

天弘永定价值成长混合型证券投资基金2016年年度报告

2016年12月31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

送出日期：2017年3月30日

## § 1 重要提示及目录

### 1.1 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。

本报告期自2016年1月1日起至2016年12月31日止。

## 1.2 目录

§1	重要提示及目录	2
1.1	重要提示	2
1.2	目录	3
§2	基金简介	5
2.1	基金基本情况	5
2.2	基金产品说明	5
2.3	基金管理人和基金托管人	5
2.4	信息披露方式	6
2.5	其他相关资料	6
§3	主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1	主要会计数据和财务指标	6
3.2	基金净值表现	7
3.3	过去三年基金的利润分配情况	9
§4	管理人报告	9
4.1	基金管理人及基金经理情况	9
4.2	管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明	11
4.3	管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	11
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	12
4.5	管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	13
4.6	管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	13
4.7	管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	15
4.8	管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	15
4.9	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	15
§5	托管人报告	16
5.1	报告期内本基金托管人遵规守信情况声明	16
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	16
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	16
§6	审计报告	16
6.1	审计报告基本信息	16
6.2	审计报告的基本内容	16
§7	年度财务报表	18
7.1	资产负债表	18
7.2	利润表	19
7.3	所有者权益（基金净值）变动表	21
7.4	报表附注	22
§8	投资组合报告	45
8.1	期末基金资产组合情况	45
8.2	报告期末按行业分类的股票投资组合	46
8.3	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	46
8.4	报告期内股票投资组合的重大变动	51
8.5	期末按债券品种分类的债券投资组合	67
8.6	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	67
8.7	期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有资产支持证券投资明细	67
8.8	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贵金属投资明细	68
8.9	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	68
8.10	报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	68

8.11	报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	68
8.12	投资组合报告附注	68
§9	基金份额持有人信息	69
9.1	期末基金份额持有人户数及持有人结构	69
9.2	期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	69
9.3	期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况	69
§10	开放式基金份额变动	69
§11	重大事件揭示	70
11.1	基金份额持有人大会决议	70
11.2	基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动	70
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	70
11.4	基金投资策略的改变	70
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况	70
11.6	管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	70
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况	70
11.8	其他重大事件	72
§12	备查文件目录	83
12.1	备查文件目录	83
12.2	存放地点	83
12.3	查阅方式	84

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

基金名称	天弘永定价值成长混合型证券投资基金
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	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		4007109999	95561
传真		022-83865569	021-62159217
注册地址		天津自贸区（中心商务区）响螺湾旷世国际大厦A座1704-241号	福建省福州市湖东路154号
办公地址		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	上海市江宁路168号兴业大厦20楼
邮政编码		300203	200041
法定代表人		井贤栋	高建平

## 2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
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

## 2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	国上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
注册登记机构	天弘基金管理有限公司	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

## § 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

<b>3.1.1 期间数据和指标</b>	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	0.1495	0.4258	0.3109
本期加权平均净值利润率	8.59%	27.60%	29.70%
本期基金份额净值增长率	17.45%	31.43%	41.80%
<b>3.1.2 期末数据和指标</b>	2016年末	2015年末	2014年末
期末可供分配利润	349,864,458.95	60,620,389.19	22,935,815.63
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
<b>3.1.3 累计期末指标</b>	2016年末	2015年末	2014年末
基金份额累计净值增长率	145.05%	108.64%	58.75%

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、期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

### 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

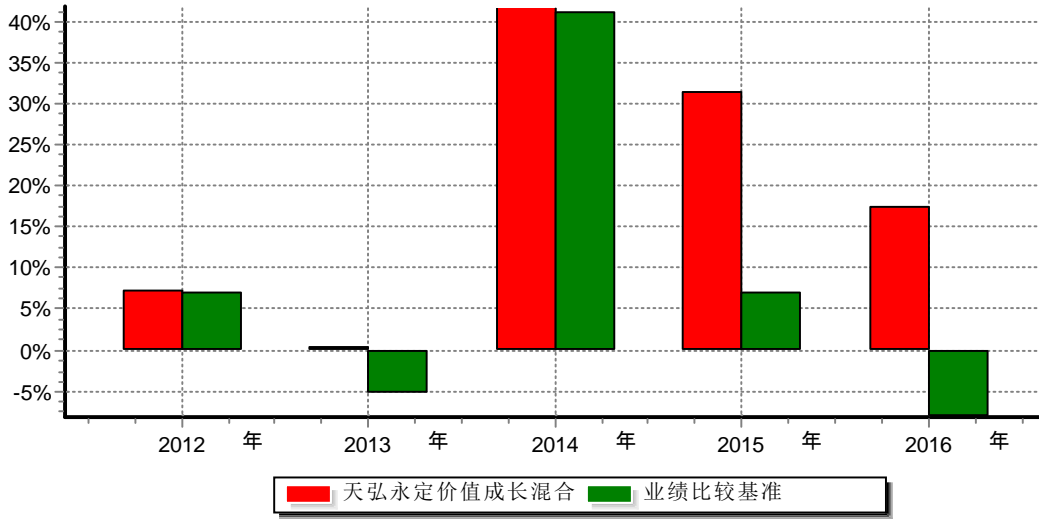


注：1、本基金合同于2008年12月2日生效。

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。

### 3.2.3 过去五年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		
肖志刚	本基金基金经理；本公	2014年1月	—	8年	男，经济学硕士。历任富国基金管理有限公司行业研究员。2013年8月加盟本

	司投资 研究部 总经理。				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合规守信情况的说明

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，通过交易系统内的公平交易程序，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养殖、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，将年初受累于熔断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乘用车行业，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，践行了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寻找规律，要善于从历史中观察、归纳出规律来，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，股价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自传取名为《已知与未知》，正是基于他的一段名言“据我们所知，有‘已知的已知’，有些事，我们知道我们知道。我们也知道，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，我们都知道特朗普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，比如朝鲜的大部分动向，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 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人的监察稽核工作一切从合规运作、防范和控制风险、保障基金份额持有人利益出发，由独立的监察稽核部门按照规定的权限和程序，认真履行职

责，对公司、基金运作及员工行为的合法性、合规性进行定期和不定期监督和检查。发现问题及时提出建议并督促相关部门改进完善，及时与有关人员沟通，并定期制作监察稽核报告报公司董事会。公司经理层面成立了风险管理委员会，根据公司总体风险控制目标，分配各业务和各环节风险控制目标和要求；落实公司重大风险管理的决定或决议；听取并讨论会议成员的报告；对会议成员提出的或发现的已经存在的风险点，在充分讨论、协调基础上形成具体的风险控制措施；对潜在风险点分析讨论，拟定应对措施；对发生的风险事件和重大差错，分析原因、总结经验教训、风险定级、划分责任，向总经理办公会报告。同时，本基金管理人根据全面性原则、独立性原则、相互制约原则、定性和定量相结合原则、重要性原则建立了一套比较完整的内部控制体系，该内部控制体系由一系列业务管理制度及相应的业务处理、控制程序组成，具体包括控制环境、风险评估、控制活动、信息和沟通、监控等要素。本基金管理人已通过了ISAE3402（《国际鉴证业务准则第3402号》）认证，获得无保留意见的控制设计适当性报告。本报告期，本基金管理人全面开展基金运作监察稽核工作，确保基金投资、营销及后台运作等各环节的合法合规。通过定期检查、不定期抽查等工作方法，完善内部控制，基金运作没有出现违规行为。本报告期内，本基金管理人有关本基金的监察稽核主要工作如下：

1、在研究环节，加强研究业务独立性，注重程序合规和质量控制；在关注研究报告形式与内容的合法性基础上，跟踪检查投资备选库的入选、维护依据；进一步规范新股、新债询价、申购流程；定期检查关联方关系以及关联交易的日常维护；定期评估研究对投资的支持程度，对投资业绩的贡献度；

2、在投资交易环节，对投资运作过程中的风险点进行识别和监控，预防和控制由内部或外部流程、人员和系统失控而造成的损失；根据法律法规要求、基金合同约定、投资决策委员会的决定，适时提出增加或优化交易系统风控指标的建议，通过投资交易系统控制投资风险；跟踪每日的交易行为和交易结果，发现预警信息通过电话、邮件及合规提示及时提醒，保障投资环节的合规运作；监督检查风险管理部参与各投资组合新股申购、一级债申购、银行间交易等场外交易，保证各投资组合场外交易的事中合规控制；

3、投资管理人员管理环节，加强对投资管理人员即时聊天工具、办公电话、移动电话、终端设备网上交易的合规监控，监督投资管理人员直系亲属账户及股票交易申报制度、交易时间移动电话集中保管制度的有效执行，采取各种有效方式杜绝老鼠仓、非公平交易及各种形式的利益输送行为；

4、基金募集与营销环节，对基金宣传推介材料及定投、费率优惠等基金销售业务活动进行事前合规检查，做到事前防范风险，保障基金营销合法合规。在基金利用互联网平台营销方面，对各类新兴业务的活动方案进行事前合规评估，保证业务开展的同时注重事前风险防范；

5、基金运营环节，加强对注册登记、会计核算、基金清算、估值业务的稽核力度，保证基金运营安全、准确；

6、信息披露环节，严格按照信息披露管理办法的规定，认真做好本基金的信息披露工作，保证信息披露的真实、准确、完整、及时。

报告期内，本基金整体运作合法合规，内部控制和风险防范措施逐步完善，保障了基金份额持有人的利益。本基金管理人将继续从合规运作、防范和控制风险、保障基金份额持有人利益出发，提高内部控制和风险管理的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

#### **4.7 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。

#### **4.8 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。

#### **4.9 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

### 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(2017)第20802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	天弘永定价值成长混合型证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的天弘永定价值成长混合型证券投资基金(以下简称"天弘永定价值成长混合")的财务报表，包括2016年12月31日的资产负债表、2016



	<p>年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。</p>
<p>管理层对财务报表的责任段</p>	<p>编制和公允列报财务报表是天弘永定价值成长混合的基金管理人天弘基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括：</p> <p>(1)按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")、中国证券投资基金业协会(以下简称"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财务报表,并使其实现公允反映;</p> <p>(2)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。</p>
<p>注册会计师的责任段</p>	<p>我们的责任是在执行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。</p> <p>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和公允列报相关的内部控制,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。</p> <p>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。</p>
<p>审计意见段</p>	<p>我们认为,上述天弘永定价值成长混合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,公允反映了天弘永定价值成长混合2016年12月31日的</p>

	财务状况以及2016年度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	2017-03-30

## § 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
<b>资 产：</b>			
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
<b>负债和所有者权益</b>	<b>附注号</b>	<b>本期末 2016年12月31日</b>	<b>上年度末 2015年12月31日</b>
<b>负 债:</b>			
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
<b>所有者权益:</b>			
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
<b>一、收入</b>		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
<b>减：二、费用</b>		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)	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)	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(以下简称"中国证监会")证监许可[2008]第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普华永道中天验字(2008)第184号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《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日公告后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 重要会计政策和会计估计

##### 7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

#### 7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

#### 7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

##### (1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

##### (2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括其他各类应付款项等。

#### 7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。



#### 7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1)存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2)存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3)当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

#### 7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

#### 7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

#### 7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

#### 7.4.4.9 收入/（损失）的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后

的净额确认为投资收益。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### **7.4.4.10 费用的确认和计量**

本基金的管理人报酬和托管费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

#### **7.4.4.11 基金的收益分配政策**

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

#### **7.4.4.12 分部报告**

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

#### **7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计**

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

对于证券交易所上市的股票，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行业股票估值指数的通知》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

## 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 重要财务报表项目的说明

### 7.4.7.1 银行存款

单位: 人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
活期存款	106,069,732.71	34,639,698.77
定期存款	—	—
其中: 存款期限1-3个月	—	—
其他存款	—	—
合计	106,069,732.71	34,639,698.77

### 7.4.7.2 交易性金融资产

单位: 人民币元

项目	本期末 2016年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	789,332,977.02	794,063,732.01	4,730,754.99
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—
债券	交易所市场	—	—
	银行间市场	—	—
	合计	—	—
资产支持证券	—	—	—
基金	—	—	—
其他	—	—	—
合计	789,332,977.02	794,063,732.01	4,730,754.99

项目	上年度末 2015年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	149,727,554.74	148,890,865.44	-836,689.30
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—
债券	交易所市场	—	—
	银行间市场	—	—
	合计	—	—
资产支持证券	—	—	—
基金	—	—	—
其他	—	—	—
合计	149,727,554.74	148,890,865.44	-836,689.30

注：截至2016年12月31日,股票投资余额中包含按照指数收益法估值的特殊事项停牌相关股票。

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本期末及上年度末未持有衍生金融工具。

#### 7.4.7.4 买入返售金融资产

##### 7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本期末及上年度末未持有因买断式逆回购而取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
应收活期存款利息	57,410.51	22,986.33
应收定期存款利息	—	—
应收其他存款利息	—	—
应收结算备付金利息	5,077.60	1,119.47

应收债券利息	—	—
应收买入返售证券利息	—	—
应收申购款利息	—	—
应收黄金合约拆借孳息	—	—
其他	509.52	517.22
合计	62,997.63	24,623.02

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本期末及上年度末未持有其他资产。

#### 7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
交易所市场应付交易费用	4,750,272.48	1,057,608.34
银行间市场应付交易费用	—	—
合计	4,750,272.48	1,057,608.34

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
应付券商交易单元保证金	—	—
应付赎回费	16,775.63	3,005.06
预提费用	360,000.00	464,500.00
合计	376,775.63	467,505.06

#### 7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期2016年1月1日至2016年12月31日	
	基金份额（份）	账面金额
上年度末	115,596,935.37	115,596,935.37

本期申购	654,163,494.54	654,163,494.54
本期赎回（以“-”号填列）	-296,234,384.47	-296,234,384.47
本期末	473,526,045.44	473,526,045.44

注：申购份额含转换转入份额；赎回份额含转换转出份额。

#### 7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	60,620,389.19	4,634,725.67	65,255,114.86
本期利润	25,242,482.91	5,567,444.29	30,809,927.20
本期基金份额交易产生的变动数	264,001,586.85	36,503,391.72	300,504,978.57
其中：基金申购款	467,026,787.87	59,464,307.13	526,491,095.00
基金赎回款	-203,025,201.02	-22,960,915.41	-225,986,116.43
本期已分配利润	—	—	—
本期末	349,864,458.95	46,705,561.68	396,570,020.63

#### 7.4.7.11 存款利息收入

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
活期存款利息收入	935,284.44	919,799.70
定期存款利息收入	—	—
其他存款利息收入	—	—
结算备付金利息收入	49,457.09	52,212.14
其他	38,561.10	34,693.42
合计	1,023,302.63	1,006,705.26

#### 7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
----	----	---------

	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
卖出股票成交总额	4,223,976,303.56	3,940,914,097.79
减：卖出股票成本总额	4,183,089,308.06	3,858,014,740.38
买卖股票差价收入	40,886,995.50	82,899,357.41

#### 7.4.7.13 基金投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间未取得基金投资收益。

#### 7.4.7.14 债券投资收益

##### 7.4.7.14.1 债券投资收益项目构成

本基金本报告期及上年度可比期间未取得债券投资收益。

##### 7.4.7.14.2 资产支持证券投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间未取得资产支持证券投资收益。

#### 7.4.7.15 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间未取得贵金属投资收益。

#### 7.4.7.16 衍生工具收益

本基金本报告期及上年度可比期间未取得衍生工具投资收益。

#### 7.4.7.17 股利收益

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
股票投资产生的股利收益	2,433,135.04	2,217,126.78
基金投资产生的股利收益	—	—
合计	2,433,135.04	2,217,126.78

#### 7.4.7.18 公允价值变动收益

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
1.交易性金融资产	5,567,444.29	95,295.70
——股票投资	5,567,444.29	95,295.70
——债券投资	—	—
——资产支持证券投资	—	—
——基金投资	—	—
——贵金属投资	—	—
——其他	—	—
2.衍生工具	—	—
——权证投资	—	—
3.其他	—	—
合计	5,567,444.29	95,295.70

#### 7.4.7.19 其他收入

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
基金赎回费收入	621,217.20	1,202,610.10
转换费收入	2,826.63	17,859.42
合计	624,043.83	1,220,469.52

注：1、本基金的赎回费率按持有期间递减，赎回费总额的25%归入基金资产。

2、本基金的转换费由申购补差费和转出基金的赎回费两部分构成，其中转出基金的赎回费的25%归入转出基金的基金资产。

#### 7.4.7.20 交易费用

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
----	-----------------------------	----------------------------------

交易所市场交易费用	13,184,600.31	11,930,377.15
银行间市场交易费用	—	—
合计	13,184,600.31	11,930,377.15

#### 7.4.7.21 其他费用

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
审计费用	60,000.00	60,000.00
信息披露费	300,000.00	300,000.00
其他费用	200.00	—
帐户维护费	1,500.00	18,400.00
汇划手续费	3,086.49	7,482.39
合计	364,786.49	385,882.39

#### 7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

##### 7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

##### 7.4.8.2 资产负债表日后事项

财政部、国家税务总局于2016年12月21日颁布《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》(财税[2016]140号)，要求资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，自2016年5月1日起执行。

根据财政部、国家税务总局于2017年1月6日颁布的《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税[2017]2号)，2017年7月1日(含)以后，资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人，按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在2017年7月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。资管产品运营过程中发生增值税应税行为的具体征收管理办法，由国家税务总局另行制定。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

#### 7.4.9 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"。

#### 7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

##### 7.4.10.1 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。

##### 7.4.10.2 关联方报酬

###### 7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	2015年1月1日至2015年12月31日
当期发生的基金应支	5,297,663.44	3,808,389.79

付的管理费		
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。

#### 7.4.10.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	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。

#### 7.4.10.3 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。

#### 7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

##### 7.4.10.4.1 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	上年度可比期间
	2016年1月1日至2016年12月31日	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%

#### 7.4.10.4.2 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无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

#### 7.4.10.5 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，按银行同业利率计息。

#### 7.4.10.6 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比期间未在承销期内参与关联方承销证券交易。

#### 7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

#### 7.4.11 利润分配情况

##### 7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金本报告期无利润分配事项。

#### 7.4.12 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券

##### 7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

##### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量 (单位:股)	期末成本总额	期末估值总额
000727	华东科技	2016-11-17	重大资产重组	3.37	2017-02-15	3.47	297,123	1,052,864.58	1,001,304.51
002025	航天电器	2016-09-12	重大资产重组	25.20	-	-	61	1,404.21	1,537.20
002156	通富微电	2016-12-28	重大事项	11.38	2017-01-05	11.65	20	287.55	227.60
300100	双林股份	2016-11-07	重大资产重组	34.00	2017-01-25	30.60	79	2,364.21	2,686.00
300449	汉邦高科	2016-11-11	重大资产重组	44.29	2017-02-24	43.88	5	202.19	221.45

注：本基金截至2016年12月31日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

### 7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

#### 7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2016年12月31日，本基金未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

#### 7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2016年12月31日，本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

### 7.4.13 金融工具风险及管理

#### 7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

本基金是一只进行主动投资的混合型证券投资基金，属于风险较高、收益较高的证券投资基金产品，其风险收益预期高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。本基金的投资对象是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。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是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。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以审计与风险控制委员会为核心的、由督察长、风险管理委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，董事会负责监督检查公司的合法合规运营、内部控制、风险管理，从而控制公司的整体运营风险。

在董事会下设立审计与风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等。公司经理层面成立了风险管理委员会，根据公司总体风险控制目标，分配各业务和各环节风险控制目标和要求；落实公司重大风险管理的决定或决议；听取并讨论会议成员的报告；对会议成员提出的或发现的已经存在的风险点，在充分讨论、协调基础上形成具体的风险控制措施；对潜在风险点分析讨论，拟定应对措施；对发生的风险事件和重大差错，分析原因、总结经验教训、风险定级、划分责任，向总经理办公会报告。在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部负责，对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理提供合规控制标准，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标；监察稽核部对公司总经理负责，并由督察长分管。风险管理部通过投资交易系统的风控参数设置，保证各投资组合的投资比例合规；参与各投资组合新股申购、一级债申购、银行间交易等场外交易的风险识别与评估，保证各投资组合场外交易的事中合规控制；负责各投资组合投资绩效、风险的计量和控制。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

#### 7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的活期银行存款存放在本基金的托管行兴业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

于2016年12月31日,本基金无债券投资(2015年12月31日：同)。

#### 7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场上出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人每日对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司的证券不得超过该证券的10%。本基金所持全部证券均在证券交易所上市，因此除附注7.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于2016年12月31日，本基金所承担的全部金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

#### 7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

##### 7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金持有及承担的大部分金融资产和金融负债不计息，因此本基金的收入及经营活动的现金流量在很大程度上独立于市场利率变化。本基金持有的利率敏感性资产主要为银行存款、结算备付金、存出保证金等。

##### 7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

金额单位：人民币元

本期末2016年 12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
--------------------	------	------	------	-----	----



资产					
银行存款	106,069,732.71	—	—	—	106,069,732.71
结算备付金	10,257,750.70	—	—	—	10,257,750.70
存出保证金	1,029,334.80	—	—	—	1,029,334.80
交易性金融资产	—	—	—	794,063,732.01	794,063,732.01
应收利息	—	—	—	62,997.63	62,997.63
应收申购款	—	—	—	4,055,853.76	4,055,853.76
资产总计	117,356,818.21	—	—	798,182,583.40	915,539,401.61
负债					
应付证券清算款	—	—	—	34,347,517.05	34,347,517.05
应付赎回款	—	—	—	4,639,084.61	4,639,084.61
应付管理人报酬	—	—	—	1,105,977.50	1,105,977.50
应付托管费	—	—	—	184,329.57	184,329.57
应付交易费用	—	—	—	4,750,272.48	4,750,272.48
应交税费	—	—	—	39,378.70	39,378.70
其他负债	—	—	—	376,775.63	376,775.63
负债总计	—	—	—	45,443,335.54	45,443,335.54
利率敏感度缺口	117,356,818.21	—	—	752,739,247.86	870,096,066.07
上年度末2015年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	34,639,698.				34,639,698.

	77				77
结算备付金	2,261,580.63				2,261,580.63
存出保证金	1,044,887.51				1,044,887.51
交易性金融资产	—			148,890,865.44	148,890,865.44
应收证券清算款	—			2,428,558.44	2,428,558.44
应收利息	—			24,623.02	24,623.02
应收申购款	21,254.26			33,081.22	54,335.48
资产总计	37,967,421.17	—	—	151,377,128.12	189,344,549.29
负债					
应付证券清算款	—			5,757,948.47	5,757,948.47
应付赎回款	—			890,322.97	890,322.97
应付管理人报酬	—			239,773.30	239,773.30
应付托管费	—			39,962.22	39,962.22
应付交易费用	—			1,057,608.34	1,057,608.34
应交税费	—			39,378.70	39,378.70
其他负债	—			467,505.06	467,505.06
负债总计	—	—	—	8,492,499.06	8,492,499.06
利率敏感度缺口	37,967,421.17	—	—	142,884,629.06	180,852,050.23

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2016年12月31日，本基金未持有交易性债券投资(2015年12月31日：同)，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响(2015年12月31日：同)。

#### 7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

#### 7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用“自上而下”的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金的投资组合比例为：股票等权益类资产占基金资产的比例为60% - 95%，现金、债券资产、权证以及中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为5% - 40%，现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%，权证投资占基金资产净值的比例不超过3%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量。”

##### 7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日		上年度末 2015年12月31日	
	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)	公允价值	占基金 资产净 值比例 (%)
交易性金融资产-股票投资	794,063,732.01	91.26	148,890,865.44	82.33
交易性金融资产-基金投资	—	—	—	—
交易性金融资产-贵金属投资	—	—	—	—

衍生金融资产—权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—
合计	794,063,732.01	91.26	148,890,865.44	82.33

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

假设	除业绩比较基准(附注7.4.1)以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额(单位:人民币元)	
		本期末(2016年12月31日)	上年度末(2015年12月31日)
	业绩比较基准(附注7.4.1)上升5%	51,872,169.13	8,952,176.49
	业绩比较基准(附注7.4.1)下降5%	-51,872,169.13	-8,952,176.49

#### 7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

##### (1)公允价值

##### (a)金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次,由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定:

第一层次:相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次:除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次:相关资产或负债的不可观察输入值。

##### (b)持续的以公允价值计量的金融工具

##### (i)各层次金融工具公允价值

于2016年12月31日,本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为793,057,755.25元,属于第二层次的余额为1,005,976.76元,无属于第三层次的余额(2015年12月31日:第一层次143,049,523.19元,第二层次5,841,342.25元,无属于第三层次的余额)。

##### (ii)公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于2016年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2015年12月31日：同)。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

## § 8 投资组合报告

### 8.1 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	794,063,732.01	86.73
	其中：股票	794,063,732.01	86.73
2	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
3	贵金属投资	—	—
4	金融衍生品投资	—	—
5	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金	—	—

	融资产		
6	银行存款和结算备付金合计	116,327,483.41	12.71
7	其他各项资产	5,148,186.19	0.56
8	合计	915,539,401.61	100.00

## 8.2 报告期末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	66,196,785.94	7.61
B	采矿业	—	—
C	制造业	672,012,537.89	77.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,351,207.20	0.96
E	建筑业	129,324.63	0.01
F	批发和零售业	1,043,854.25	0.12
G	交通运输、仓储和邮政业	110,612.47	0.01
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,138,640.98	1.28
J	金融业	472,658.89	0.05
K	房地产业	289,852.54	0.03
L	租赁和商务服务业	33,878,916.50	3.89
M	科学研究和技术服务业	590.22	—
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	2,890.88	—
S	综合	435,859.62	0.05
	合计	794,063,732.01	91.26

## 8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

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	占基金资产净值比例(%)
1	601100	恒立液压	4,838,103	77,699,934.18	8.93
2	300257	开山股份	3,928,238	67,408,564.08	7.75
3	603338	浙江鼎力	1,283,572	66,886,936.92	7.69
4	002714	牧原股份	2,843,348	66,193,141.44	7.61
5	300124	汇川技术	3,222,787	65,519,259.71	7.53
6	300476	胜宏科技	2,769,350	63,279,647.50	7.27
7	601633	长城汽车	5,560,661	61,500,910.66	7.07
8	000581	威孚高科	1,812,858	40,680,533.52	4.68
9	600178	东安动力	3,678,037	40,605,528.48	4.67
10	600093	禾嘉股份	2,336,477	33,878,916.50	3.89
11	600418	江淮汽车	2,903,658	33,566,286.48	3.86
12	002480	新筑股份	2,917,492	33,113,534.20	3.81
13	600984	*ST建机	3,047,630	26,636,286.20	3.06
14	000550	江铃汽车	872,778	23,565,006.00	2.71
15	002535	林州重机	3,361,673	21,884,491.23	2.52
16	600885	宏发股份	543,559	17,366,710.05	2.00
17	002241	歌尔股份	636,000	16,866,720.00	1.94
18	300365	恒华科技	259,400	10,765,100.00	1.24
19	600617	国新能源	758,100	7,960,050.00	0.91
20	002546	新联电子	224,000	2,031,680.00	0.23
21	000727	华东科技	297,123	1,001,304.51	0.12
22	000425	徐工机械	230,000	777,400.00	0.09
23	000338	潍柴动力	77,871	775,595.16	0.09
24	600585	海螺水泥	43,544	738,506.24	0.08
25	002371	北方华创	26,565	706,629.00	0.08
26	600518	康美药业	37,864	675,872.40	0.08
27	000800	一汽轿车	60,071	652,971.77	0.08
28	002294	信立泰	21,353	624,361.72	0.07

29	600062	华润双鹤	27,119	602,855.37	0.07
30	600499	科达洁能	75,300	569,268.00	0.07
31	600741	华域汽车	29,693	473,603.35	0.05
32	600805	悦达投资	51,338	435,859.62	0.05
33	000680	山推股份	76,384	422,403.52	0.05
34	000030	富奥股份	48,200	409,700.00	0.05
35	600998	九州通	19,631	407,146.94	0.05
36	000401	冀东水泥	33,000	392,700.00	0.05
37	000669	金鸿能源	22,808	391,157.20	0.04
38	002648	卫星石化	27,244	332,921.68	0.04
39	601717	郑煤机	42,950	301,938.50	0.03
40	000815	美利云	13,411	275,596.05	0.03
41	600660	福耀玻璃	13,794	256,982.22	0.03
42	000625	长安汽车	16,982	253,711.08	0.03
43	600515	海岛建设	20,949	243,008.40	0.03
44	600309	万华化学	11,258	242,384.74	0.03
45	002481	双塔食品	23,139	209,870.73	0.02
46	601258	庞大集团	69,082	191,357.14	0.02
47	601233	桐昆股份	12,955	186,033.80	0.02
48	000980	金马股份	12,750	183,982.50	0.02
49	002568	百润股份	8,581	173,679.44	0.02
50	300294	博雅生物	2,916	164,316.60	0.02
51	000615	京汉股份	15,608	162,167.12	0.02
52	000528	柳工	19,798	144,723.38	0.02
53	603189	网达软件	3,898	141,848.22	0.02
54	601500	通用股份	5,653	135,502.41	0.02
55	600307	酒钢宏兴	48,942	133,611.66	0.02
56	603007	花王股份	2,424	128,884.08	0.01
57	603160	汇顶科技	1,250	128,425.00	0.01
58	600297	广汇汽车	14,026	120,062.56	0.01



59	601628	中国人寿	4,959	119,462.31	0.01
60	600873	梅花生物	17,943	116,988.36	0.01
61	000157	中联重科	25,477	115,665.58	0.01
62	300103	达刚路机	5,173	114,633.68	0.01
63	601336	新华保险	2,593	113,521.54	0.01
64	601169	北京银行	11,342	110,697.92	0.01
65	000039	中集集团	7,391	108,056.42	0.01
66	600926	杭州银行	5,075	106,321.25	0.01
67	300017	网宿科技	1,967	105,450.87	0.01
68	600104	上汽集团	3,971	93,119.95	0.01
69	600026	中海发展	13,173	89,708.13	0.01
70	600325	华发股份	6,545	83,776.00	0.01
71	002134	天津普林	5,181	82,947.81	0.01
72	603777	来伊份	1,549	82,236.41	0.01
73	600815	厦工股份	12,456	80,216.64	0.01
74	603067	振华股份	2,616	74,215.92	0.01
75	603313	恒康家居	1,873	71,904.47	0.01
76	600295	鄂尔多斯	7,110	67,473.90	0.01
77	600398	海澜之家	6,249	67,426.71	0.01
78	002813	路畅科技	1,296	65,888.64	0.01
79	603421	鼎信通讯	1,632	65,818.56	0.01
80	300548	博创科技	754	63,773.32	0.01
81	002815	崇达技术	1,378	62,395.84	0.01
82	603816	顾家家居	1,098	51,979.32	0.01
83	300542	新晨科技	988	50,783.20	0.01
84	300130	新国都	2,000	49,660.00	0.01
85	600963	岳阳林纸	5,531	45,188.27	0.01
86	300072	三聚环保	902	41,753.58	—
87	600071	*ST光学	1,612	38,365.60	—
88	600376	首开股份	2,210	26,100.10	—

89	600036	招商银行	964	16,966.40	—
90	603885	吉祥航空	669	15,587.70	—
91	000046	泛海控股	1,013	9,410.77	—
92	600322	天房发展	1,308	8,279.64	—
93	002777	久远银海	84	7,576.80	—
94	600115	东方航空	752	5,316.64	—
95	002792	通宇通讯	97	5,263.22	—
96	002791	坚朗五金	89	4,859.40	—
97	002746	仙坛股份	74	3,644.50	—
98	002797	第一创业	97	3,375.60	—
99	000938	紫光股份	55	3,156.45	—
100	002343	慈文传媒	64	2,890.88	—
101	300100	双林股份	79	2,686.00	—
102	002667	鞍重股份	86	2,421.76	—
103	002180	艾派克	77	2,165.24	—
104	002035	华帝股份	79	2,050.05	—
105	000860	顺鑫农业	83	1,826.00	—
106	002606	大连电瓷	37	1,782.66	—
107	002025	航天电器	61	1,537.20	—
108	300236	上海新阳	35	1,347.50	—
109	002548	金新农	89	1,284.27	—
110	002286	保龄宝	73	1,225.67	—
111	300273	和佳股份	70	1,194.20	—
112	000776	广发证券	68	1,146.48	—
113	002508	老板电器	31	1,140.80	—
114	300231	银信科技	60	1,110.60	—
115	002007	华兰生物	30	1,072.50	—
116	002291	星期六	63	1,059.03	—
117	002790	瑞尔特	22	1,058.20	—
118	600000	浦发银行	59	956.39	—

119	002443	金洲管道	87	951.78	—
120	000997	新大陆	39	757.77	—
121	300056	三维丝	42	699.30	—
122	300165	天瑞仪器	68	680.00	—
123	002665	首航节能	62	543.12	—
124	002081	金螳螂	45	440.55	—
125	000933	*ST神火	78	432.90	—
126	002429	兆驰股份	42	418.32	—
127	300319	麦捷科技	10	392.90	—
128	300008	天海防务	14	341.46	—
129	300384	三联虹普	6	248.76	—
130	002156	通富微电	20	227.60	—
131	300449	汉邦高科	5	221.45	—
132	002197	证通电子	12	195.72	—
133	002153	石基信息	8	194.96	—
134	601998	中信银行	28	179.48	—
135	000886	海南高速	23	118.91	—
136	300255	常山药业	14	110.60	—
137	600153	建发股份	4	42.80	—
138	601988	中国银行	6	20.64	—
139	601939	建设银行	2	10.88	—

## 8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

### 8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	002714	牧原股份	118,870,148.85	65.73
2	300124	汇川技术	116,861,943.87	64.62
3	601633	长城汽车	106,069,803.84	58.65
4	600178	东安动力	92,347,541.64	51.06

5	600418	江淮汽车	90,203,083.85	49.88
6	600166	福田汽车	82,076,322.00	45.38
7	000581	威孚高科	82,030,320.94	45.36
8	603338	浙江鼎力	80,821,902.75	44.69
9	000338	潍柴动力	72,417,103.88	40.04
10	300257	开山股份	70,608,315.02	39.04
11	601100	恒立液压	67,060,106.14	37.08
12	600499	科达洁能	62,048,702.29	34.31
13	601336	新华保险	61,647,700.22	34.09
14	300476	胜宏科技	60,463,837.38	33.43
15	600741	华域汽车	54,088,818.89	29.91
16	600582	天地科技	53,766,200.53	29.73
17	002501	利源精制	53,630,859.36	29.65
18	600093	禾嘉股份	52,640,226.35	29.11
19	000625	长安汽车	52,049,514.11	28.78
20	002241	歌尔股份	51,042,014.25	28.22
21	600309	万华化学	50,836,117.94	28.11
22	002157	正邦科技	49,356,217.38	27.29
23	601717	郑煤机	49,030,649.13	27.11
24	600660	福耀玻璃	47,664,248.08	26.36
25	002202	金风科技	45,843,909.34	25.35
26	000528	柳工	45,234,902.56	25.01
27	600104	上汽集团	43,553,224.96	24.08
28	601628	中国人寿	42,004,926.05	23.23
29	002477	雏鹰农牧	40,748,102.87	22.53
30	600702	沱牌舍得	40,593,584.77	22.45
31	002480	新筑股份	40,580,102.55	22.44
32	600016	民生银行	39,911,281.69	22.07
33	002124	天邦股份	38,866,267.79	21.49
34	000680	山推股份	38,395,547.61	21.23

35	600031	三一重工	38,244,230.81	21.15
36	300182	捷成股份	37,763,793.58	20.88
37	600984	*ST建机	36,782,863.76	20.34
38	002299	圣农发展	36,418,453.55	20.14
39	000550	江铃汽车	36,268,963.71	20.05
40	600873	梅花生物	35,749,698.00	19.77
41	002535	林州重机	35,513,060.49	19.64
42	000157	中联重科	35,294,442.99	19.52
43	000860	顺鑫农业	35,119,528.91	19.42
44	002321	华英农业	35,096,358.00	19.41
45	601601	中国太保	31,851,497.72	17.61
46	600074	保千里	30,058,712.03	16.62
47	300227	光韵达	29,562,418.27	16.35
48	000425	徐工机械	28,656,659.00	15.85
49	000951	中国重汽	26,856,433.13	14.85
50	000669	金鸿能源	26,733,822.02	14.78
51	000815	美利云	26,650,826.31	14.74
52	600805	悦达投资	26,471,753.54	14.64
53	600340	华夏幸福	25,984,293.95	14.37
54	300012	华测检测	25,509,936.10	14.11
55	600751	天海投资	25,201,781.00	13.94
56	600815	厦工股份	24,587,953.29	13.60
57	600297	广汇汽车	24,484,434.00	13.54
58	002304	洋河股份	24,342,085.72	13.46
59	600169	太原重工	24,072,499.00	13.31
60	600515	海岛建设	23,362,902.08	12.92
61	000001	平安银行	23,253,664.36	12.86
62	000869	张裕A	23,218,901.51	12.84
63	000727	华东科技	22,889,438.98	12.66
64	300498	温氏股份	22,771,244.78	12.59

65	600266	北京城建	22,307,169.34	12.33
66	002419	天虹商场	22,099,334.53	12.22
67	600307	酒钢宏兴	22,047,184.82	12.19
68	000596	古井贡酒	21,756,808.00	12.03
69	600376	首开股份	21,693,582.29	12.00
70	000401	冀东水泥	21,563,413.22	11.92
71	002646	青青稞酒	21,002,764.13	11.61
72	600398	海澜之家	20,801,101.11	11.50
73	002481	双塔食品	20,770,154.86	11.48
74	600478	科力远	20,738,863.76	11.47
75	600919	江苏银行	20,718,565.00	11.46
76	000858	五粮液	19,877,809.43	10.99
77	600617	国新能源	19,799,764.65	10.95
78	002142	宁波银行	19,658,760.84	10.87
79	600885	宏发股份	18,799,787.05	10.40
80	600585	海螺水泥	18,790,176.00	10.39
81	603369	今世缘	18,329,969.63	10.14
82	601933	永辉超市	18,262,866.00	10.10
83	002024	苏宁云商	18,176,556.06	10.05
84	601965	中国汽研	17,860,802.67	9.88
85	000039	中集集团	17,463,795.00	9.66
86	002538	司尔特	17,416,095.00	9.63
87	600519	贵州茅台	17,125,675.95	9.47
88	601818	光大银行	17,063,444.00	9.44
89	000800	一汽轿车	16,842,688.02	9.31
90	600998	九州通	16,517,163.77	9.13
91	601318	中国平安	16,191,426.00	8.95
92	601002	晋亿实业	16,060,267.42	8.88
93	002267	陕天然气	15,658,037.68	8.66
94	601989	中国重工	15,466,894.81	8.55

95	600115	东方航空	15,291,033.00	8.46
96	600433	冠豪高新	15,280,868.30	8.45
97	002746	仙坛股份	15,230,934.20	8.42
98	600026	中海发展	14,883,121.00	8.23
99	601069	西部黄金	14,719,750.04	8.14
100	000793	华闻传媒	14,311,233.00	7.91
101	600559	老白干酒	14,236,905.00	7.87
102	600036	招商银行	14,059,402.80	7.77
103	601988	中国银行	14,030,530.00	7.76
104	601169	北京银行	13,748,053.00	7.60
105	300479	神思电子	13,563,260.52	7.50
106	300017	网宿科技	13,543,816.21	7.49
107	002559	亚威股份	13,483,342.88	7.46
108	601998	中信银行	13,346,054.00	7.38
109	600015	华夏银行	13,149,873.70	7.27
110	600062	华润双鹤	12,917,826.93	7.14
111	600975	新五丰	12,608,844.49	6.97
112	600963	岳阳林纸	12,443,029.40	6.88
113	600000	浦发银行	12,203,512.19	6.75
114	000568	泸州老窖	11,977,707.28	6.62
115	600655	豫园商城	11,834,313.78	6.54
116	600325	华发股份	11,826,457.05	6.54
117	600009	上海机场	11,722,650.54	6.48
118	002146	荣盛发展	11,460,169.00	6.34
119	002327	富安娜	11,209,343.09	6.20
120	000831	*ST五稀	11,147,264.53	6.16
121	601009	南京银行	11,062,922.70	6.12
122	000848	承德露露	11,058,827.66	6.11
123	601198	东兴证券	10,999,439.90	6.08
124	000046	泛海控股	10,828,070.02	5.99

125	300365	恒华科技	10,807,800.00	5.98
126	000983	西山煤电	10,656,247.92	5.89
127	601111	中国国航	10,363,771.14	5.73
128	000026	飞亚达 A	10,331,024.00	5.71
129	600197	伊力特	10,304,809.80	5.70
130	000606	神州易桥	10,117,035.00	5.59
131	000980	金马股份	10,042,398.00	5.55
132	002294	信立泰	10,030,052.68	5.55
133	002727	一心堂	9,896,164.66	5.47
134	600029	南方航空	9,853,901.00	5.45
135	603686	龙马环卫	9,664,914.00	5.34
136	600584	长电科技	9,544,526.94	5.28
137	000886	海南高速	9,299,200.50	5.14
138	000065	北方国际	9,103,116.00	5.03
139	600477	杭萧钢构	9,025,021.36	4.99
140	600489	中金黄金	8,999,539.36	4.98
141	601088	中国神华	8,995,599.56	4.97
142	600779	*ST水井	8,989,748.47	4.97
143	601939	建设银行	8,903,542.88	4.92
144	600338	西藏珠峰	8,812,887.78	4.87
145	600881	亚泰集团	8,765,913.75	4.85
146	600295	鄂尔多斯	8,680,891.21	4.80
147	002234	民和股份	8,669,852.71	4.79
148	000937	冀中能源	8,632,605.28	4.77
149	601233	桐昆股份	8,521,734.48	4.71
150	000823	超声电子	8,515,225.00	4.71
151	601888	中国国旅	8,507,332.94	4.70
152	000572	海马汽车	8,411,264.00	4.65
153	002751	易尚展示	8,395,089.57	4.64
154	600405	动力源	8,372,910.50	4.63



155	601985	中国核电	8,333,365.00	4.61
156	002298	中电鑫龙	8,310,581.20	4.60
157	601608	中信重工	8,212,895.53	4.54
158	002371	北方华创	8,128,680.00	4.49
159	600518	康美药业	8,077,609.55	4.47
160	601021	春秋航空	8,077,569.56	4.47
161	601238	广汽集团	8,045,993.44	4.45
162	600495	晋西车轴	7,988,939.00	4.42
163	601106	中国一重	7,926,679.85	4.38
164	002568	百润股份	7,915,229.58	4.38
165	002236	大华股份	7,664,428.13	4.24
166	600221	海南航空	7,641,954.50	4.23
167	600136	当代明诚	7,594,234.10	4.20
168	300036	超图软件	7,558,555.21	4.18
169	002292	奥飞娱乐	7,463,496.59	4.13
170	002434	万里扬	7,366,027.96	4.07
171	601168	西部矿业	7,355,849.16	4.07
172	002456	欧菲光	7,331,798.50	4.05
173	600547	山东黄金	7,320,033.64	4.05
174	002097	山河智能	7,318,758.98	4.05
175	600320	振华重工	7,311,342.63	4.04
176	002103	广博股份	6,867,778.00	3.80
177	000952	广济药业	6,821,157.31	3.77
178	002078	太阳纸业	6,767,442.00	3.74
179	002320	海峡股份	6,759,551.46	3.74
180	002180	艾派克	6,693,176.20	3.70
181	600118	中国卫星	6,588,612.12	3.64
182	601678	滨化股份	6,526,185.00	3.61
183	603885	吉祥航空	6,522,093.00	3.61
184	600558	大西洋	6,499,409.44	3.59

185	300103	达刚路机	6,472,027.84	3.58
186	002665	首航节能	6,324,646.50	3.50
187	002427	尤夫股份	6,090,614.00	3.37
188	002458	益生股份	6,023,934.24	3.33
189	600109	国金证券	5,844,770.00	3.23
190	601688	华泰证券	5,842,652.00	3.23
191	600348	阳泉煤业	5,786,975.00	3.20
192	601139	深圳燃气	5,771,630.35	3.19
193	603589	口子窖	5,760,220.00	3.19
194	300098	高新兴	5,569,551.00	3.08
195	002191	劲嘉股份	5,444,295.07	3.01
196	600395	盘江股份	5,403,118.29	2.99
197	601668	中国建筑	5,376,865.00	2.97
198	600809	山西汾酒	5,243,087.37	2.90
199	002429	兆驰股份	5,150,683.00	2.85
200	002032	苏泊尔	5,082,761.00	2.81
201	002344	海宁皮城	5,068,736.41	2.80
202	601117	中国化学	4,895,581.00	2.71
203	002051	中工国际	4,854,105.00	2.68
204	600692	亚通股份	4,750,539.00	2.63
205	600343	航天动力	4,749,485.98	2.63
206	600879	航天电子	4,733,105.30	2.62
207	300236	上海新阳	4,727,622.00	2.61
208	300197	铁汉生态	4,532,989.96	2.51
209	002002	鸿达兴业	4,527,662.00	2.50
210	603001	奥康国际	4,478,620.36	2.48
211	600594	益佰制药	4,460,952.28	2.47
212	600276	恒瑞医药	4,409,110.66	2.44
213	000666	经纬纺机	4,275,846.18	2.36
214	600239	云南城投	4,234,613.00	2.34

215	600322	天房发展	4,188,888.00	2.32
216	000927	一汽夏利	3,982,652.00	2.20
217	002648	卫星石化	3,942,408.51	2.18
218	002153	石基信息	3,921,684.00	2.17
219	300273	和佳股份	3,912,012.00	2.16
220	300159	新研股份	3,909,281.00	2.16
221	600595	中孚实业	3,866,397.03	2.14
222	600207	安彩高科	3,859,657.00	2.13
223	300449	汉邦高科	3,845,712.81	2.13
224	000752	西藏发展	3,843,471.93	2.13
225	600681	万鸿集团	3,826,799.06	2.12
226	300319	麦捷科技	3,826,573.00	2.12
227	002025	航天电器	3,798,280.00	2.10
228	600111	北方稀土	3,783,375.00	2.09
229	002508	老板电器	3,732,548.00	2.06
230	600084	中葡股份	3,728,788.51	2.06
231	000030	富奥股份	3,678,014.96	2.03
232	000876	新希望	3,669,151.00	2.03

注：本项的"买入金额"均按买入成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

#### 8.4.2 累计卖出金额超期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600166	福田汽车	82,009,484.62	45.35
2	000338	潍柴动力	71,918,236.17	39.77
3	600499	科达洁能	63,722,050.42	35.23
4	601336	新华保险	60,852,604.56	33.65
5	002714	牧原股份	60,572,241.37	33.49
6	002157	正邦科技	60,296,783.58	33.34
7	002501	利源精制	58,234,094.00	32.20

8	600582	天地科技	57,066,783.80	31.55
9	600178	东安动力	56,771,493.34	31.39
10	300124	汇川技术	55,935,679.69	30.93
11	600418	江淮汽车	53,050,505.86	29.33
12	600309	万华化学	52,960,379.35	29.28
13	600741	华域汽车	51,457,054.43	28.45
14	601717	郑煤机	51,407,104.87	28.42
15	000625	长安汽车	49,995,318.70	27.64
16	601633	长城汽车	48,526,421.35	26.83
17	600660	福耀玻璃	46,376,351.67	25.64
18	002202	金风科技	45,469,408.02	25.14
19	002477	雏鹰农牧	45,414,128.56	25.11
20	000528	柳 工	45,073,531.54	24.92
21	601628	中国人寿	42,986,262.02	23.77
22	600104	上汽集团	41,796,453.12	23.11
23	002124	天邦股份	41,522,684.46	22.96
24	600702	沱牌舍得	41,451,525.39	22.92
25	002299	圣农发展	41,421,728.61	22.90
26	000860	顺鑫农业	40,468,115.38	22.38
27	600016	民生银行	39,801,816.65	22.01
28	600031	三一重工	39,489,158.99	21.84
29	300182	捷成股份	37,264,271.51	20.60
30	000680	山推股份	37,161,275.85	20.55
31	000581	威孚高科	36,967,281.30	20.44
32	002321	华英农业	35,515,109.98	19.64
33	000157	中联重科	35,439,368.77	19.60
34	002241	歌尔股份	34,859,765.45	19.28
35	600873	梅花生物	34,649,503.99	19.16
36	002304	洋河股份	31,653,034.61	17.50
37	601601	中国太保	30,508,011.74	16.87

38	000669	金鸿能源	30,027,177.20	16.60
39	600074	保千里	29,932,843.03	16.55
40	600751	天海投资	29,872,462.06	16.52
41	000596	古井贡酒	29,401,106.99	16.26
42	000951	中国重汽	28,293,915.59	15.64
43	300227	光韵达	28,089,347.35	15.53
44	000425	徐工机械	27,523,193.52	15.22
45	600805	悦达投资	27,016,160.09	14.94
46	600340	华夏幸福	25,517,896.60	14.11
47	300498	温氏股份	25,031,884.19	13.84
48	300012	华测检测	24,620,682.66	13.61
49	000815	美利云	24,489,823.45	13.54
50	600376	首开股份	24,135,614.10	13.35
51	600297	广汇汽车	23,674,116.13	13.09
52	600169	太原重工	23,533,142.55	13.01
53	600815	厦工股份	23,391,225.09	12.93
54	000001	平安银行	23,339,535.15	12.91
55	600515	海岛建设	23,214,032.99	12.84
56	000869	张裕A	23,136,645.72	12.79
57	002419	天虹商场	22,900,991.41	12.66
58	002646	青青稞酒	22,736,260.55	12.57
59	600266	北京城建	22,461,884.47	12.42
60	600093	禾嘉股份	22,215,713.52	12.28
61	600307	酒钢宏兴	21,948,761.07	12.14
62	002481	双塔食品	21,588,931.37	11.94
63	000401	冀东水泥	21,456,784.49	11.86
64	000858	五粮液	21,292,435.60	11.77
65	600478	科力远	20,764,700.31	11.48
66	600398	海澜之家	20,763,456.43	11.48
67	600433	冠豪高新	20,528,237.36	11.35

68	600519	贵州茅台	20,415,317.75	11.29
69	603369	今世缘	20,196,716.46	11.17
70	000727	华东科技	20,040,950.72	11.08
71	600919	江苏银行	19,912,388.44	11.01
72	002142	宁波银行	19,834,030.70	10.97
73	601965	中国汽研	19,178,277.79	10.60
74	600585	海螺水泥	17,808,260.69	9.85
75	002538	司尔特	17,782,213.87	9.83
76	002024	苏宁云商	17,681,263.83	9.78
77	601988	中国银行	17,409,931.61	9.63
78	601933	永辉超市	17,369,886.24	9.60
79	603338	浙江鼎力	17,067,391.79	9.44
80	600998	九州通	16,950,429.13	9.37
81	000039	中集集团	16,911,040.93	9.35
82	601818	光大银行	16,841,533.00	9.31
83	601318	中国平安	16,504,553.60	9.13
84	002267	陕天然气	16,147,968.19	8.93
85	000800	一汽轿车	15,760,128.40	8.71
86	601002	晋亿实业	15,719,464.99	8.69
87	002746	仙坛股份	15,646,135.32	8.65
88	601989	中国重工	15,518,752.51	8.58
89	600115	东方航空	15,483,215.60	8.56
90	601069	西部黄金	15,365,520.20	8.50
91	600036	招商银行	15,052,457.69	8.32
92	600026	中海发展	14,938,059.99	8.26
93	600975	新五丰	14,557,621.95	8.05
94	600963	岳阳林纸	14,531,494.11	8.04
95	600559	老白干酒	14,496,240.31	8.02
96	601169	北京银行	14,391,916.01	7.96
97	000793	华闻传媒	14,310,591.04	7.91

98	600015	华夏银行	13,357,097.92	7.39
99	601998	中信银行	13,229,820.13	7.32
100	000568	泸州老窖	13,185,114.68	7.29
101	002294	信立泰	13,163,129.76	7.28
102	300479	神思电子	12,993,743.45	7.18
103	300017	网宿科技	12,919,852.02	7.14
104	600584	长电科技	12,777,940.29	7.07
105	600000	浦发银行	12,696,600.98	7.02
106	600325	华发股份	12,612,052.90	6.97
107	600489	中金黄金	12,525,436.93	6.93
108	600062	华润双鹤	12,462,564.04	6.89
109	002559	亚威股份	12,326,357.54	6.82
110	000848	承德露露	12,000,559.26	6.64
111	601009	南京银行	11,992,778.83	6.63
112	600655	豫园商城	11,748,268.69	6.50
113	000046	泛海控股	11,631,289.03	6.43
114	600009	上海机场	11,313,879.13	6.26
115	002327	富安娜	11,311,803.71	6.25
116	002146	荣盛发展	11,258,018.80	6.22
117	000550	江铃汽车	11,017,437.96	6.09
118	601198	东兴证券	10,934,293.18	6.05
119	002535	林州重机	10,913,089.95	6.03
120	603686	龙马环卫	10,836,261.00	5.99
121	000831	*ST五稀	10,727,080.88	5.93
122	600617	国新能源	10,720,576.61	5.93
123	601111	中国国航	10,423,055.16	5.76
124	600029	南方航空	10,414,423.53	5.76
125	600197	伊力特	10,301,477.60	5.70
126	002665	首航节能	10,295,037.88	5.69
127	000886	海南高速	10,266,915.28	5.68

128	000983	西山煤电	10,262,195.58	5.67
129	002727	一心堂	10,116,396.99	5.59
130	000026	飞亚达 A	10,106,597.53	5.59
131	601888	中国国旅	10,057,575.70	5.56
132	600779	*ST水井	9,920,652.45	5.49
133	000980	金马股份	9,909,408.90	5.48
134	000606	神州易桥	9,835,341.05	5.44
135	002234	民和股份	9,591,743.30	5.30
136	300100	双林股份	9,538,179.34	5.27
137	601608	中信重工	9,389,473.79	5.19
138	601939	建设银行	9,244,659.32	5.11
139	000065	北方国际	9,180,028.02	5.08
140	600547	山东黄金	9,055,038.90	5.01
141	600477	杭萧钢构	8,997,666.79	4.98
142	600295	鄂尔多斯	8,995,719.96	4.97
143	600984	*ST建机	8,993,968.18	4.97
144	601088	中国神华	8,952,673.56	4.95
145	600338	西藏珠峰	8,733,808.33	4.83
146	600881	亚泰集团	8,639,933.71	4.78
147	000823	超声电子	8,536,403.00	4.72
148	002298	中电鑫龙	8,502,078.68	4.70
149	000937	冀中能源	8,298,102.11	4.59
150	601985	中国核电	8,262,443.00	4.57
151	601238	广汽集团	8,215,425.00	4.54
152	601233	桐昆股份	8,187,396.92	4.53
153	000572	海马汽车	8,177,315.67	4.52
154	600405	动力源	8,126,918.44	4.49
155	601106	中国一重	8,105,337.00	4.48
156	300098	高新兴	8,054,565.26	4.45
157	002751	易尚展示	8,025,945.44	4.44



158	600221	海南航空	7,997,310.00	4.42
159	601021	春秋航空	7,983,633.46	4.41
160	600136	当代明诚	7,894,686.12	4.37
161	600495	晋西车轴	7,787,022.13	4.31
162	600558	大西洋	7,608,427.20	4.21
163	002236	大华股份	7,587,850.41	4.20
164	600809	山西汾酒	7,535,067.20	4.17
165	002434	万里扬	7,527,482.19	4.16
166	002078	太阳纸业	7,500,733.50	4.15
167	601168	西部矿业	7,439,153.60	4.11
168	600518	康美药业	7,380,254.17	4.08
169	002292	奥飞娱乐	7,319,142.33	4.05
170	600320	振华重工	7,287,874.26	4.03
171	002371	北方华创	7,251,877.41	4.01
172	300036	超图软件	7,245,789.22	4.01
173	002097	山河智能	7,211,510.81	3.99
174	002568	百润股份	7,158,150.51	3.96
175	002456	欧菲光	7,108,420.59	3.93
176	002180	艾派克	7,084,655.89	3.92
177	600118	中国卫星	6,808,634.87	3.76
178	002320	海峡股份	6,745,877.06	3.73
179	000952	广济药业	6,686,999.48	3.70
180	601678	滨化股份	6,625,623.04	3.66
181	002103	广博股份	6,519,713.40	3.60
182	603885	吉祥航空	6,345,072.54	3.51
183	300257	开山股份	6,331,804.30	3.50
184	002458	益生股份	6,259,389.84	3.46
185	601688	华泰证券	6,187,693.88	3.42
186	300103	达刚路机	6,031,376.28	3.33
187	600109	国金证券	6,016,970.27	3.33

188	600395	盘江股份	5,948,264.66	3.29
189	002573	清新环境	5,945,231.42	3.29
190	603589	口子窖	5,827,279.91	3.22
191	002427	尤夫股份	5,767,380.63	3.19
192	601139	深圳燃气	5,622,867.05	3.11
193	601668	中国建筑	5,592,335.00	3.09
194	600348	阳泉煤业	5,566,723.84	3.08
195	000418	小天鹅 A	5,371,650.31	2.97
196	002051	中工国际	5,081,567.48	2.81
197	002032	苏泊尔	5,081,005.58	2.81
198	600343	航天动力	5,052,740.49	2.79
199	600692	亚通股份	4,978,462.60	2.75
200	600207	安彩高科	4,919,468.14	2.72
201	300236	上海新阳	4,906,047.94	2.71
202	600879	航天电子	4,901,053.45	2.71
203	000333	美的集团	4,843,638.62	2.68
204	601117	中国化学	4,825,770.10	2.67
205	002191	劲嘉股份	4,825,409.77	2.67
206	600276	恒瑞医药	4,808,750.98	2.66
207	600594	益佰制药	4,437,690.00	2.45
208	603001	奥康国际	4,411,983.16	2.44
209	600322	天房发展	4,379,824.30	2.42
210	002002	鸿达兴业	4,371,153.20	2.42
211	000666	经纬纺机	4,361,297.85	2.41
212	300197	铁汉生态	4,343,534.12	2.40
213	002429	兆驰股份	4,335,076.60	2.40
214	002480	新筑股份	4,235,806.88	2.34
215	300449	汉邦高科	4,214,356.00	2.33
216	300159	新研股份	4,145,421.80	2.29
217	600084	中葡股份	4,126,194.21	2.28

218	002344	海宁皮城	4,107,069.62	2.27
219	600239	云南城投	4,091,568.46	2.26
220	300273	和佳股份	4,085,016.05	2.26
221	002025	航天电器	4,079,798.70	2.26
222	000799	酒鬼酒	4,072,872.50	2.25
223	002153	石基信息	3,976,297.08	2.20
224	002508	老板电器	3,951,527.63	2.18
225	300319	麦捷科技	3,927,022.00	2.17
226	000938	紫光股份	3,924,404.16	2.17
227	600369	西南证券	3,918,334.54	2.17
228	600111	北方稀土	3,893,800.20	2.15
229	600595	中孚实业	3,846,679.22	2.13
230	000752	西藏发展	3,825,238.31	2.12
231	000927	一汽夏利	3,772,196.86	2.09
232	000558	莱茵体育	3,750,908.95	2.07
233	002156	通富微电	3,745,615.91	2.07
234	000876	新希望	3,719,852.79	2.06

注：本项“卖出金额”均按卖出成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	4,822,694,730.34
卖出股票的收入（成交）总额	4,223,976,303.56

注：本项“买入股票成本”、“卖出股票收入”均按买卖成交金额（成交单价乘以成交数量）填列，不考虑相关交易费用。

### 8.5 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。

### 8.6 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。

### 8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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。

### 8.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

### 8.9 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。

### 8.10 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。

### 8.11 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。

### 8.12 投资组合报告附注

#### 8.12.1

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。

#### 8.12.2

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。

#### 8.12.3 期末其他各项资产构成

金额单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,029,334.80
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	62,997.63
5	应收申购款	4,055,853.76
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—

9	合计	5,148,186.19
---	----	--------------

#### 8.12.4 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。

#### 8.12.5 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不存在流通受限情况。

#### 8.12.6 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。

### § 9 基金份额持有人信息

#### 9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有 份额	占总份 额比例	持有 份额	占总份 额比例
575,238	823.18	150,114,665.95	31.70%	323,411,379.49	68.30%

#### 9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	572,543.93	0.12%

#### 9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

本基金本报告期末未有本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人及基金经理持有本开放式基金份额的情况。

### § 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2008年12月2日)基金份额总额	291,108,692.74
---------------------------	----------------

本报告期期初基金份额总额	115,596,935.37
本报告期基金总申购份额	654,163,494.54
减：本报告期基金总赎回份额	296,234,384.47
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	473,526,045.44

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。

## § 11 重大事件揭示

### 11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会决议。

### 11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，宁辰、张磊先生已离任本公司副总经理职务，具体信息请参见基金管理人于2016年4月30日和2016年7月2日披露的《天弘基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。

本报告期内基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

### 11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有发生涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

### 11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略没有改变。

### 11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内应向普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）支付服务费6万元。截至本报告期末，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）已为本基金提供审计服务8年。

### 11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

本报告期内本基金管理人、托管人及其高级管理人员没有发生受稽查或处罚的情况。

### 11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

#### 11.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占股票成交总额比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
渤海证券	1	749,027,040.44	8.28%	697,570.65	8.55%	
光大证券	2	1,753,418,254.64	19.38%	1,632,967.02	20.02%	
国泰君安	2	1,331,793,570.42	14.72%	973,942.05	11.94%	
民生证券	1	1,611,643,459.01	17.82%	1,500,926.02	18.40%	
平安证券	1	164,489,979.63	1.82%	153,190.20	1.88%	
招商证券	2	3,105,714,404.43	34.33%	2,892,354.14	35.45%	
中银国际	1	329,888,138.83	3.65%	307,224.07	3.77%	

### 11.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占债券成交总额比例	成交金额	占债券回购成交总额比例	成交金额	占权证成交总额比例
渤海证券	—	—	—	—	—	—
光大证券	—	—	—	—	—	—
国泰君安	—	—	—	—	—	—
民生证券	—	—	—	—	—	—
平安证券	—	—	—	—	—	—
招商证券	—	—	40,000,000.00	100.00%	—	—
中银国际	—	—	—	—	—	—

注：1、基金专用交易单元的选择标准为：该证券经营机构财务状况良好，各项财务指标显示公司经营情况稳定；经营行为规范，内控制度健全，最近两年未因重大违规行为受到监管机关的处罚；研究实力较强，能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、市场分析报告、行业研究报告、个股分析报告及全面的信息服务；

2、基金专用交易单元的选择程序：本基金管理人根据上述标准进行考察后，确定选用交易席位的证券经营机构。然后基金管理人和被选用的证券经营机构签订交易席位租用协议；

3、本期新租用交易单元5个，其中包括：光大证券深圳交易单元1个、天风证券上海交易单元1个、天风证券深圳交易单元1个、国泰君安证券上海交易单元1个、国泰君安证券深圳交易单元1个；

4、本基金报告期内停止租用交易单元：无。

### 11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	天弘基金管理有限公司关于2016年1月4日指数熔断期间调整旗下部分基金开放时间的公告	中国证监会指定媒介	2016-01-04
2	天弘基金管理有限公司关于旗下基金所持“城投控股”、“江苏吴中”、“清新环境”估值方法调整的提示性公告	中国证监会指定媒介	2016-01-05
3	天弘基金管理有限公司关于旗下基金所持“金证股份”、“东华软件”估值方法调整的提示性公告	中国证监会指定媒介	2016-01-06
4	天弘基金管理有限公司关于在指数熔断实施期间调整旗下交易所场内基金开放时间的公告	中国证监会指定媒介	2016-01-06
5	天弘基金管理有限公司关于2016年1月7日指数熔断期间调整旗下部分基金开放时间的公告	中国证监会指定媒介	2016-01-07
6	天弘基金管理有限公司关于旗下基金所持部分股票估值方法调整的提示性公告	中国证监会指定媒介	2016-01-08
7	天弘基金管理有限公司关于旗下基金所持“新文化”估值方法调	中国证监会指定媒介	2016-01-09



	整的提示性公告		
8	天弘基金管理有限公司关于旗下基金所持部分股票估值方法调整的提示性公告	中国证监会指定媒介	2016-01-12
9	天弘基金管理有限公司关于增加上海汇付金融服务有限公司为旗下基金代销机构并开通定投及转换业务以及参加其相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-01-12
10	天弘基金管理有限公司关于旗下基金所持“海格通信”、“唐山港”估值方法调整的提示性公告	中国证监会指定媒介	2016-01-13
11	天弘基金管理有限公司关于增加深圳市新兰德证券投资咨询有限公司为旗下基金代销机构并开通定投及转换业务以及参加其相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-01-14
12	天弘基金管理有限公司关于旗下基金所持“旋极信息”、“互动娱乐”、“亚太股份”估值方法调整的提示性公告	中国证监会指定媒介	2016-01-14
13	天弘永定价值成长混合型证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会指定媒介	2016-01-15
14	天弘永定价值成长混合型证券投资基金招募说明书（更新）摘要	中国证监会指定媒介	2016-01-15
15	天弘基金管理有限公司关于旗下基金所持“众信旅游”估值方法调整的提示性公告	中国证监会指定媒介	2016-01-16
16	天弘基金管理有限公司关于增加中经北证（北京）资产管理有限公司为旗下基金代销机构并开通定投及转换业务以及参加其相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-01-20

17	天弘基金管理有限公司关于增加上海利得基金销售有限公司为旗下基金代销机构以及参加其相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-01-22
18	天弘永定价值成长混合型证券投资基金2015年第4季度报告	中国证监会指定媒介	2016-01-22
19	天弘基金管理有限公司关于旗下基金所持部分股票估值方法调整的提示性公告	中国证监会指定媒介	2016-01-27
20	天弘基金管理有限公司关于旗下基金所持部分股票估值方法调整的提示性公告	中国证监会指定媒介	2016-01-28
21	天弘基金管理有限公司关于对使用余额宝支付功能申购的投资者开展费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-01-28
22	天弘基金管理有限公司关于旗下基金所持部分股票估值方法调整的提示性公告	中国证监会指定媒介	2016-01-29
23	天弘基金管理有限公司关于旗下基金所持“微创股份”、“首航节能”估值方法调整的提示性公告	中国证监会指定媒介	2016-02-05
24	天弘基金管理有限公司关于旗下基金所持“浦发银行”估值方法调整的提示性公告	中国证监会指定媒介	2016-02-17
25	天弘基金管理有限公司关于旗下基金所持“信威集团”估值方法调整的提示性公告	中国证监会指定媒介	2016-02-23
26	天弘基金管理有限公司关于增加深圳富济财富管理有限公司为旗下基金代销机构并开通定投及转换业务以及参加其相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-02-24

27	天弘基金管理有限公司关于对使用“财富通”银联支付渠道进行申（认）购的投资者开展费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-02-24
28	天弘基金管理有限公司关于旗下基金所持“慈文传媒”、“正邦科技”估值方法调整的提示性公告	中国证监会指定媒介	2016-02-26
29	天弘基金管理有限公司关于旗下基金所持“捷成股份”估值方法调整的提示性公告	中国证监会指定媒介	2016-02-27
30	天弘基金管理有限公司关于旗下基金所持“万达院线”、“泰格医药”估值方法调整的提示性公告	中国证监会指定媒介	2016-03-01
31	天弘基金管理有限公司关于提醒客户谨防虚假客服电话诈骗的风险提示公告	中国证监会指定媒介	2016-03-05
32	天弘基金管理有限公司关于对使用余额宝支付功能申（认）购的投资者开展费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-03-09
33	天弘基金管理有限公司关于增加上海中正达广投资管理有限公司为旗下基金代销机构并开通定投及转换业务以及参加其相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-03-11
34	天弘基金管理有限公司关于增加大泰金石投资管理有限公司为旗下基金代销机构并开通转换业务以及参加其相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-03-17
35	天弘基金管理有限公司关于增加浙江金观诚财富管理有限公司为	中国证监会指定媒介	2016-03-18

	旗下基金代销机构并开通定投及转换业务以及参加其相关费率优惠活动的公告		
36	天弘基金管理有限公司关于旗下基金所持“科大讯飞”估值方法调整的提示性公告	中国证监会指定媒介	2016-03-19
37	天弘基金管理有限公司关于旗下基金所持“四维图新”估值方法调整的提示性公告	中国证监会指定媒介	2016-03-22
38	天弘永定价值成长混合型证券投资基金2015年年度报告	中国证监会指定媒介	2016-03-30
39	天弘永定价值成长混合型证券投资基金2015年年度报告摘要	中国证监会指定媒介	2016-03-30
40	天弘基金管理有限公司关于旗下基金继续参加中国工商银行股份有限公司申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-03-31
41	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金参加深圳市新兰德证券投资咨询有限公司申购及定投费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-04-01
42	天弘基金管理有限公司关于增加上海联泰资产管理有限公司为旗下基金代销机构并开通定投及转换业务以及参加其相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-04-01
43	天弘基金管理有限公司关于旗下基金所持“牧原股份”估值方法调整的提示性公告	中国证监会指定媒介	2016-04-06
44	天弘基金管理有限公司广州分公司关于营业场所变更的公告	中国证监会指定媒介	2016-04-07
45	天弘基金管理有限公司关于增加北京新浪仓石基金销售有限公司	中国证监会指定媒介	2016-04-15

	为旗下基金代销机构以及参加其相关费率优惠活动的公告		
46	天弘基金管理有限公司关于增加北京懒猫金融信息服务有限公司为旗下部分基金代销机构的公告	中国证监会指定媒介	2016-04-21
47	天弘永定价值成长混合型证券投资基金2016年第1季度报告	中国证监会指定媒介	2016-04-21
48	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会指定媒介	2016-04-23
49	天弘基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会指定媒介	2016-04-30
50	天弘基金管理有限公司关于旗下基金所持“泸州老窖”估值方法调整的提示性公告	中国证监会指定媒介	2016-05-04
51	天弘基金管理有限公司关于参加中证金牛（北京）投资咨询有限公司相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-05-09
52	天弘基金管理有限公司关于旗下基金所持“电广传媒”、“万家文化”估值方法调整的提示性公告	中国证监会指定媒介	2016-05-10
53	天弘基金管理有限公司关于开展指定基金份额转换业务费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-05-18
54	天弘基金管理有限公司关于旗下基金参加杭州数米基金销售有限公司（认）申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-05-30
55	天弘基金管理有限公司关于增加北京蛋卷基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构并开通定投及转换业务以及参加其相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-05-30
56	天弘基金管理有限公司关于增加	中国证监会指定媒介	2016-06-16

	北京广源达信投资管理有限公司为旗下基金销售机构并开通转换业务以及参加其相关费率优惠活动的公告		
57	天弘基金管理有限公司关于增加泰信财富投资管理有限公司为旗下基金销售机构并开通转换业务以及参加其相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-06-20
58	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金在新浪仓石开通定投业务的公告	中国证监会指定媒介	2016-06-22
59	天弘基金管理有限公司关于在网上交易系统开通易宝支付的第三方支付业务并实施申购费率优惠的公告	中国证监会指定媒介	2016-06-24
60	天弘基金管理有限公司关于旗下基金参加交通银行股份有限公司申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-06-30
61	天弘基金管理有限公司旗下基金2016年6月30日基金资产净值公告	中国证监会指定媒介	2016-07-01
62	天弘基金管理有限公司关于旗下基金在陆金所资管开通定投业务并参与其费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-07-01
63	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会指定媒介	2016-07-02
64	天弘基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会指定媒介	2016-07-02
65	天弘基金管理有限公司关于增加深圳前海凯恩斯基金销售有限公司为旗下基金销售机构并开通定投及转换业务以及参加其相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-07-11

66	天弘基金管理有限公司关于旗下基金所持“格力电器”估值方法调整的提示性公告	中国证监会指定媒介	2016-07-13
67	天弘基金管理有限公司关于旗下基金参加交通银行股份有限公司（认）申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-07-16
68	天弘永定价值成长混合型证券投资基金招募说明书（更新）摘要	中国证监会指定媒介	2016-07-16
69	天弘永定价值成长混合型证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会指定媒介	2016-07-16
70	天弘基金管理有限公司关于旗下部分基金在大同证券开通定投及转换业务的公告	中国证监会指定媒介	2016-07-19
71	天弘永定价值成长混合型证券投资基金2016年第2季度报告	中国证监会指定媒介	2016-07-19
72	天弘基金管理有限公司关于增加上海万得投资顾问有限公司为旗下部分基金销售机构并开通定投及转换业务以及参加其费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-07-29
73	天弘基金管理有限公司关于对通过大树财富移动客户端银联网络支付渠道进行申（认）购的投资者开展费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-08-02
74	天弘基金管理有限公司关于旗下基金所持“万泽股份”估值方法调整的提示性公告	中国证监会指定媒介	2016-08-10
75	天弘基金管理有限公司关于旗下基金所持“城投控股”估值方法调整的提示性公告	中国证监会指定媒介	2016-08-13
76	天弘永定价值成长混合型证券投资基金2016年半年度报告摘要	中国证监会指定媒介	2016-08-29
77	天弘永定价值成长混合型证券投资	中国证监会指定媒介	2016-08-29

	资基金2016年半年度报告		
78	天弘基金管理有限公司关于增加北京肯特瑞财富投资管理有限公司为旗下基金销售机构并开通申购、赎回、转换业务以及参加其相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-08-31
79	天弘基金管理有限公司关于增加众升财富（北京）基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、转换及定投业务以及参加其相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-09-06
80	天弘基金管理有限公司关于增加奕丰金融服务（深圳）有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、转换及定投业务以及参加其相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-09-06
81	天弘基金管理有限公司关于增加北京汇成基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、转换及定投业务以及参加其相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-09-06
82	天弘基金管理有限公司关于增加北京晟视天下投资管理有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、转换业务以及参加其相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-09-07
83	天弘基金管理有限公司关于参加交通银行手机银行基金申购及定投手续费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-09-20
84	天弘基金管理有限公司关于增加天津农村商业银行股份有限公司为旗下部分基金销售机构并开通	中国证监会指定媒介	2016-09-21



	定投业务的公告		
85	天弘基金管理有限公司关于旗下基金所持“伊利股份”估值方法调整的提示性公告	中国证监会指定媒介	2016-10-11
86	天弘基金管理有限公司关于增加宜信普泽投资顾问（北京）有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投及转换业务以及参加其相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-10-17
87	天弘基金管理有限公司关于增加北京格上富信投资顾问有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投及转换业务以及参加其相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-10-17
88	天弘基金管理有限公司关于增加北京广源达信投资管理有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投及转换业务以及参加其相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-10-24
89	天弘永定价值成长混合型证券投资基金2016年第3季度报告	中国证监会指定媒介	2016-10-26
90	天弘基金管理有限公司关于对使用余额宝支付功能申购旗下部分基金的投资者开展申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-11-08
91	天弘基金管理有限公司关于增加凤凰金信（银川）投资管理有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投及转换业务以及参加其相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-11-11

92	天弘基金管理有限公司关于增加上海基煜基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回及转换业务以及参加其相关费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-11-18
93	天弘基金管理有限公司关于增加上海华信证券有限责任公司为旗下部分基金销售机构的公告	中国证监会指定媒介	2016-11-23
94	天弘基金管理有限公司关于降低天弘永定价值成长混合型证券投资基金申购、赎回及最低持有份额等相关业务限额的公告	中国证监会指定媒介	2016-11-25
95	天弘基金管理有限公司关于增加申银万国期货有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回业务以及参加其申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-11-29
96	天弘基金管理有限公司关于参加交通银行手机银行基金申购及定投手续费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-11-29
97	天弘基金管理有限公司关于在网上交易系统开通浦发银行快捷支付业务并实施申购费率优惠的公告	中国证监会指定媒介	2016-12-01
98	天弘基金管理有限公司关于增加北京植信基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回业务以及参加其申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-12-06
99	天弘基金管理有限公司关于增加乾道金融信息服务（北京）有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投业务以及	中国证监会指定媒介	2016-12-09

	参加其申购费率优惠活动的公告		
100	天弘基金管理有限公司关于增加深圳市金斧子投资咨询有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投、转换业务以及参加其申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-12-12
101	天弘基金管理有限公司关于增加上海凯石财富基金销售有限公司为旗下部分基金销售机构并开通申购、赎回、定投及转换业务以及参加其申购费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-12-14
102	天弘基金管理有限公司关于参加交通银行手机银行基金申购及定投手续费率优惠活动的公告	中国证监会指定媒介	2016-12-22
103	天弘基金管理有限公司旗下基金2016年12月30日基金资产净值公告	中国证监会指定媒介	2016-12-30
104	天弘基金管理有限公司旗下基金2016年12月31日基金资产净值公告	中国证监会指定媒介	2016-12-31

## § 12 备查文件目录

### 12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准天弘永定价值成长股票型证券投资基金募集的文件
- 2、天弘永定价值成长混合型证券投资基金基金合同
- 3、天弘永定价值成长混合型证券投资基金托管协议
- 4、天弘永定价值成长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

### 12.2 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

### 12.3 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](http://www.thfund.com.cn)

天弘基金管理有限公司

二〇一七年三月三十日