

天弘鑫安宝保本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                         | 6  |
| 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                | 7  |
| 3.1 | 主要会计数据和财务指标                         | 7  |
| 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合规守信情况的说明              | 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             | 13 |
| 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                 | 14 |
| 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                 | 16 |
| 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       | 16 |
| §5  | 托管人报告                               | 16 |
| 5.1 | 报告期内本基金托管人合规守信情况声明                  | 16 |
| 5.2 | 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、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                           | 17 |
| §7  | 年度财务报表                              | 18 |
| 7.1 | 资产负债表                               | 18 |
| 7.2 | 利润表                                 | 20 |
| 7.3 | 所有者权益（基金净值）变动表                      | 21 |
| 7.4 | 报表附注                                | 23 |
| §8  | 投资组合报告                              | 50 |
| 8.1 | 期末基金资产组合情况                          | 50 |
| 8.2 | 报告期末按行业分类的股票投资组合                    | 50 |
| 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       | 51 |
| 8.4 | 报告期内股票投资组合的重大变动                     | 52 |
| 8.5 | 期末按债券品种分类的债券投资组合                    | 54 |
| 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      | 54 |
| 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   | 55 |
| 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   | 55 |
| 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      | 55 |

|      |                              |    |
|------|------------------------------|----|
| 8.10 | 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明         | 55 |
| 8.11 | 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明         | 55 |
| 8.12 | 投资组合报告附注                     | 55 |
| §9   | 基金份额持有人信息                    | 56 |
| 9.1  | 期末基金份额持有人户数及持有人结构            | 56 |
| 9.2  | 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况         | 56 |
| 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 | 57 |
| §10  | 开放式基金份额变动                    | 57 |
| §11  | 重大事件揭示                       | 57 |
| 11.1 | 基金份额持有人大会决议                  | 57 |
| 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  | 57 |
| 11.3 | 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼       | 57 |
| 11.4 | 基金投资策略的改变                    | 58 |
| 11.5 | 为基金进行审计的会计师事务所情况             | 58 |
| 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     | 58 |
| 11.7 | 基金租用证券公司交易单元的有关情况            | 58 |
| 11.8 | 其他重大事件                       | 59 |
| §12  | 备查文件目录                       | 61 |
| 12.1 | 备查文件目录                       | 61 |
| 12.2 | 存放地点                         | 61 |
| 12.3 | 查阅方式                         | 62 |

## § 2 基金简介

### 2.1 基金基本情况

|            |                    |
|------------|--------------------|
| 基金名称       | 天弘鑫安宝保本混合型证券投资基金   |
| 基金简称       | 天弘鑫安宝保本混合          |
| 基金主代码      | 001486             |
| 基金运作方式     | 契约型开放式，以定期开放的方式运作。 |
| 基金合同生效日    | 2015年10月23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 | 739,354,674.96份    |
| 基金合同存续期    | 不定期                |

### 2.2 基金产品说明

|        |  |
|--------|--|
| 投资目标   | 本基金将综合运用投资组合保险策略，严格控制风险，在为投资人提供投资金额安全保证的基础上力争实现基金资产的稳定增值。  |
| 投资策略   | 在投资策略方面，本基金将主要采用恒定比例组合保本策略（CPPI, Constant Proportion Portfolio Insurance），以数量化的分析模型为基础，通过动态地监控和调整基金在安全资产与风险资产上的投资比例，确保基金投资组合的风险暴露水平不超过基金可承担的损失限额（又称安全垫），以实现确保保本周期到期时本金安全的目标。同时，本基金通过积极稳健的股票投资策略，为基金实现资本增值。具体而言，本基金的投资策略包括大类资产配置策略、安全资产投资策略和风险资产投资策略。 |
| 业绩比较基准 | 本基金的业绩比较基准为：（一年期银行定期存款利率（税后）+0.5%）×2。  |
| 风险收益特征 | 本基金为保本混合型基金产品，属证券投资基金中的低风险品种，其预期风险与预期收益率低于股票型基   |

|  |                             |
|--|-----------------------------|
|  | 金、非保本的混合型基金，高于货币市场基金和债券型基金。 |
|--|-----------------------------|

### 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) | 中国上海市湖滨路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 |
| 基金保证人  | 瀚华担保股份有限公司 | 北京市朝阳区东三环中路1号环球金融中心东塔13F    |

### § 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10月23日-2015年12月31日 |
|---------------|----------------|-------------------------|
| 本期已实现收益       | 36,211,270.16  | 3,995,556.04            |
| 本期利润          | 22,445,449.33  | 6,541,201.59            |
| 加权平均基金份额本期利润  | 0.0304         | 0.0088                  |
| 本期加权平均净值利润率   | 2.95%          | 0.88%                   |
| 本期基金份额净值增长率   | 3.01%          | 0.88%                   |
| 3.1.2 期末数据和指标 | 2016年末         | 2015年末                  |
| 期末可供分配利润      | 28,986,650.92  | 3,995,556.04            |
| 期末可供分配基金份额利润  | 0.0392         | 0.0054                  |
| 期末基金资产净值      | 768,341,325.88 | 745,895,876.55          |
| 期末基金份额净值      | 1.0392         | 1.0088                  |
| 3.1.3 累计期末指标  | 2016年末         | 2015年末                  |
| 基金份额累计净值增长率   | 3.92%          | 0.88%                   |

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。

4、本基金《基金合同》2015年10月23日起生效。

#### 3.2 基金净值表现

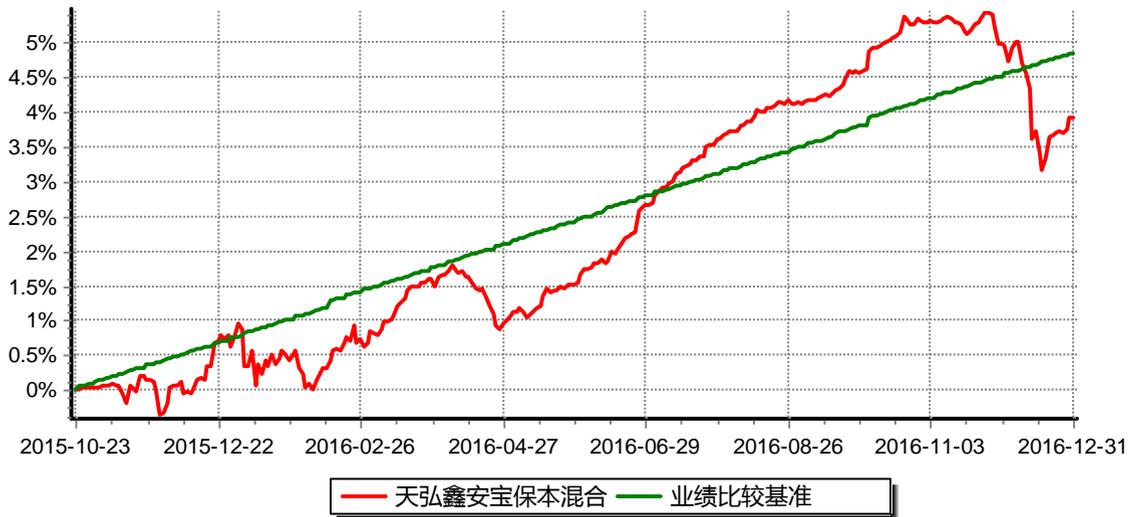
##### 3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

| 阶段 | 份额净 | 份额净 | 业绩比 | 业绩比 | ①-③ | ②-④ |
|----|-----|-----|-----|-----|-----|-----|
|----|-----|-----|-----|-----|-----|-----|

|                                      | 值增长率①  | 值增长率标准差② | 较基准收益率③ | 较基准收益率标准差④ |        |       |
|--------------------------------------|--------|----------|---------|------------|--------|-------|
| 过去三个月                                | -0.68% | 0.14%    | 0.98%   | 0.01%      | -1.66% | 0.13% |
| 过去六个月                                | 1.22%  | 0.10%    | 1.99%   | 0.01%      | -0.77% | 0.09% |
| 过去一年                                 | 3.01%  | 0.11%    | 4.04%   | 0.01%      | -1.03% | 0.10% |
| 自基金合同生效日起至今（2015年10月23日-2016年12月31日） | 3.92%  | 0.11%    | 4.85%   | 0.01%      | -0.93% | 0.10% |

注：天弘鑫安宝保本混合基金的业绩比较基准为： $(\text{一年期银行定期存款利率（税后）} + 0.5\%) \times 2$ 。上述“一年期银行定期存款税后收益率”指当期保本周期起始日（若为第一个保本周期，则为基金合同生效日）中国人民银行公布并执行的一年期金融机构人民币存款基准税后利率。

### 3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

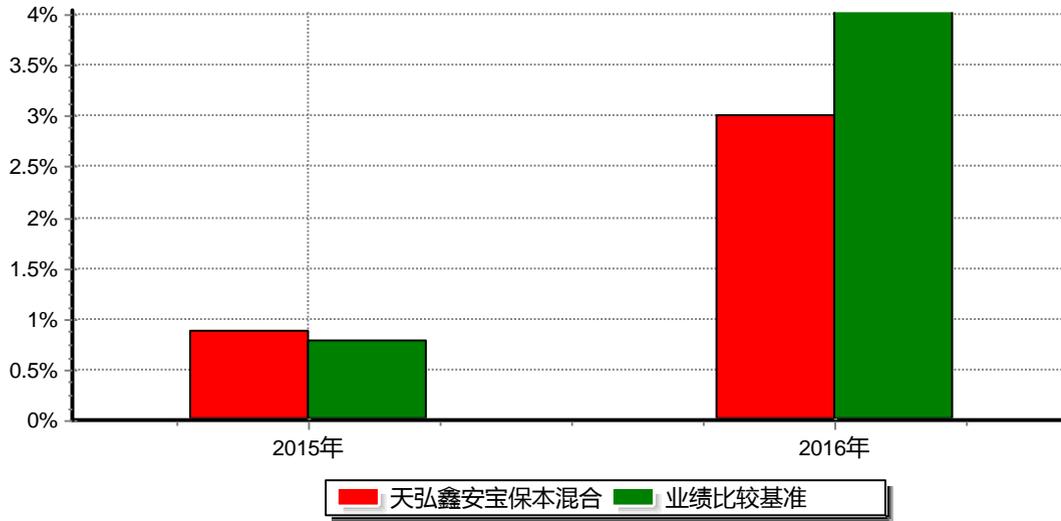


注：1、本基金《基金合同》于2015年10月23日生效。

2、本基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。本基金的建仓期为2015年10月23日-2016年4月23日，建仓期结束时，各项资产配置比例均符合基金合同的约定。

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



注：本基金合同于2015年10月23日生效，本基金合同生效当年2015年的净值增长率按照基金合同生效后当年的实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

### 3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金于2015年10月23日成立。本基金自基金合同生效以来无利润分配情况，符合相关法规及基金合同的规定。

## § 4 管理人报告

### 4.1 基金管理人及基金经理情况

#### 4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

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

|                      |      |
|----------------------|------|
| 伙)                   |      |
| 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 |        |   |
| 陈钢  | 本基金基金经理；本公司副总经理、固定收益总监兼固定收益部总经理。 | 2015年10月        | —    | 14年    | 男，工商管理硕士。历任华龙证券公司固定收益部高级经理；北京宸星投资管理公司投资经理；兴业证券公司债券总部研究部经理；银华基金管理有限公司机构理财部高级经理；中国人寿资产管理有限公司固定收益部高级投资经理。2011年7月加盟本公司。 |
| 钱文成 | 本基金基金经理。                         | 2015年10月        | —    | 10年    | 男，理学硕士。2007年5月加盟本公司，历任行业研究员、高级研究员、策略研究员、研究主管助理、研究部副主管、研究副总监、研究总监、股票投资部副总经理、基金经理助理等。                                 |

注：1、上述任职日期为基金合同生效日。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

#### 4.2 管理人对报告期内本基金运作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，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，总体以债券仓位为主，以稳健风格进行投资，同时根据对股市判断严格控制权益仓位进行投资，充分把握和参与权益市场的机会，为客户创造了较高的稳健收益。

##### 4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2016年12月31日，本基金份额净值为1.0392元，本报告期份额净值增长率3.01%，同期业绩比较基准增长率4.04%。

#### 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 and 抑制资产泡沫。

对于债券市场未来的看法，我们认为在基本面向下拐点出现之前，债券市场将维持区间波动的态势，票息收益仍然是债券市场最具有确定性的收益来源。未来收益率有一定的下行空间，但是由于政策边际紧缩以及债市交易结构的不稳定性，未来债市仍将面临一定的波动，整体走势可能是前高后低。

投资策略上，本基金将继续以债券仓位为主，采取短久期和中低杠杆水平运作，同时适当精选个股参与二级市场的机会，继续为客户贡献稳健正收益。

#### 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20816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      | 天弘鑫安宝保本混合型证券投资基金全体基金份额持有人  |
| 引言段          | <p>我们审计了后附的天弘鑫安宝保本混合型证券投资基金(以下简称“天弘鑫安宝保本混合基金”)的财务报表,包括2016年12月31日的资产负债表、2016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>   |
| 管理层对财务报表的责任段 | <p>编制和公允列报财务报表是天弘鑫安宝保本混合基金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>   |
| 注册会计师的责任段    | <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</p> |

|           |   |
|-----------|---|
|           | 的合理性，以及评价财务报表的总体列报。<br>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。  |
| 审计意见段     | 我们认为，上述天弘鑫安宝保本混合基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了天弘鑫安宝保本混合基金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。 |
| 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：天弘鑫安宝保本混合型证券投资基金

报告截止日：2016年12月31日

单位：人民币元

| 资 产         | 附注号     | 本期末<br>2016年12月31日 | 上年度末<br>2015年12月31日 |
|-------------|---------|--------------------|---------------------|
| <b>资 产：</b> |         |                    |                     |
| 银行存款        | 7.4.7.1 | 20,346,730.14      | 3,937,673.39        |
| 结算备付金       |         | 14,092.29          | 503,491.52          |
| 存出保证金       |         | 71,572.15          | 24,700.52           |
| 交易性金融资产     | 7.4.7.2 | 856,947,894.03     | 448,070,856.72      |
| 其中：股票投资     |         | 67,029,505.63      | 56,381,549.52       |
| 基金投资        |         | —                  | —                   |
| 债券投资        |         | 789,918,388.40     | 391,689,307.20      |
| 资产支持证券投资    |         | —                  | —                   |

|                 |            |                            |                             |
|-----------------|------------|----------------------------|-----------------------------|
| 贵金属投资           |            | —                          | —                           |
| 衍生金融资产          | 7.4.7.3    | —                          | —                           |
| 买入返售金融资产        | 7.4.7.4    | —                          | 289,966,634.95              |
| 应收证券清算款         |            | 2,223,616.16               | —                           |
| 应收利息            | 7.4.7.5    | 11,670,089.71              | 4,089,074.77                |
| 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            |            | 891,273,994.48             | 746,592,431.87              |
| <b>负债和所有者权益</b> | <b>附注号</b> | <b>本期末<br/>2016年12月31日</b> | <b>上年度末<br/>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       |            | 122,000,000.00             | —                           |
| 应付证券清算款         |            | —                          | —                           |
| 应付赎回款           |            | —                          | —                           |
| 应付管理人报酬         |            | 326,393.75                 | 314,896.62                  |
| 应付托管费           |            | 65,278.74                  | 62,979.31                   |
| 应付销售服务费         |            | 130,557.48                 | 125,958.61                  |
| 应付交易费用          | 7.4.7.7    | 23,616.26                  | 101,220.78                  |
| 应交税费            |            | —                          | —                           |
| 应付利息            |            | 2,822.37                   | —                           |
| 应付利润            |            | —                          | —                           |
| 递延所得税负债         |            | —                          | —                           |
| 其他负债            | 7.4.7.8    | 384,000.00                 | 91,500.00                   |
| 负债合计            |            | 122,932,668.60             | 696,555.32                  |
| <b>所有者权益:</b>   |            |                            |                             |

|            |          |                |                |
|------------|----------|----------------|----------------|
| 实收基金       | 7.4.7.9  | 739,354,674.96 | 739,354,674.96 |
| 未分配利润      | 7.4.7.10 | 28,986,650.92  | 6,541,201.59   |
| 所有者权益合计    |          | 768,341,325.88 | 745,895,876.55 |
| 负债和所有者权益总计 |          | 891,273,994.48 | 746,592,431.87 |

注：1. 报告截止日2016年12月31日，基金份额净值1.0392元，基金份额总额739,354,674.96份。

2. 本财务报表的比较期间为2015年10月23日(基金合同生效日)至2015年12月31日。

## 7.2 利润表

会计主体：天弘鑫安宝保本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<br>2016年1月1日至<br>2016年12月31日 | 上年度可比期间<br>2015年10月23日至<br>2015年12月31日 |
|-------------------|----------|---------------------------------|--|
| 一、收入              |          | 29,729,384.42                   | 7,982,494.49                           |
| 1. 利息收入           |          | 26,243,122.66                   | 3,333,398.95                           |
| 其中：存款利息收入         | 7.4.7.11 | 368,671.45                      | 1,474,862.68                           |
| 债券利息收入            |          | 25,062,160.60                   | 1,550,262.42                           |
| 资产支持证券利息收入        |          | —                               | —                                      |
| 买入返售金融资产收入        |          | 812,290.61                      | 308,273.85                             |
| 其他利息收入            |          | —                               | —                                      |
| 2. 投资收益（损失以“-”填列） |          | 17,252,082.59                   | 2,088,575.74                           |
| 其中：股票投资收益         | 7.4.7.12 | 10,480,219.94                   | 2,088,575.74                           |
| 基金投资收益            |          | —                               | —                                      |
| 债券投资收益            | 7.4.7.13 | 5,482,091.15                    | —                                      |
| 资产支持证券投资收益        |          | —                               | —                                      |
| 贵金属投资收益           | 7.4.7.14 | —                               | —                                      |

|                            |          |                |              |
|----------------------------|----------|----------------|--------------|
| 衍生工具收益                     | 7.4.7.15 | —              | —            |
| 股利收益                       | 7.4.7.16 | 1,289,771.50   | —            |
| 3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)     | 7.4.7.17 | -13,765,820.83 | 2,545,645.55 |
| 4. 汇兑收益(损失以“-”号填列)         |          | —              | —            |
| 5. 其他收入(损失以“-”号填列)         | 7.4.7.18 | —              | 14,874.25    |
| <b>减：二、费用</b>              |          | 7,283,935.09   | 1,441,292.90 |
| 1. 管理人报酬                   |          | 3,798,102.13   | 699,810.68   |
| 2. 托管费                     |          | 759,620.44     | 139,962.15   |
| 3. 销售服务费                   |          | 1,519,240.83   | 279,924.21   |
| 4. 交易费用                    | 7.4.7.19 | 272,154.85     | 136,423.09   |
| 5. 利息支出                    |          | 499,198.25     | 92,247.77    |
| 其中：卖出回购金融资产支出              |          | 499,198.25     | 92,247.77    |
| 6. 其他费用                    | 7.4.7.20 | 435,618.59     | 92,925.00    |
| <b>三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)</b> |          | 22,445,449.33  | 6,541,201.59 |
| 减：所得税费用                    |          | —              | —            |
| <b>四、净利润(净亏损以“-”号填列)</b>   |          | 22,445,449.33  | 6,541,201.59 |

### 7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：天弘鑫安宝保本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<br>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) | 739,354,674.96              | 6,541,201.59 | 745,895,876.55 |

|  |                         |               |                |
|--|-------------------------|---------------|----------------|
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)               | —                       | 22,445,449.33 | 22,445,449.33  |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)      | —                       | —             | —              |
| 其中：1. 基金申购款                            | —                       | —             | —              |
| 2. 基金赎回款                               | —                       | —             | —              |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) | —                       | —             | —              |
| 五、期末所有者权益(基金净值)                        | 739,354,674.96          | 28,986,650.92 | 768,341,325.88 |
| 项 目                                    | 上年度可比期间                 |               |                |
|  | 2015年10月23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)                        | 739,354,674.96          | —             | 739,354,674.96 |
| 二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)               | —                       | 6,541,201.59  | 6,541,201.59   |
| 三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数(净值减少以“-”号填列)      | —                       | —             | —              |
| 其中：1. 基金申购款                            | —                       | —             | —              |
| 2. 基金赎回款                               | —                       | —             | —              |
| 四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动(净值减少以“-”号填列) | —                       | —             | —              |
| 五、期末所有者权益(基金净值)                        | 739,354,674.96          | 6,541,201.59  | 745,895,876.55 |

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

天弘鑫安宝保本混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经中国证券监督管理委员会(以下简称“中国证监会”)证监许可[2015]1102号《关于核准天弘天弘鑫安宝保本混合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《天弘鑫安宝保本混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次募集期间为自2015年10月15日至2015年10月21日,首次设立募集不包括认购资金利息共募集739,321,900.00元,业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第988号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《天弘鑫安宝保本混合型证券投资基金基金合同》于2015年10月23日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为739,354,674.96份基金份额,其中利息折份额为32,774.96份,归入基金资产。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,担保人为瀚华担保股份有限公司。

根据《天弘鑫安宝保本混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金以每十八个月为一个保本周期。在第一个保本周期到期日,如基金份额持有人认购并持有到期的基金份额的可赎回金额加上其认购并持有到期的基金份额的累计分红款项之和低于其认购保本金额,基金管理人应补足该差额,并在保本周期到期日后二十个工作日内(含第二个工作日)将该差额支付给基金份额持有人;本基金第一个保本周期后各保本周期到期日,如基金份额持有人开放期申购、从上一保本周期转入当期保本周期并持有到期的基金份额的可赎回金额加上该部分基金份额在当期保本周期内的累计分红款项之和低于其开放期申购保本金额和转入当期保本周期的保本金额,由当期有效的《基金合同》、《保证合同》或《风险买断合同》约定的基金管理人或保本义务人将该差额支付给基金份额持有人。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘鑫安宝保本混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为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(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、债券回购、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,但须符合中国证监会相关规定。基金的投资组合比例为: : 风险资

产占基金资产净值的比例不高于40%，其中基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的3%；安全资产占基金资产净值的比例不低于60%。在开放期，本基金持有现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%，在保本周期内(保本周期到期日除外)，本基金不受该比例的限制。本基金的业绩比较基准：(一年期银行定期存款利率(税后)+0.5%)×2。

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》、《天弘鑫安宝保本混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

#### 7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

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

#### 7.4.4 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。比较财务报表的实际编制期间为2015年10月23日(基金合同生效日)至2015年12月31日止期间。

##### 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和债券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卖出回购金融资产款和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和债券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。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

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、托管费和销售服务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和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 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。

(2) 在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(3) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

#### 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<br>2016年12月31日 | 上年度末<br>2015年12月31日 |
|--------------|--------------------|---------------------|
| 活期存款         | 20,346,730.14      | 3,937,673.39        |
| 定期存款         | —                  | —                   |
| 其中：存款期限1-3个月 | —                  | —                   |
| 其他存款         | —                  | —                   |
| 合计           | 20,346,730.14      | 3,937,673.39        |

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            | 66,021,004.86    | 67,029,505.63  | 1,008,500.77   |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | —                | —              | —              |
| 债券            | 交易所市场            | 274,370,053.49 | 272,390,388.40 |
|               | 银行间市场            | 527,777,010.96 | 517,528,000.00 |
|               | 合计               | 802,147,064.45 | 789,918,388.40 |
| 资产支持证券        | —                | —              | —              |
| 基金            | —                | —              | —              |
| 其他            | —                | —              | —              |
| 合计            | 868,168,069.31   | 856,947,894.03 | -11,220,175.28 |
| 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            | 53,582,827.77    | 56,381,549.52  | 2,798,721.75   |
| 贵金属投资-金交所黄金合约 | —                | —              | —              |
| 债券            | 交易所市场            | 276,381,680.12 | 275,855,307.20 |
|               |                  |                | -526,372.92    |

|  |        |                |                |              |
|--|--------|----------------|----------------|--------------|
|  | 银行间市场  | 115,560,703.28 | 115,834,000.00 | 273,296.72   |
|  | 合计     | 391,942,383.40 | 391,689,307.20 | -253,076.20  |
|  | 资产支持证券 | —              | —              | —            |
|  | 基金     | —              | —              | —            |
|  | 其他     | —              | —              | —            |
|  | 合计     | 445,525,211.17 | 448,070,856.72 | 2,545,645.55 |

#### 7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

#### 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

单位：人民币元

| 项目    | 本期末 2016年12月31日  |           |
|-------|------------------|-----------|
|       | 账面余额             | 其中：买断式逆回购 |
| 银行间市场 | —                | —         |
| 合计    | —                | —         |
| 项目    | 上年度末 2015年12月31日 |           |
|       | 账面余额             | 其中：买断式逆回购 |
| 银行间市场 | 289,966,634.95   | —         |
| 合计    | 289,966,634.95   | —         |

##### 7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末及上年度末未持有从买断式逆回购交易中取得的债券。

#### 7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

| 项目       | 本期末<br>2016年12月31日 | 上年度末<br>2015年12月31日 |
|----------|--------------------|---------------------|
| 应收活期存款利息 | 1,925.31           | 67,071.14           |
| 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  | 6.93          | 249.26       |
| 应收债券利息     | 11,668,122.05 | 3,875,932.40 |
| 应收买入返售证券利息 | —             | 145,809.65   |
| 应收申购款利息    | —             | —            |
| 应收黄金合约拆借孳息 | —             | —            |
| 其他         | 35.42         | 12.32        |
| 合计         | 11,670,089.71 | 4,089,074.77 |

#### 7.4.7.6 其他资产

本基金本报告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<br>2016年12月31日 | 上年度末<br>2015年12月31日 |
|-------------|--------------------|---------------------|
| 交易所市场应付交易费用 | 21,565.13          | 98,641.28           |
| 银行间市场应付交易费用 | 2,051.13           | 2,579.50            |
| 合计          | 23,616.26          | 101,220.78          |

#### 7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

| 项目          | 本期末<br>2016年12月31日 | 上年度末<br>2015年12月31日 |
|-------------|--------------------|---------------------|
| 应付券商交易单元保证金 | —                  | —                   |
| 应付赎回费       | —                  | —                   |
| 预提费用        | 384,000.00         | 91,500.00           |
| 合计          | 384,000.00         | 91,500.00           |

#### 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          | 739,354,674.96          | 739,354,674.96 |
| 本期申购          | —                       | —              |
| 本期赎回（以“-”号填列） | —                       | —              |
| 本期末           | 739,354,674.96          | 739,354,674.96 |

注：根据本基金《基金合同》、《招募说明书》的相关约定，本基金于2015年10月23日（基金合同生效日）至2017年4月24日为本基金第一个保本周期，本基金保本周期内不开放申购、赎回及转换业务（保本周期到期日除外）。

#### 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           | 3,995,556.04  | 2,545,645.55   | 6,541,201.59  |
| 本期利润           | 36,211,270.16 | -13,765,820.83 | 22,445,449.33 |
| 本期基金份额交易产生的变动数 | —             | —              | —             |
| 其中：基金申购款       | —             | —              | —             |
| 基金赎回款          | —             | —              | —             |
| 本期已分配利润        | —             | —              | —             |
| 本期末            | 40,206,826.20 | -11,220,175.28 | 28,986,650.92 |

#### 7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2016年1月1日至2016年12月31日 | 上年度可比期间<br>2015年10月23日至2015年12月31日 |
|-----------|-----------------------------|------------------------------------|
| 活期存款利息收入  | 351,111.36                  | 625,607.83                         |
| 定期存款利息收入  | —                           | 848,541.67                         |
| 其他存款利息收入  | —                           | —                                  |
| 结算备付金利息收入 | 16,689.63                   | 679.74                             |

|    |            |              |
|----|------------|--------------|
| 其他 | 870.46     | 33.44        |
| 合计 | 368,671.45 | 1,474,862.68 |

#### 7.4.7.12 股票投资收益

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2016年1月1日至2016年12月31日 | 上年度可比期间<br>2015年10月23日至2015年12月31日 |
|------------|-----------------------------|------------------------------------|
| 卖出股票成交总额   | 87,485,628.11               | 27,559,208.07                      |
| 减：卖出股票成本总额 | 77,005,408.17               | 25,470,632.33                      |
| 买卖股票差价收入   | 10,480,219.94               | 2,088,575.74                       |

#### 7.4.7.13 债券投资收益

##### 7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

| 项目                            | 本期<br>2016年1月1日至2016年12月31日 | 上年度可比期间<br>2015年10月23日至2015年12月31日 |
|-------------------------------|-----------------------------|------------------------------------|
| 债券投资收益——买卖债券（、债转股及债券到期兑付）差价收入 | 5,482,091.15                | —                                  |
| 债券投资收益——赎回差价收入                | —                           | —                                  |
| 债券投资收益——申购差价收入                | —                           | —                                  |
| 合计                            | 5,482,091.15                | —                                  |

##### 7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

| 项目 | 本期<br>2016年1月1日至2016年12月31日 | 上年度可比期间<br>2015年10月23日至2015年12月31日 |
|----|-----------------------------|------------------------------------|
|----|-----------------------------|------------------------------------|

|                         |                |   |
|-------------------------|----------------|---|
| 卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成交总额   | 831,031,258.30 | — |
| 减：卖出债券（、债转股及债券到期兑付）成本总额 | 811,228,865.52 | — |
| 减：应收利息总额                | 14,320,301.63  | — |
| 买卖债券差价收入                | 5,482,091.15   | — |

#### 7.4.7.14 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。

#### 7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具收益。

#### 7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

| 项目          | 本期<br>2016年1月1日至2016年12月31日 | 上年度可比期间<br>2015年10月23日至2015年12月31日 |
|-------------|-----------------------------|------------------------------------|
| 股票投资产生的股利收益 | 1,289,771.50                | —                                  |
| 基金投资产生的股利收益 | —                           | —                                  |
| 合计          | 1,289,771.50                | —                                  |

#### 7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

| 项目         | 本期<br>2016年1月1日至2016年12月31日 | 上年度可比期间<br>2015年10月23日至2015年12月31日 |
|------------|-----------------------------|------------------------------------|
| 1. 交易性金融资产 | -13,765,820.83              | 2,545,645.55                       |
| ——股票投资     | -1,790,220.98               | 2,798,721.75                       |
| ——债券投资     | -11,975,599.85              | -253,076.20                        |
| ——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      | -13,765,820.83 | 2,545,645.55 |

7.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

| 项目      | 本期<br>2016年1月1日至2016年12月31日 | 上年度可比期间<br>2015年10月23日至2015年12月31日 |
|---------|-----------------------------|------------------------------------|
| 基金赎回费收入 | —                           | —                                  |
| 其他      | —                           | 14,874.25                          |
| 合计      | —                           | 14,874.25                          |

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

| 项目        | 本期<br>2016年1月1日至2016年12月31日 | 上年度可比期间<br>2015年10月23日至2015年12月31日 |
|-----------|-----------------------------|------------------------------------|
| 交易所市场交易费用 | 265,329.85                  | 135,998.09                         |
| 银行间市场交易费用 | 6,825.00                    | 425.00                             |
| 合计        | 272,154.85                  | 136,423.09                         |

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

| 项目   | 本期<br>2016年1月1日至2016年12月31日 | 上年度可比期间<br>2015年10月23日至2015年12月31日 |
|------|-----------------------------|------------------------------------|
| 审计费用 | 89,000.00                   | 60,000.00                          |

|       |            |           |
|-------|------------|-----------|
| 信息披露费 | 300,000.00 | 30,000.00 |
| 其他费用  | 1,300.00   | —         |
| 帐户维护费 | 36,000.00  | 1,500.00  |
| 汇划手续费 | 9,318.59   | 1,425.00  |
| 合计    | 435,618.59 | 92,925.00 |

#### 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(“天弘基金”) | 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               |
| 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  | 基金管理人的股东            |

|                      |             |
|----------------------|-------------|
| 合伙)                  |             |
| 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    |
| 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    |
| 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<br>2016年1月1日至2016年12月<br>31日 | 上年度可比期间<br>2015年10月23日至2015年12<br>月31日 |
|-----------------|---------------------------------|--|
| 当期发生的基金应支付的管理费  | 3,798,102.13                    | 699,810.68                             |
| 其中：支付销售机构的客户维护费 | 26,089.48                       | 4,807.10                               |

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0.50%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 X 0.50% / 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。

#### 7.4.10.2.2 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10月23日至2015年12月31日 |
| 当期发生的基金应支付的托管费 | 759,620.44            | 139,962.15              |

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0.10%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 0.10% / 当年天数。

#### 7.4.10.2.3 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日至2016年12月31日   |
|                | 当期应支付的销售服务费             |
| 天弘基金管理有限公司     | 1,489,305.46            |
| 合计             | 1,489,305.46            |
| 获得销售服务费的各关联方名称 | 上年度可比期间                 |
|                | 2015年10月23日至2015年12月31日 |
|                | 当期应支付的销售服务费             |
| 天弘基金管理有限公司     | 274,402.24              |
| 合计             | 274,402.24              |

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给天弘基金，再由天弘基金计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日销售服务费=前一日基金资产净值 X 0.20%/ 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

本基金本报告期内及上年度可比期间未发生与关联方进行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

本报告期及上年度可比期间无各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<br>2016年1月1日至2016年12月31日 |            | 上年度可比期间<br>2015年10月23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 | 20,346,730.14               | 351,111.36 | 3,937,673.39                       | 625,607.83 |

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

本基金本报告期内及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销的证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

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

本基金本报告期内无利润分配。

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

金额单位：人民币元

| 7.4.12.1.1 受限证券类别：股票 |      |            |            |        |       |        |          |            |            |
|----------------------|------|------------|------------|--------|-------|--------|----------|------------|------------|
| 证券代码                 | 证券名称 | 成功认购日      | 可流通日       | 流通受限类型 | 认购价格  | 期末估值单价 | 数量（单位：股） | 期末成本总额     | 期末估值总额     |
| 601375               | 中原证券 | 2016-12-20 | 2017-01-03 | 新股中签   | 4.00  | 4.00   | 26,695   | 106,780.00 | 106,780.00 |
| 603032               | 德新交运 | 2016-12-27 | 2017-01-05 | 新股中签   | 5.81  | 5.81   | 1,628    | 9,458.68   | 9,458.68   |
| 603035               | 常熟汽饰 | 2016-12-27 | 2017-01-05 | 新股中签   | 10.44 | 10.44  | 2,316    | 24,179.04  | 24,179.04  |

|        |      |            |            |      |       |       |       |           |           |
|--------|------|------------|------------|------|-------|-------|-------|-----------|-----------|
| 603186 | 华正新材 | 2016-12-26 | 2017-01-03 | 新股中签 | 5.37  | 5.37  | 1,874 | 10,063.38 | 10,063.38 |
| 603228 | 景旺电子 | 2016-12-28 | 2017-01-06 | 新股中签 | 23.16 | 23.16 | 3,085 | 71,448.60 | 71,448.60 |
| 603266 | 天龙股份 | 2016-12-30 | 2017-01-10 | 新股中签 | 14.63 | 14.63 | 1,562 | 22,852.06 | 22,852.06 |
| 603689 | 皖天然气 | 2016-12-30 | 2017-01-10 | 新股中签 | 7.87  | 7.87  | 4,818 | 37,917.66 | 37,917.66 |
| 603877 | 太平鸟  | 2016-12-29 | 2017-01-09 | 新股中签 | 21.30 | 21.30 | 3,180 | 67,734.00 | 67,734.00 |

注：基金可使用以基金名义开设的股票账户，选择网上或者网下一种方式进行新股申购。其中基金作为一般法人或战略投资者认购的新股，根据基金与上市公司所签订申购协议的规定，在新股上市后的约定期限内不能自由转让；基金作为个人投资者参与网上认购获配的新股，从新股获配日至新股上市日之间不能自由转让。

#### 7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

#### 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

本基金本报告期末无从事银行间债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

##### 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日止，本基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额122,000,000.00元，于2017年1月3日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

#### 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

本基金为保本基金，属于证券投资基金中的低风险品种。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(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、债券回购、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，但须符合中国证监会相关规定。

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。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。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；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

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。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的标准统计及汇总。

#### 7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 短期信用评级 | 本期末<br>2016年12月31日 | 上年度末<br>2015年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| A-1    | 69,924,000.00      | —                   |
| A-1以下  | —                  | —                   |
| 未评级    | 159,358,000.00     | 59,964,000.00       |
| 合计     | 229,282,000.00     | 59,964,000.00       |

注：未评级债券为短期融资券、同业存单。

#### 7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

| 长期信用评级 | 本期末<br>2016年12月31日 | 上年度末<br>2015年12月31日 |
|--------|--------------------|---------------------|
| AAA    | 40,766,530.60      | 66,149,307.20       |
| AAA以下  | 394,785,857.80     | 265,576,000.00      |
| 未评级    | 125,084,000.00     | —                   |
| 合计     | 560,636,388.40     | 331,725,307.20      |

注：未评级部分为政策性金融债。

#### 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%。本基金所持大部分证券在银行间同业市场交易，其余亦可在证券交易所上市，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，除卖出回购金融资产款余额中有122,000,000.00元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他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，因此账面余额约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。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

##### 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<br>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               | 20,346,730<br>.14  | —                  | —                  | —                 | 20,346,730<br>.14  |
| 结算备付金              | 14,092.29          | —                  | —                  | —                 | 14,092.29          |
| 存出保证金              | 71,572.15          | —                  | —                  | —                 | 71,572.15          |
| 交易性金融资产            | 334,979,50<br>0.00 | 266,915,38<br>3.40 | 188,023,50<br>5.00 | 67,029,505<br>.63 | 856,947,89<br>4.03 |
| 应收证券清算款            | —                  | —                  | —                  | 2,223,616.<br>16  | 2,223,616.<br>16   |
| 应收利息               | —                  | —                  | —                  | 11,670,089<br>.71 | 11,670,089<br>.71  |
| 资产总计               | 355,411,89<br>4.58 | 266,915,38<br>3.40 | 188,023,50<br>5.00 | 80,923,211<br>.50 | 891,273,99<br>4.48 |
| 负债                 |                    |                    |                    |                   |                    |
| 卖出回购金融资产款          | 122,000,00<br>0.00 | —                  | —                  | —                 | 122,000,00<br>0.00 |
| 应付管理人报酬            | —                  | —                  | —                  | 326,393.75        | 326,393.75         |
| 应付托管费              | —                  | —                  | —                  | 65,278.74         | 65,278.74          |
| 应付销售服务费            | —                  | —                  | —                  | 130,557.48        | 130,557.48         |
| 应付交易费用             | —                  | —                  | —                  | 23,616.26         | 23,616.26          |
| 应付利息               | —                  | —                  | —                  | 2,822.37          | 2,822.37           |
| 其他负债               | —                  | —                  | —                  | 384,000.00        | 384,000.00         |
| 负债总计               | 122,000,00<br>0.00 | —                  | —                  | 932,668.60        | 122,932,66<br>8.60 |
| 利率敏感度缺口            | 233,411,89<br>4.58 | 266,915,38<br>3.40 | 188,023,50<br>5.00 | 79,990,542<br>.90 | 768,341,32<br>5.88 |

| 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            | 3,937,673.39   | —              | —            | —             | 3,937,673.39   |
| 结算备付金           | 503,491.52     | —              | —            | —             | 503,491.52     |
| 存出保证金           | 24,700.52      | —              | —            | —             | 24,700.52      |
| 交易性金融资产         | 59,964,000.00  | 329,485,951.20 | 2,239,356.00 | 56,381,549.52 | 448,070,856.72 |
| 买入返售金融资产        | 289,966,634.95 | —              | —            | —             | 289,966,634.95 |
| 应收利息            | —              | —              | —            | 4,089,074.77  | 4,089,074.77   |
| 资产总计            | 354,396,500.38 | 329,485,951.20 | 2,239,356.00 | 60,470,624.29 | 746,592,431.87 |
| 负债              |                |                |              |               |                |
| 应付管理人报酬         | —              | —              | —            | 314,896.62    | 314,896.62     |
| 应付托管费           | —              | —              | —            | 62,979.31     | 62,979.31      |
| 应付销售服务费         | —              | —              | —            | 125,958.61    | 125,958.61     |
| 应付交易费用          | —              | —              | —            | 101,220.78    | 101,220.78     |
| 其他负债            | —              | —              | —            | 91,500.00     | 91,500.00      |
| 负债总计            | —              | —              | —            | 696,555.32    | 696,555.32     |
| 利率敏感度缺口         | 354,396,500.38 | 329,485,951.20 | 2,239,356.00 | 59,774,068.97 | 745,895,876.55 |

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者予以分类。

#### 7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

|    |                     |
|----|---------------------|
| 假设 | 除市场利率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 |
|    | 市场利率下降25个基点 | 4,191,132.23                | 2,207,622.99    |
|    | 市场利率上升25个基点 | -4,122,669.94               | -2,188,110.26   |

#### 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。本基金投资于风险资产占基金资产净值的比例不高于40%，其中基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的3%；安全资产占基金资产净值的比例不低于60%。在开放期，本基金持有现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%，在保本周期内（保本周期到期日除外），本基金不受该比例的限制。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，包括VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

##### 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<br>2016年12月31日 |                          | 上年度末<br>2015年12月31日 |                          |
|---------------|--------------------|--------------------------|---------------------|--------------------------|
|               | 公允价值               | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) | 公允价值                | 占基金<br>资产净<br>值比例<br>(%) |
| 交易性金融资产-股票投资  | 67,029,505.63      | 8.72                     | 56,381,549.52       | 7.56                     |
| 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            | 67,029,505.63      | 8.72                     | 56,381,549.52       | 7.56                     |

#### 7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于2016年12月31日，本基金持有的交易性权益类投资公允价值占基金资产净值的比例为8.72%(2015年12月31日：7.56%)，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响(2015年12月31日：同)。

#### 7.4.14 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66,876,577.21元，属于第二层次的余额为790,071,316.82元，无属于第三层次的余额(2015年12月31日：第一层次60,630,056.72元，第二层次387,440,800.00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              | 67,029,505.63  | 7.52          |
|    | 其中：股票             | 67,029,505.63  | 7.52          |
| 2  | 固定收益投资            | 789,918,388.40 | 88.63         |
|    | 其中：债券             | 789,918,388.40 | 88.63         |
|    | 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      | 20,360,822.43  | 2.28          |
| 7  | 其他各项资产            | 13,965,278.02  | 1.57          |
| 8  | 合计                | 891,273,994.48 | 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         | —             | —             |
| B  | 采矿业              | 6,600,200.00  | 0.86          |
| C  | 制造业              | 21,654,957.06 | 2.82          |
| D  | 电力、热力、燃气及水生产和供应业 | 7,000,917.66  | 0.91          |
| E  | 建筑业              | 15,592.23     | —             |
| F  | 批发和零售业           | 14,730,000.00 | 1.92          |
| G  | 交通运输、仓储和邮政业      | 3,301,058.68  | 0.43          |
| H  | 住宿和餐饮业           | —             | —             |

|   |                 |               |      |
|---|-----------------|---------------|------|
| I | 信息传输、软件和信息技术服务业 | —             | —    |
| J | 金融业             | 13,726,780.00 | 1.79 |
| K | 房地产业            | —             | —    |
| L | 租赁和商务服务业        | —             | —    |
| M | 科学研究和技术服务业      | —             | —    |
| 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       | —             | —    |
| S | 综合              | —             | —    |
|   | 合计              | 67,029,505.63 | 8.72 |

### 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  | 600104 | 上汽集团 | 749,948   | 17,586,280.60 | 2.29         |
| 2  | 601933 | 永辉超市 | 3,000,000 | 14,730,000.00 | 1.92         |
| 3  | 600016 | 民生银行 | 1,500,000 | 13,620,000.00 | 1.77         |
| 4  | 600900 | 长江电力 | 550,000   | 6,963,000.00  | 0.91         |
| 5  | 600028 | 中国石化 | 1,220,000 | 6,600,200.00  | 0.86         |
| 6  | 600887 | 伊利股份 | 200,000   | 3,520,000.00  | 0.46         |
| 7  | 601006 | 大秦铁路 | 320,000   | 2,265,600.00  | 0.29         |
| 8  | 600377 | 宁沪高速 | 120,000   | 1,026,000.00  | 0.13         |
| 9  | 601375 | 中原证券 | 26,695    | 106,780.00    | 0.01         |
| 10 | 603298 | 杭叉集团 | 3,641     | 88,403.48     | 0.01         |
| 11 | 603585 | 苏利股份 | 1,041     | 72,578.52     | 0.01         |
| 12 | 603228 | 景旺电子 | 3,085     | 71,448.60     | 0.01         |
| 13 | 603218 | 日月股份 | 1,652     | 68,805.80     | 0.01         |

|    |        |      |       |           |      |
|----|--------|------|-------|-----------|------|
| 14 | 603877 | 太平鸟  | 3,180 | 67,734.00 | 0.01 |
| 15 | 603416 | 信捷电气 | 1,076 | 53,886.08 | 0.01 |
| 16 | 603886 | 元祖股份 | 2,241 | 39,665.70 | 0.01 |
| 17 | 603689 | 皖天然气 | 4,818 | 37,917.66 | —    |
| 18 | 603239 | 浙江仙通 | 924   | 29,059.80 | —    |
| 19 | 603035 | 常熟汽饰 | 2,316 | 24,179.04 | —    |
| 20 | 603266 | 天龙股份 | 1,562 | 22,852.06 | —    |
| 21 | 603929 | 亚翔集成 | 2,193 | 15,592.23 | —    |
| 22 | 603186 | 华正新材 | 1,874 | 10,063.38 | —    |
| 23 | 603032 | 德新交运 | 1,628 | 9,458.68  | —    |

#### 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  | 600104 | 上汽集团 | 18,302,087.32 | 2.45           |
| 2  | 601933 | 永辉超市 | 14,137,755.00 | 1.90           |
| 3  | 600016 | 民生银行 | 13,927,200.54 | 1.87           |
| 4  | 600900 | 长江电力 | 6,719,324.00  | 0.90           |
| 5  | 600028 | 中国石化 | 5,957,978.00  | 0.80           |
| 6  | 002103 | 广博股份 | 4,190,475.00  | 0.56           |
| 7  | 600660 | 福耀玻璃 | 3,997,804.92  | 0.54           |
| 8  | 600887 | 伊利股份 | 3,436,535.18  | 0.46           |
| 9  | 000709 | 河钢股份 | 2,986,300.00  | 0.40           |
| 10 | 000539 | 粤电力A | 2,076,000.00  | 0.28           |
| 11 | 601006 | 大秦铁路 | 2,028,800.00  | 0.27           |
| 12 | 000001 | 平安银行 | 1,642,600.00  | 0.22           |
| 13 | 000726 | 鲁泰A  | 1,027,650.00  | 0.14           |
| 14 | 000027 | 深圳能源 | 1,013,700.00  | 0.14           |

|    |        |       |            |      |
|----|--------|-------|------------|------|
| 15 | 000625 | 长安汽车  | 989,859.00 | 0.13 |
| 16 | 600377 | 宁沪高速  | 974,400.00 | 0.13 |
| 17 | 000402 | 金融街   | 950,000.00 | 0.13 |
| 18 | 000069 | 华侨城 A | 514,400.00 | 0.07 |
| 19 | 600909 | 华安证券  | 256,169.24 | 0.03 |
| 20 | 603858 | 步长制药  | 244,195.60 | 0.03 |

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  | 本期累计卖出金额      | 占期初基金资产净值比例(%) |
|----|--------|-------|---------------|----------------|
| 1  | 000858 | 五粮液   | 11,013,020.22 | 1.48           |
| 2  | 600660 | 福耀玻璃  | 10,844,981.66 | 1.45           |
| 3  | 002444 | 巨星科技  | 9,230,808.88  | 1.24           |
| 4  | 300017 | 网宿科技  | 8,546,362.80  | 1.15           |
| 5  | 300178 | 腾邦国际  | 6,645,458.10  | 0.89           |
| 6  | 600681 | 万鸿集团  | 5,916,182.26  | 0.79           |
| 7  | 002103 | 广博股份  | 3,736,578.00  | 0.50           |
| 8  | 000709 | 河钢股份  | 3,649,699.00  | 0.49           |
| 9  | 000539 | 粤电力 A | 2,106,157.68  | 0.28           |
| 10 | 000001 | 平安银行  | 1,782,500.00  | 0.24           |
| 11 | 000402 | 金融街   | 1,380,000.00  | 0.19           |
| 12 | 002781 | 奇信股份  | 1,302,311.00  | 0.17           |
| 13 | 300496 | 中科创达  | 1,276,737.00  | 0.17           |
| 14 | 000625 | 长安汽车  | 1,082,605.86  | 0.15           |
| 15 | 000027 | 深圳能源  | 1,062,687.00  | 0.14           |
| 16 | 000726 | 鲁泰 A  | 1,039,643.00  | 0.14           |
| 17 | 300494 | 盛天网络  | 598,845.80    | 0.08           |
| 18 | 600909 | 华安证券  | 563,820.32    | 0.08           |

|    |        |       |            |      |
|----|--------|-------|------------|------|
| 19 | 000069 | 华侨城 A | 561,185.00 | 0.08 |
| 20 | 603858 | 步长制药  | 543,984.70 | 0.07 |

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 | 89,443,585.26 |
| 卖出股票的收入（成交）总额 | 87,485,628.11 |

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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券品种      | 公允价值           | 占基金资产净值比例(%) |
|----|-----------|----------------|--------------|
| 1  | 国家债券      | —              | —            |
| 2  | 央行票据      | —              | —            |
| 3  | 金融债券      | 125,084,000.00 | 16.28        |
|    | 其中：政策性金融债 | 125,084,000.00 | 16.28        |
| 4  | 企业债券      | 304,332,352.80 | 39.61        |
| 5  | 企业短期融资券   | 209,790,000.00 | 27.30        |
| 6  | 中期票据      | 130,852,000.00 | 17.03        |
| 7  | 可转债       | 368,035.60     | 0.05         |
| 8  | 同业存单      | 19,492,000.00  | 2.54         |
| 9  | 其他        | —              | —            |
| 10 | 合计        | 789,918,388.40 | 102.81       |

注：可转债项下包含可交换债170,530.60元。

#### 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

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码   | 债券名称   | 数量（张）     | 公允价值          | 占基金资产净值比例(%) |
|----|--------|--------|-----------|---------------|--------------|
| 1  | 160210 | 16国开10 | 1,000,000 | 96,170,000.00 | 12.52        |

|   |           |                  |         |               |      |
|---|-----------|------------------|---------|---------------|------|
| 2 | 136003    | 15如意债            | 600,000 | 60,270,000.00 | 7.84 |
| 3 | 101564046 | 15银川通联<br>MTN001 | 500,000 | 49,760,000.00 | 6.48 |
| 4 | 011698390 | 16振华石油<br>SCP001 | 500,000 | 49,755,000.00 | 6.48 |
| 5 | 136645    | 16百隆01           | 500,000 | 49,225,000.00 | 6.41 |

**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   | 71,572.15     |
| 2 | 应收证券清算款 | 2,223,616.16  |
| 3 | 应收股利    | —             |
| 4 | 应收利息    | 11,670,089.71 |
| 5 | 应收申购款   | —             |
| 6 | 其他应收款   | —             |
| 7 | 待摊费用    | —             |
| 8 | 其他      | —             |
| 9 | 合计      | 13,965,278.02 |

#### 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<br>(户) | 户均持有的基<br>金份额 | 持有人结构         |            |                |            |
|--------------|---------------|---------------|------------|----------------|------------|
|              |               | 机构投资者         |            | 个人投资者          |            |
|              |               | 持有<br>份额      | 占总份<br>额比例 | 持有<br>份额       | 占总份<br>额比例 |
| 35,291       | 20,950.23     | 30,000,600.00 | 4.06%      | 709,354,074.96 | 95.94%     |

#### 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 | 236, 113. 57 | 0. 03% |
|------------------|--------------|--------|

**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**

| 项目                                 | 持有基金份额总量的数量区间（万份） |
|------------------------------------|-------------------|
| 本公司高级管理人员、基金投资和研<br>究部门负责人持有本开放式基金 | 0~10              |
| 本基金基金经理持有本开放式基金                    | 0                 |

**§ 10 开放式基金份额变动**

单位：份

|                            |                |
|----------------------------|----------------|
| 基金合同生效日(2015年10月23日)基金份额总额 | 739,354,674.96 |
| 本报告期期初基金份额总额               | 739,354,674.96 |
| 本报告期基金总申购份额                | —              |
| 减：本报告期基金总赎回份额              | —              |
| 本报告期基金拆分变动份额               | —              |
| 本报告期期末基金份额总额               | 739,354,674.96 |

注：本基金保本周期内采取封闭式运作，期间不开放申购、赎回业务。自基金合同生效日（2015年10月29日）至本报告期末，本基金处于封闭期。

**§ 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》。

本报告期内本基金的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7.5万元整。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)已为天弘鑫安宝保本混合型证券投资基金提供审计服务1年零3个月。

#### 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      | 5,586,685.65   | 3.24%     | 5,202.91   | 3.25%      |    |
| 光大证券 | 1      | 21,739,400.07  | 12.61%    | 20,244.31  | 12.63%     |    |
| 国泰君安 | 2      | 1,310,151.62   | 0.76%     | 958.09     | 0.60%      |    |
| 民生证券 | 1      | 3,092,303.10   | 1.79%     | 2,879.92   | 1.80%      |    |
| 招商证券 | 2      | 116,366,483.82 | 67.51%    | 108,373.49 | 67.63%     |    |
| 中银国际 | 1      | 24,263,472.81  | 14.08%    | 22,596.30  | 14.10%     |    |

##### 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 | —              | —         | 112,846,000.00   | 2.84%       | —    | —         |
| 光大证券 | 112,685,672.72 | 23.37%    | 529,600,000.00   | 13.33%      | —    | —         |
| 国泰君安 | —              | —         | 1,825,900,000.00 | 45.95%      | —    | —         |
| 民生证券 | 36,958,200.82  | 7.66%     | 88,000,000.00    | 2.21%       | —    | —         |
| 招商证券 | 194,571,899.42 | 40.35%    | 1,187,929,000.00 | 29.90%      | —    | —         |
| 中银国际 | 138,043,228.15 | 28.62%    | 229,300,000.00   | 5.77%       | —    | —         |

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况况稳定；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、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、天风证券上海交易单元1个、天风证券深圳交易单元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 |

|    |  |           |            |
|----|--|-----------|------------|
| 3  | 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 |
| 4  | 天弘鑫安宝保本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 |
| 5  | 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 |
| 6  | 天弘鑫安宝保本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 |
| 7  | 天弘鑫安宝保本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 |
| 8  | 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 |
| 9  | 天弘鑫安宝保本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 |
| 10 | 天弘基金管理有限公司公告                               | 中国证监会指定媒介 | 2016-04-23 |
| 11 | 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 |
| 12 | 天弘鑫安宝保本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 | 2016-06-06 |
| 13 | 天弘鑫安宝保本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 | 2016-06-06 |
| 14 | 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 |
| 15 | 天弘基金管理有限公司公告                               | 中国证监会指定媒介 | 2016-07-02 |
| 16 | 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 |
| 17 | 天弘鑫安宝保本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 |
| 18 | 天弘鑫安宝保本混合型证券投资                             | 中国证监会指定媒介 | 2016-08-29 |

|    |   |           |            |
|----|---|-----------|------------|
|    | 基金2016年半年度报告                                |           |            |
| 19 | 天弘鑫安宝保本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 |
| 20 | 天弘鑫安宝保本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 |
| 21 | 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 |
| 22 | 天弘鑫安宝保本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 | 2016-12-06 |
| 23 | 天弘鑫安宝保本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 | 2016-12-06 |
| 24 | 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 |
| 25 | 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鑫安宝保本混合型证券投资基金募集的文件
- 2、天弘鑫安宝保本混合型证券投资基金基金合同
- 3、天弘鑫安宝保本混合型证券投资基金托管协议
- 4、天弘鑫安宝保本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