较基准	同期七天通知存款利率(税后)
风险收益特征	本基金为货币市场基金,属于证券投资基金中的低风险品种,其预期收益和风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。

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	中信银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	童建林	方露
	联系电话	022-83310208	4006800000
	电子邮箱	service@thfund.com.cn	fangwei@citicbank.com
客户服务电话		4007109999	95558
传真		022-83895569	010-85230024

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	19,192,502,969.24	23,131,328,737.26	24,003,879,023.56
本期利润	19,192,502,969.24	23,131,328,737.26	24,003,879,023.56
本期净值收益率	2.5089%	3.6686%	4.8240%
3.1.2 期末数据和指标	2016年末	2015年末	2014年末
期末基金资产净值	808,293,523,026.09	620,690,491,640.68	578,935,761,389.81
期末基金份额净值	1.0000	1.0000	1.0000

注:1、本基金无持有人认购或交易基金的各项费用。
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。由于货币市场基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。
3、本基金的利润分配是按日结转份额。

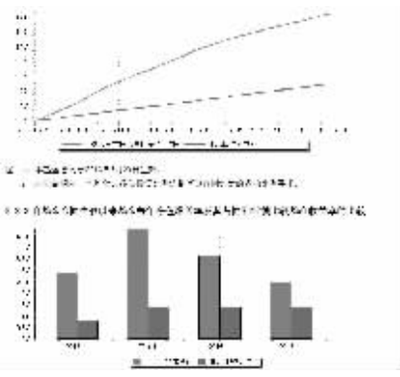
3.2 基金净值表现

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	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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	0.6403%	0.0007%	0.3456%	0.0000%	0.2947%	0.0007%
过去六个月	1.2367%	0.0006%	0.6924%	0.0000%	0.5443%	0.0006%
过去一年	2.5089%	0.0005%	1.3819%	0.0000%	1.1270%	0.0005%
过去三年	11.3960%	0.0030%	4.1955%	0.0000%	7.2005%	0.0030%
自基金合同生效日起至今(2013年5月29日-2016年12月31日)	14.5957%	0.0031%	5.0469%	0.0000%	9.5488%	0.0031%

注:天弘余额宝货币市场基金业绩比较基准:同期七天通知存款利率(税后)。通知存款是一种不约定存期,支取时需提前通知银行,约定支取日期和金额方能支取的存款,具有存期灵活、存取方便的特征,同时可获得高于活期存款利息的收益。本基金为货币市场基金,具有低风险、高流动性的特征。根据基金的投资标的、投资目标及流动性特征,本基金选取同期七天通知存款利率(税后)作为本基金的业绩比较基准。

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2013年5月29日生效。基金合同生效当年2013年的净值收益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

单位:人民币元

年度	已按再投资形式转实收基金	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	年度利润分配合计	备注
2016年	19,192,502,969.24	-	-	19,192,502,969.24	无
2015年	23,131,328,737.26	-	-	23,131,328,737.26	无
2014年	24,003,879,023.56	-	-	24,003,879,023.56	无
合计	66,327,710,730.06	-	-	66,327,710,730.06	无

§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%
新疆天聚辰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期限 任职日期	离任日期	证券从业年限	说明
王登峰	本基金基金经理。	2013年5月	-	7年	男,经济学硕士。历任中信建投证券股份有限公司固定收益部高级经理。2012年加盟本公司,历任固定收益研究员等。

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,始终把流动性风险管理放在第一位,同时严格控制组合的信用风险、价格风险和操作风险,确保了报告期内风险事件零发生。根据本基金持有人众多、人均持有量较小的特点,充分利用互联网金融大数据分析的优势,和投资研究有机结合起来,对组合的申购赎回情况,特别是双十一、春节等重大时点进行预测分析,通过资产品种的选择与久期匹配来保障组合的流动性,并且在资金紧张的时点积极布局以提高组合的收益,尤其在4季度末,拉长久期,积极配置,使组合明显提高,形成了收益和规模的良性互动。在整个报告期内,本组合为持有人提供了持续、稳健、合理的投资收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2016年12月31日,本基金份额净值收益率2.5089%,同期业绩比较基准收益率1.3819%。

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。
投资策略上,本基金将继续将风险控制放在组合管理的第一位,严格控制组合流动性风险,信用风险和价格风险,根据大数据分析的结果动态调整组合资产配置,上半年总体使组合久期保持在中性略低水平,下半年随着经济基本面下行,资金宽松空间打开,再拉长久期,积极配置,在风险可控的基础上,继续为持有人创造稳健的收益。

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估值业务的高级管理人员、督察长、投资总监、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

根据本基金合同及招募说明书(更新)等有关规定,本基金每日将基金净收益分配给基金份额持有人(该收益参与下一日的收益分配),并按自然日结转至基金份额持有人的基金账户。

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

作为本基金的托管人,中信银行严格遵守了《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,对天弘余额宝货币市场基金2016年度基金的投资运作,进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督,认真履行了托管人的义务,不存在任何损害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、净值计算等情况的说明

本托管人认为,天弘基金管理有限公司在天弘余额宝货币市场基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上,不存在损害基金份额持有人利益的行为;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

本托管人认为,天弘基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定,基金管理人所编制和披露的天弘余额宝货币市场基金2016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、投资组合报告等信息真实、准确、完整,未发现有损害基金持有人利益的行为。

§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:天弘余额宝货币市场基金
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	569,717,814,094.72	434,709,276,312.48
结算备付金		-	107,577.93
存出保证金		141,813.36	3,007.77
交易性金融资产	7.4.7.2	93,851,188,795.14	153,894,532,446.03
其中:股票投资		-	-
基金投资		-	-
债券投资		93,851,188,795.14	153,894,532,446.03
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	145,485,804,009.78	35,770,778,406.57
应收证券清算款		-	-
应收利息	7.4.7.5	1,659,181,909.99	1,145,964,289.53
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		810,714,130,622.99	625,520,661,960.31
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		1,996,797,760.00	4,500,000,000.00
应付证券清算款		-	888,296.74
应付赎回款		-	-
应付管理人报酬		200,631,998.42	156,270,438.11
应付托管费		53,501,866.26	41,672,116.82
应付销售服务费		167,193,332.03	130,225,365.09
应付交易费用	7.4.7.7	505,689.34	405,102.87
应交税费		-	-
应付利息		1,157,950.85	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	819,000.00	709,000.00
负债合计		2,420,607,596.90	4,830,170,319.63
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	808,293,523,026.09	620,690,491,640.68
未分配利润	7.4.7.10	-	-
所有者权益合计		808,293,523,026.09	620,690,491,640.68
负债和所有者权益总计		810,714,130,622.99	625,520,661,960.31

注:报告截止日2016年12月31日,基金份额净值1.0000元,基金份额总额808,293,523,026.09份。

7.2 利润表

会计主体:天弘余额宝货币市场基金
本报告期:2016年1月1日-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-2016年12月31日	上年度可比期间2015年1月1日-2015年12月31日
一、收入		24,199,437,998.37	27,232,038,796.76
1.利息收入		24,055,518,092.15	26,943,684,307.99
其中:存款利息收入	7.4.7.11	18,707,443,840.19	22,890,164,846.29
债券利息收入		4,688,855,137.58	2,535,913,288.77
资产支持证券利息收入		-	7,534,496.69
买入返售金融资产收入		659,219,114.38	1,510,071,676.24
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		143,919,485.91	288,354,443.36
其中:股票投资收益	7.4.7.12	-	-
基金投资收益		-	-
债券投资收益	7.4.7.13	143,919,485.91	284,759,215.79
资产支持证券投资收益	7.4.7.13.3	-	3,595,227.57
贵金属投资收益		-	-
衍生工具收益	7.4.7.14	-	-
股利收益	7.4.7.15	-	-
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	7.4.7.16	-	-
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	7.4.7.17	420.31	45.41
减:二、费用		5,006,935,029.13	4,100,710,059.50
1. 管理人报酬		2,327,229,605.68	1,911,521,131.57
2. 托管费		620,594,561.59	509,738,968.45
3. 销售服务费		1,939,358,004.77	1,592,934,276.37
4. 交易费用	7.4.7.18	-	-
5. 利息支出		118,345,227.49	85,363,816.12
其中:卖出回购金融资产支出		118,345,227.49	85,363,816.12
6. 其他费用	7.4.7.19	1,407,629.60	1,151,866.99
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		19,192,502,969.24	23,131,328,737.26
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		19,192,502,969.24	23,131,328,737.26

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:天弘余额宝货币市场基金
本报告期:2016年1月1日-2016年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2016年1月1日-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)	620,690,491,640.68	-	620,690,491,640.68
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	19,192,502,969.24	19,192,502,969.24
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)	187,603,031,385.41	-	187,603,031,385.41
其中:1.基金申购款	8,128,132,124,547.03	-	8,128,132,124,547.03
2.基金赎回款	-7,940,529,093,161.62	-	-7,940,529,093,161.62
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)	-	-19,192,502,969.24	-19,192,502,969.24
五、期末所有者权益(基金净值)	808,293,523,026.09	-	808,293,523,026.09
项 目	上年度可比期间2015年1月1日-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)	578,935,761,389.81	-	578,935,761,389.81
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	23,131,328,737.26	23,131,328,737.26
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)	41,754,730,250.87	-	41,754,730,250.87
其中:1.基金申购款	5,502,933,033,812.12	-	5,502,933,033,812.12
2.基金赎回款	-5,461,178,303,561.25	-	-5,461,178,303,561.25
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)	-	-23,131,328,737.26	-23,131,328,737.26
五、期末所有者权益(基金净值)	620,690,491,640.68	-	620,690,491,640.68

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:

郭柯强	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

天弘余额宝货币市场基金(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[2013]692号《关于核准天弘增利宝货币市场基金募集的批复》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《天弘增利宝货币市场基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集200,628,721.85元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2013)第306号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《天弘增利宝货币市场基金基金合同》于2013年5月29日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为200,628,721.85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,基金托管人为中信银行股份有限公司。
根据相关法律法规、《天弘增利宝货币市场基金基金合同》的相关规定和《天弘基金管理有限公司关于变更天弘增利宝货币市场基金名称并修改基金合同相应条款的公告》,"天弘增利宝货币市场基金"于2015年5月15日公告后更名为"天弘余额宝货币市场基金"。
根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘增利宝货币市场基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为现金;通知存款;短期融资券;1年以内(含1年)的银行定期存款、大额存单;期限在1年以内(含1年)的债券回购;期限在1年以内(含1年)的中央银行票据;剩余期限在397天以内(含397天)的债券;剩余期限在397天以内(含397天)的资产支持证券;剩余期限在397天以内(含397天)的中期票据以及中国证监会认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。本基金的业绩比较基准为:同期七天通知存款利率(税后)。根据《天弘余额宝货币市场基金基金合同》的有关规定,本基金的投资目标、投资策略、投资理念、投资范围、投资限制、投资管理程序等与原天弘增利宝货币市场基金保持不变。
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》、《天弘余额宝货币市场基金基金合同》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所采用的会计政策、会计估计一致。

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[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债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起,金融业由缴纳营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,包括买卖债券的差价收入,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。

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、基金注册登记机构
中信银行股份有限公司("中信银行")	基金托管人
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
新疆天聚辰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

本基金本报告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-2016年12月31日	上年度可比期间2015年1月1日-2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,327,229,605.68	1,911,521,131.57
其中:支付销售机构的客户维护费	377,869.61	11,498.39

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0.30%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 X 0.30% / 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-2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日-2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	620,594,561.59	509,738,968.45

注:支付基金托管人中信银行的托管费按前一日基金资产净值0.08%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 X 0.08% / 当年天数。

7.4.8.2.3 销售服务费

单位:人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2016年1月1日-2016年12月31日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
天弘基金管理有限公司	1,929,911,267.17
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间2015年1月1日-2015年12月31日
	当期发生的基金应支付的销售服务费
天弘基金管理有限公司	1,592,646,818.20

注:支付基金管理人天弘基金管理有限公司销售服务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:日销售服务费=前一日基金资产净值 X 0.25% / 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

单位:人民币元

本期 2016年1月1日-2016年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中信银行	2,077,873,047.38	-	2,200,000,000.00	119,207.94	17,974,000,000.00	1,270,256.03
上年度可比期间 2015年1月1日-2015年12月31日						
银行间市场交易的各关联方名称	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中信银行	30,574,445.34	-	-	-	-	-

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

本报告期及上年度可比期间无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

7.4.