

天弘债券型发起式证券投资基金

[2017] 第一季度报告

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4月22日

§ 1 重要提示

基金管理人的董事局及董事声明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,于2017年4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,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。

本报告财务数据未经审计。

本基金报告期自2017年1月1日起至2017年3月31日止。

§ 2 基金产品概况

基金简称 天弘债券发起式

基金主代码 420000

基金运作方式 契约型开放式,发起式

基金合同生效日 2012年9月10日

报告期末基金资产总额 409,439,297,070份

投资目标 本基金通过宏观经济、利率走势、资金供求、信用评级状况、证券市场走势等多方面的判断,对宏观经济进行动态调整,力求实现基金资产的长期稳健增值。

投资策略 本基金通过对宏观经济、利率走势、资金供求、信用评级状况、证券市场走势等多方面的判断,对宏观经济进行动态调整,力求实现基金资产的长期稳健增值。

业绩比较基准 中国国债指数

风险收益特征 本基金为债券型基金,属于证券投资基金中较低风险的基金品种,其风险收益特征类似于货币市场基金。

基金管理人 天弘基金管理有限公司

基金托管人 中国工商银行股份有限公司

下属分级基金的基金简称 天弘债券发起式A

基金主代码 420000

下属分级基金的交易代码 420100

报告期末下属分级基金的份额总额 16,700,000份

金额单位:人民币元

§ 3 主要财务指标和净值表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2017年1月1日-2017年3月31日)

天弘债券发起式A

天弘债券型发起式

本期末基金资产总额 1,800,000 3,987,200,000 300

本期末基金份额总额 349,000 6,004,224,000 1.46

本期末基金资产净值 1,000 1,000,000 0.26

本期末基金份额净值 1.126 1.104

报告期末下属分级基金的份额总额 344,000,000份

金额单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2017年1月1日-2017年3月31日)

天弘债券发起式A

天弘债券型发起式

本期末基金资产总额 72,773,699,000 380,880,192,500

本期末基金份额总额 1,126 1.104

本期末基金资产净值 16,700,000份

金额单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2017年1月1日-2017年3月31日)

天弘债券发起式A

天弘债券型发起式

本期末基金资产总额 409,439,297,070份

本期末基金份额总额 21,637,679,000 4.77

本期末基金资产净值 1,000 1,000,000 0.46

本期末基金份额净值 1.126 1.073

报告期末下属分级基金的份额总额 344,000,000份

金额单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2017年1月1日-2017年3月31日)

天弘债券发起式A

天弘债券型发起式

本期末基金资产总额 1,800,000 3,987,200,000 300

本期末基金份额总额 349,000 6,004,224,000 1.46

本期末基金资产净值 1,000 1,000,000 0.26

本期末基金份额净值 1.126 1.104

报告期末下属分级基金的份额总额 344,000,000份

金额单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2017年1月1日-2017年3月31日)

天弘债券发起式A

天弘债券型发起式

本期末基金资产总额 409,439,297,070份

本期末基金份额总额 21,637,679,000 4.77

本期末基金资产净值 1,000 1,000,000 0.46

本期末基金份额净值 1.126 1.073

报告期末下属分级基金的份额总额 344,000,000份

金额单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2017年1月1日-2017年3月31日)

天弘债券发起式A

天弘债券型发起式

本期末基金资产总额 409,439,297,070份

本期末基金份额总额 21,637,679,000 4.77

本期末基金资产净值 1,000 1,000,000 0.46

本期末基金份额净值 1.126 1.073

报告期末下属分级基金的份额总额 344,000,000份

金额单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2017年1月1日-2017年3月31日)

天弘债券发起式A

天弘债券型发起式

本期末基金资产总额 409,439,297,070份

本期末基金份额总额 21,637,679,000 4.77

本期末基金资产净值 1,000 1,000,000 0.46

本期末基金份额净值 1.126 1.073

报告期末下属分级基金的份额总额 344,000,000份

金额单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2017年1月1日-2017年3月31日)

天弘债券发起式A

天弘债券型发起式

本期末基金资产总额 409,439,297,070份

本期末基金份额总额 21,637,679,000 4.77

本期末基金资产净值 1,000 1,000,000 0.46

本期末基金份额净值 1.126 1.073

报告期末下属分级基金的份额总额 344,000,000份

金额单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2017年1月1日-2017年3月31日)

天弘债券发起式A

天弘债券型发起式

本期末基金资产总额 409,439,297,070份

本期末基金份额总额 21,637,679,000 4.77

本期末基金资产净值 1,000 1,000,000 0.46

本期末基金份额净值 1.126 1.073

报告期末下属分级基金的份额总额 344,000,000份

金额单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2017年1月1日-2017年3月31日)

天弘债券发起式A

天弘债券型发起式

本期末基金资产总额 409,439,297,070份

本期末基金份额总额 21,637,679,000 4.77

本期末基金资产净值 1,000 1,000,000 0.46

本期末基金份额净值 1.126 1.073

报告期末下属分级基金的份额总额 344,000,000份

金额单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2017年1月1日-2017年3月31日)

天弘债券发起式A

天弘债券型发起式

本期末基金资产总额 409,439,297,070份

本期末基金份额总额 21,637,679,000 4.77

本期末基金资产净值 1,000 1,000,000 0.46

本期末基金份额净值 1.126 1.073

报告期末下属分级基金的份额总额 344,000,000份

金额单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2017年1月1日-2017年3月31日)

天弘债券发起式A

天弘债券型发起式

本期末基金资产总额 409,439,297,070份

本期末基金份额总额 21,637,679,000 4.77

本期末基金资产净值 1,000 1,000,000 0.46

本期末基金份额净值 1.126 1.073

报告期末下属分级基金的份额总额 344,000,000份

金额单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2017年1月1日-2017年3月31日)

天弘债券发起式A

天弘债券型发起式

本期末基金资产总额 409,439,297,070份

本期末基金份额总额 21,637,679,000 4.77

本期末基金资产净值 1,000 1,000,000 0.46

本期末基金份额净值 1.126 1.073

报告期末下属分级基金的份额总额 344,000,000份

金额单位:人民币元

主要财务指标 报告期(2017年1月1日-2017年3月31日)

天弘债券发起式A

天弘债券型发起式

本期末基金资产总额 409,439,297,070份

本期末基金份额总额 21,637,679,000 4.77

本期末基金资产净值 1,000 1,000,000 0.46</p