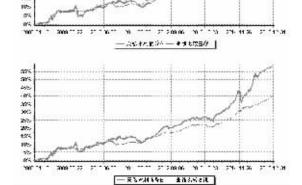
基金管理人:天弘基金管理有限公司基金托管人:兴业银行股份有限公司

天弘永利债券型证券投资基金

2015 第四季度 报告

基金管理人的董事会及董事保证 确性和完整性承担个别及连带责任 基金托管人兴业银行股份有限之 投资组合报告等内容,保证复核内 基金管理人承诺以诚实信用、勤 基金管理人承诺以诚实信用、勤 基金管理人承诺以该产品来 本报告财务资料未经审计。 本报告期自2015年10月11起至	正本报告所载资料 至 公司根据本基金会 容不存在虚假记 完成, 完成, 完成, 完成, 完成, 完成, 是位。 是位。 是位。 是位。 是位。 是位。 是位。 是位。	令同规定,于2016年1 载、误导性陈述或重 理和运用基金资产, 险,投资者在作出投 上。	月21日复核了本 大遗漏。 但不保证基金—	报告中的财务指标、净值和 定盈利。
基金简称	天弘永利信	基金产品概况		
基金主代码	7/56/75/4/100 420002	735		
基金运作方式	契约型开放	<u></u>		
基金合同牛效日	2008年04月			
报告期末基金份额总额	3.166.868.34			
投资目标			生的前提下,力多为其	会份额持有人获取较高的投资回报
投资策略	观经济运行 判.从而确定 股申购为主	状况、货币政策和财政政策 r整休密产配置 即债券 K	的变化、市场利率走势 票、现金及回购等的 所证真态度。本基金将在	i上的分析,对宏观经济发展环境、 5.经济周期,企业盈利状况等作出 2置比例。本基金的股票投资将以第 5充分重视本金安全的前提下,为3
业绩比较基准	中债新综合	指数		
风险收益特征		本基金为债券型基金,属于证券市场中风险较低的品种,其长期平均风险和预期收益率型基金,离于货币市场基金。		- 期平均风险和预期收益率低于混
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		
下属分级基金的基金简称	天弘永利债	券A	天弘永利信	特 B
下属分级基金的交易代码	420002		420102	
报告期末下属分级基金的份额总额	958,219,557.	44(5)	2,208,648,7	87.24份
3.1 主要财务指标	§ 3 主要则	才务指标和基金净值 报告!	表现 第(2015年10月01日-2	单位:人民
33,9290,993895	ĺ	天弘永利债务	PA .	天弘永利债券B
1.本期已实现收益			13,473,114.17	34,288,728
2.本期利润			22,382,915.35	59,139,050
3.加权平均基金份额本期利润			0.0177	0.02
4.期末基金资产净值			1,055,231,351.64	2,434,364,309
5.期末基金份額净值			1.1012	1.10

阶段	净值增长率①	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	D-3	2-4
过去三个月	1.77%	0.04%	2.73%	0.08%	-0.96%	-0.04%
天弘永利债券B						
阶段	净值增长率①	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	1.85%	0.05%	2.73%	0.08%	-0.88%	-0.03%



注:1、本基金合同于2008年4月18日 上效。 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 § 4 管理人报告

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明	
RE-Es	87(2)	任职日期	高任日期	NESSON SE-1-PR	15091	
姜晓丽	本基金基金经理。	2012年08月		6年	女、经济学硕士。历任本公司债券研究员 兼债券交易员;光大永明人寿保险有限公司债券研究员兼交易员;本公司固定收益 研究员、天弘、未利债券型证券 投资基金 基金经理助理。	
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. 於明人共任法則立法上公元化議地定任经知公院出						

4. 事业、公式区号州户全金亚运作理规于信情况的说明本基金按照国家法律法规及未履行基金合同所指的情况。 3.公平交易专项规则

对放下各股资组会下及的证价是特别,但是不能的证别不够下级分子及可被逐渐的同时,这样不是被强组合的交易行为。此类不能的对象,这种企业不同时间窗口(1日、3日、5日)内的同向交易的与指的中港行了T检验,未发现进反处平交易顺度的情况,公司施下各基金不存在因非公平交易等导致的利益输送行为,公平的解决的计算机及时。 另第交易行为的专项进明 起设行方。公平内待投资组合,制定(异常交易监控和报告办法)对可能显著影响市场价格。可能导致不公指接设计。 经设行方。公平内待投资组合,制定(异常交易监控和报告办法)对可能显著影响市场价格。可能导致不公指接处所分。 所能的推利益输送等交易行分异常和交易价格异常的首形进行界汇,规定相应的监定,分析和防控指施输送自构、严格等的一种。 是一种,严格控制的一基金统不周基金组合之间的同口反问它多,严格禁止的能等较不少平交易和利益输送的交易,对从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,保证分配结果符易规则,未发现本基金存在等交易行为。

5.1 🖁		shrift A massic	3 2 1×	资组合报			
	设告期末基金资	产组合情况				金	额单位:人民
序号		项目			金額		资产的比例(%)
1	权益投资	权益投资		93,456,352.02			
	其中:股票				93,456,352.02		
2	基金投资	基金投资 —					
3	固定收益投资	固定收益投资			4,568,058,281.70		9.
	其中:债券				4,568,058,281.70		9.
	资产支持证券				-		
4	贵金属投资				-		
5	金融衍生品投资				-		
6	买人返售金融资产	1			-		
	其中;买断式回购	的买人返售金融资产			-		
7	银行存款和结算备	付金合计			81,127,433.56		
8	其他资产				97,008,844.21		
9		合计			4,839,650,911.49		10
5.2 扌	反告期末按行业	分类的股票投资组	组合			^	deced to 1 E
代码		行业类别			公允价值		额单位:人民 等值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	11369609			ZC/LDTBL	[:12863E (FL)	中国山山門(2017
В	采矿业				_		
С	制造业				72,215,049.02		
D	电力、热力、燃气及	indo Al- 2014 Februita			72,213,049.02		
E	建筑业	DACE) THERMAL			16,064,303.00		-
F	批发和零售业				10,004,303.00		
G G	机及和零售业 交通运输、仓储和	ernica.			-		
Н	生宿和餐饮业	DECEM					
I	信息传输、软件和	与自社来服务业			_		
J	金融业	ii.18.13.7\HR.97.1E			_		
K	房地产业				_		
L	租赁和商务服务业	,					
M	科学研究和技术服				_		
N	水利、环境和公共				5,177,000.00		
0	居民服务、修理和				3,177,000.00		
P	ASSESSED AND THE PARTY OF THE P	教育			_		
Q	1	卫生和社会工作					
R	1	文化、体育和娱乐业			_		
S	1	综合			_		
		合计			93,456,352.02		
5.3	设告期末按公允	价值占基金资产?	争值比例大小扫	序的前十			
		股票名称					额单位:人民
序号	股票代码 600433	股票名称 短歌高新	数量(股	2,399,942	公允价值 27,503,3		资产净值比例(%
2		対象高数 巨星科技	1	799,941		_	
3	002444 600681		1	799,941 1.221.620	16,558,7		
		万鸿集团 Strate to Ma		, ,	-,,-		
4	000049 300367	徳寮电池		250,000 129,950	14,195,0	_	-
-		东方阿力	1		9,057,5	_	
6	300070 300243	碧水源 瑞丰高材	1	100,000 241,400	5,177,0 4,900.4	_	-

2	央行票据				_		-
3	金融债券				272,277,000.00		7.80
	其中:政策性金融	其中:政策性金融债			272,277,000.00		7.80
4	企业债券				1,862,407,084.70		53.37
5	企业短期融资券				2,017,192,000.00		57.81
6	中期票据				409,650,000.00		11.74
7	可转债				6,532,197.00		0.19
8	同业存单	业存单			_		-
9	其他				_		-
10		合计			4,568,058,281.70		130.91
注:可 5.5 报	可转债项下包含可交换债6,532,197.00元。 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小				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	011599741	15悦达SCP002		2,000,000	200,680,0	00.000	5.75
2	041555037	15华电媒业CP001		1,600,000	160,576,0	00,000	4.60
3	041556029	15国电集CP003		1,200,000	120,480,0	00,000	3.45
4	101459024	14桐乡城建MTN001		1,000,000	110,680,0	00,000	3.17
5	1480528	14世國投资债		1,000,000	106,120,0	00.000	3.04

5.5 报告期末校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 本基金本报告期末本基金投资的投售期货交易情况说明 本基金本报告期末本基金投资的租赁制贷。 5.0 报告期末本基金投资的国债期贷多情况说明 本基金本报告期末本基金投资的国债期贷多情况说明 本基金本报告期末本基金投资的国债期货。 5.11 投资组合报告附注 5.11 上茶报告期内末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 以正确本,必谓 公开喧玩、戏词。 5.11.2 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。 5.11.3 其他资产构成

		単位:人民巾兀
序号	名称	金額
1	存出保证金	141,647.27
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	79,657,367.92
5	应收申购款	17,209,829.02
6	其他应收款	=
7	待推费用	-
8	其他	-
9	合计	97,008,844.21
5.11.4 本基金	报告期末持有的处于转股期的可转换债券明约定本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。	

之间可能存在尾差。 §6 开放式基金份额变动

注: 总申购份额含红利再投、转换人份额; 总赎回份额含转换出份额。 \$7. 基金管理人运用固有资金投资本基金情况 不1. 基金管理人持有本基金份额变动情况 本基金本据告期未有基金管理人运用固有资金投资本基金。

7.1 基金管理人将4户26项以27%。本基金本报告期末有基金管理人运用固有资金投资本基金。
7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细本报告期基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细本报告期基金管理人来运用固有资金投资本基金。参照投资者决策的其他重要信息由于中信标普全情指数于2015年9月30日停止发布,自2015年10月11起,未基金业绩比较基准由"中信标普全情指数"变更少"中债商部合指数",上述顺客事宜为本基金基金份解考人利益未基金业绩比较基准由"中信标普全债指数"变更少"中债商部合指数",上述顺客事宜为本基金基金份解考人利益未基金业绩比较基准中间定。18. 《请关注本公司于2015年9月24日在指定域/按露的《天记基金管理有限公司关于变更天弘、利债券型证券投资基金业绩比较基准并用应修改基金合同部分余款的公告》中形式内容。

9.1 备查文件目录 1.中国证监会批准天弘永利债券型证券投资基金募集的文件 2.天弘未利债券型证券投资基金各合同 3.天弘未利债券型证券投资基金招募设明书 4.天弘未利债券型证券投资基金招募设明书 4.天弘未利债券型证券投资基金任营协议 任基金管理程则公司批准成立批件及营业执照 9.2 存款地点 天课市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层 9.3 查阅方式

7.3 查询对是全管理人的住所及网站或基金托管人的住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

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。 公司对旅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16%。未发现进度公平交易原则的异常交易。 本报告期内,未出现进度公平交易制度的情况。公司旅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 交易制度的额依执行情况良好。 4.32 异常交易行为的专项说用 共加较现场交行》、心平线起始等仍全、细时,尽管次是仍然知识生态注入对可能导来影响市场价效。可能导致不公巫

4.3.2 异常交易行为的专项说明 为规范投资行为、公平对特投资组合、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、可能涉嫌机益舱送等交易行为异常和交易价格异常的情形进行界定、规定相应的监控、分析和助控措施。 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。计对以公司名义进行的债券、破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。 14.18年期中基本系统制或途径及和平均分的

易和利益輸送的异常交易。
4 相连明中基金的投資報報和运作分析
2015年四季度,经济基本面整体延续被弱。虽然后半段经济有一定企稳迹象。但是弱势格局短期内无法根本性扭转。
2015年四季度,经济基本面整体延续被弱。虽然后半段经济有一定企稳迹象。但是弱势格局短期内无法根本性扭转。
以基础投始的"张为核心的经济干班接效"。无法无分对冲内需快速回路的中市、只能在一定程度上延缓经济增速回路的
速度,无法扭转整体内结约象。或方面。经济下行压力大以及外汇流出加高等因素使得货币边策依然生了党经验中,央
行于四季度继续进行了缔准降息等您比增性,维持一季度以来流动性的宽松局面。资金面方面,得益于央行构建和争步
新的政策超影。查全到率程度、在基本面、政策面积效金面二方配合,以及资产涨局下增量完全的商品,资金和率和债券收益率均出界显著下行。
本基金任息期内,税归秉承稳健理财的投资理念、在资金利率不断下行的趋势下,将互联网金融关于大数据分析的独特优势和投资研究有机结合起来。只管四季度资金数松、但年末因素依旧为余额定投资提供了较好的投资组会。本
45.报告期内基金的业绩表现
46.用告册内基金的业绩表现
47.日告用人基础,是是一个工程,是一个工程,是是一个工程,是是一个工程,是是一个工程,是一个工程,是是一个工程,是是一个工程,是是一个工程,是是一个工程,是是一个工程,是是一个工程,是是一个工程,是是一个工程,是一个

4-3 按古朔內基並的型項表現 截止2015年12月3日,本基金本报告期份額净值收益率为0.7133%,同期业绩比较基准收益率为0.3456%。 4-6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

天弘永定价值成长混合型证券投资基金

2015 第四季度 报告

2015年12月31日

基金托管人:兴业银行股份有限公司 报告送出日期:2016年1月22日 §1 重要提示及目录 基金管理人的董事会及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责任。 基金托管人兴业银行骰份有限公司根据本基金合同规定,于2016年1月21日复核了本报告中的财务指标,净值表现

和投资组合报告等内容,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用书。 本报告财务资料未经审计。

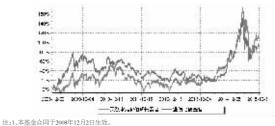
41K日朔日2013年10月1日	慢±2013年12月3日日:。
	§ 2 基金产品概况
基金简称	天弘永定价值成长混合
基金主代码	420003
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2008年12月2日
报告期末基金份额总额	115,596,935.37(/)
投资目标	在合理控制风险的基础上,追求基金资产的长期稳健增值,为投资人创造超额收益。
投资策略	本基金为主动管理的混合程基金,主要形理于国内A股市场上或长挂较好。在成本平具有比较优势的上市公司以及取纳鲁市场上的国债。金融债,再转晚得收以及区。资而工具等投资品中,本基金投资运转了股票为主,指述一股"的投资策略,同时适当运用股票。债券等资产及活在服务收费额路、以任任金产价的废动。
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。
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

§ 3 主要财务指标和基金净值表现 3.1 主要财务指标

abounded by 10°40°	单位:人民币:
主要财务指标	报告期(2015年10月1日-2015年12月31日)
1.本期已实现收益	15,756,905.22
2.本期利润	29,431,154.89
3.加权平均基金份额本期利润	0.2331
4.期末基金资产净值	180,852,050.23
5.期末基金份額净值	1.5645
注:1、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

2、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),计人费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现



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

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限 17.5.11.11.0		证券从业年限	说明
80.61	B15,99	任职日期	高任日期	HESSAAR-H-PR	1969/1
肖志刚	本基金基金经 理:投资研究部 总经理。	2014年1月	-	7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月加盟本公司,历任股票研究部总经理,天弘周期策略股票型证券投资基金基金经理助理。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。 4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金按照国家法律法规及基金合同的相关约定进行操作,不存在违法违规及未履行基金合同承诺的情况。 4.3 公平交易专项说明

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 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

. 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

4.3.2 异常交易行为的专项说明

为规范投资行为。公平均待投资组合、制定(异常交易监控和报告功法)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。 本报告期內,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 报告期内基金的投资策略和运作分析

在经历了剧烈波动的3季度,市场在4季度进入了相对平稳的状态,各种政策类主题逐渐降温,而基于新技术的主题 报告期内,考虑到后市仍有较大的下降空间,进行了整体的防御配置,努力进行个股优化,回归到正常的个股投资 框架中。行业配置方面,延续了3季度的增持食品饮料类股票的思路,并重新恢复了农业股的配置,另外,提高了电子类 股票的配置,主要是基于政策受益的思路。

截至2015年12月31日,本基金份额净值为1.5645元,本报告期份额净值增长率16.47%,同期业绩比较基准增长率

本报告期内本基金管理人无应说明预警信息。

4.7 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 事实上,在过去3年的移动互联网浪潮下,A股本身成为了最受益者。纵观A股25年历史,经历了三轮爆发力较强的 牛市,分别是1991年、2007年、2014年,有明显的数据表明,后两次牛市,与PC互联网、移动互联网的快速发展是密切相关 的,正是由于交易手段的快速发展,使得能够触达交易的投资者急剧增加,类似于互联网企业的日活跃用户数,即活跃 度上升,导致了资金换手率的上升,并推动了市场估值的整体提升。

这样的一个结果,使得急援更陷入了博弈的困境中。最处存在现金宁恒的期律,流入资金方面,每年流通股东能获得得上市公司分红不超过3000亿元,这是个外生变量,而流出包括了印花脱、佣金、融资、减持等,2015年超过了2万亿,使 得A股对于新增流入资金的饥渴程度明显上升,一旦断粮则表现为踩踏,行情方向的突变。

预计未来A股的波动仍将呈现剧烈的特点,因此适当增加换手率是可选的应对之策。

5.1 报告期末基金资产组合情况

5.2 报	告期末按行业分类的股票投资组合		
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	20,755,393.56	11.48
В	采矿业	5,540,478.80	3.06
C	制造业	100,252,831.77	55.43
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	6,602,547.16	3.65
E	建筑业	_	-
F	批发和零售业	120,074.40	0.07
G	交通运输、仓储和邮政业	_	_
Н	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	2,317,296.00	1.28
J	金融业	3,708,946.92	2.05
K	房地产业	215.82	_
L	租赁和商务服务业	2,306,150.73	1.28
M	科学研究和技术服务业	505.20	-
N	水利、环境和公共设施管理业	7,286,425.08	4.03
0	居民服务、修理和其他服务业	_	_
P	教育	-	-
Q	卫生和社会工作	-	-

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明约

本基金报告期末未持有债券

5.5 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债券投资明细本基金报告期末未持有债券。 5.6 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名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。 5.7 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。

5.8 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权证投资明细 本基金本报告期末未持有权证。

5.9 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。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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

5.11.2 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。

		单位:人民币
序号	名称	金額
1 7	存出保证金	1,044,887.5
2 h	立收证券清算款	2,428,558.4
3 E	立收股利	-
4 5	立收利息	24,623.0
5 h	並收申购款	54,335.4
6 1	其他应收款	=
7 1	寺摊费用	=
8 1	其他	=
9	合计	3,552,404.4

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。 5.11.5 报告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。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分 § 6 开放式基金份额变动

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

7 2 其全管理 人 云田固有资全投资 木基全 交易 田紅

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招募说明书

4、天弘永定价值成长混合型证券投资基金托管协议 5、天弘基金管理有限公司批准成立批件及营业执照

8.2 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

投资者可到基金管理人的住所及网站或基金托管人的住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。

天弘基金管理有限公司

基金管理人:天弘基金管理有限公司 基金托管人:中信银行股份有限公司 报告送出日期;2016年1月22日

§ 1 重要提示 基金管理人的董事会及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、 推動性用來的思手來及無事的。 基金數目現入的思手來及無事的。 一個性和宗教性來和作別及推帶競任。 基金計管人中信報行股份有限人司根据本基金合同规定。于2016年1月19日复核了本报告中的财务指标、净值表现 和收货组合保持等构容、保证复核内容不存在虚假记载、误导性除法或重大遗漏。 基金管理人承诺以诚实信用。勤励尽劳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本来表现。投版,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。 本招告财务资料未经审计。 本招告财务可见35年16日11年至至9015年19月31日止。

本报告期自2015年10月1日	过至2015年	12月31日止。 《2 基金产品概况				
基金简称		天弘余額宝货币				
基金主代码		000198				
基金运作方式		契约型开放式				
基金合同生效日		2013年5月29日				
报告期末基金份额总额		620,690,491,640.68 (f)				
投资目标		在保持基金资产的低风险和高流动性的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。				
投资策略		本基金根据对短期利率变动的预测。采用投资组合平均剩余期限控制下的主动性投资策略。利用 定性分析和定量分析方法。通过对短期金融工具的积极投资,在控制风险和保证流动性的基础 上,力争获得能宜的当期设备				
业绩比较基准		同期七天通知存款利率(税后)				
风险收益特征		本基金为货币市场基金,属于证券投资基金中的低风险品种,其预期收益和风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。				
基金管理人		天弘基金管理有限公司				
基金托管人		中信银行股份有限公司				
3.1 主要财务指标	S	3 主要财务指标和基金净值表现 单位:人民币				
主要财务指标		报告期(2015年10月1日-2015年12月31日)				
1.本期已实现收益		4,356,427,727.2				
2.本期利润		4,356,427,727.2				
3.期末基金资产净值		620,690,491,640.60				

注:1,本基金无持有人认购或交易基金的各项费用。 2.本期已实现收益指基金本期利息收入投资收益;其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额。本 随为本期已实现收益加本期利润的金额相等。 3零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。 3.2. 基金伊區农地 3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较 注:本基金的收益分配是按日结转份额。 3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较 2013-05-28 2013-10-11 2014-03-23 2014-07-58 2014-11-20 2015-04-04 2015-05-17 2015-13-21 ── 人名全提尔克市 —— 化技术和基本 】

4.1 基金经理(或基金经理小组)简介 本基金基金约 理。

天弘余额宝货币市场基金

2015 第四季度 报告

2015年12月31日

其中、深远、即應該 注:报告期所免费如關聯資余額占基金资产净值比例应取报告期內每个交易日融資余額占基金资产净值比例的 序均值以对于货币市场基金,只要其投资的市场、如银行间市场)可交易,即可视为交易日。 储券主回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明 本报告期内,农货币市场基金债券正回购的资金余额未超过资产净值的20%。 5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况。

根据本货币市场基金基金合同的约定,其投资组合的平均剩余期限在每个交易日都不得超过120天。本报告期内,本 市市场基金投资组合平均剩余期限未发生超过120天的情况。 5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例 度等

金额单位:人民币

序号	债券代码	债券名称	债券数量 (张)	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	111509270	15浦发CD270	50,000,000	4,986,821,373.91	0.80
2	111510330	15∺业CD330	41,000,000	4,065,278,899.91	0.63
3	111510320	15∺业CD320	40,000,000	3,968,324,903.17	0.64
4	111517174	15光大CD174	40,000,000	3,967,555,481.41	0.6
5	111517175	15光大CD175	40,000,000	3,966,401,628.49	0.64
6	111507101	15招行CD101	40,000,000	3,960,381,006.70	0.64
7	111507098	15招行CD098	39,000,000	3,861,570,605.42	0.62
8	111516190	15上海银行CD190	35,000,000	3,472,469,947.08	0.56
9	019520	15団債20	32,200,000	3,218,082,520.79	0.52
10	150206	15国开06	30,300,000	3,034,936,411.15	0.49
5.6 "	影子定价"与"摊;	余成本法"确定的基金	资产净值的偏离		
项目				信選	情况
B告期内	偏离度的绝对值在0.25(含	r)=0.5%间的次数			0次
报告期内偏离度的最高值					0.04549
报告期内偏离度的最低值					0.02839
极告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值					0.03339

5.8.1 基金计价方法设明
本基金估值采用确全成本法。即估值对象以买人成本列示。按票面利率或协议利率并考虑其买人时的溢价与析价。在其剩余存线期内按据实际和考注进行种籍,每日计程制起。本基金通过每日计算基金收益并分离的方式,使基金价额净值保持在人民币1.00元。为了避免采用摊余成本法计算的基金资产净值与按市场利率和交易市价计算的基金资产净值发生重大编离,从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果。基金管理人于每一倍值日、采用估值技术、对基金特有的估值对象进于重新评估。即"影子定价",投资组合的确企成本与其他可参考公允价值指称产生重大偏离的成装,他公允指标均组合的原面价值进行膨胀。调整差额加入少公公价值变或损益。并获及他公允价值价格形式行动,证据其他公允价值的依赖面价值未完在分别。但是一个企业,可恢复使用摊余成本法估算令公价值。如有确直证据表明按上达方法进行估值不能参观政策以公允价值的人基金管理人而定是在任营人而定,按照人公允价值的依然。在管理人可以在一个发展。

		単位:人民口
序号	名称	金額(元)
1	存出保证金	3,007.77
2	应收证券清算款	
3	应收利息	1,145,964,209.53
4	应收申购款	=
5	其他应收款	_
6	待摊费用	
7	其他	
8	合计	1,145,967,217.30
5.8.5	设资组合报告附注的其他文字描述部分。	
由于四	舍五人的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾	差。

注:总申购份额含红利再投。

注: 尼甲酮份額含红利用及。 §7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细 本基金本报告期未有基金管理人运用固有资金投资本基金。 §8 备查文件目录

8.1 各查文件目录
1.中国证监会批准设立天弘增利宝货币市场基金的文件
2.天弘余额定货币市场基金基金会同
3.天弘余额定货币市场基金基金经营的议
5.天弘泰省宣有限公司批准成立批件及营业执照
8.2 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储16层
8.3 查阅方式
投资者可到基金管理人的住所及网站或基金托管人的住所免费查阅备查文件,在支付工本费后,可在合理时间内取
投资者可到基金管理人的住所及网站或基金托管人的住所免费查阅备查文件,在支付工本费后,可在合理时间内取
人工资产的发制件或复归件。
公司网站:www.thfund.com.cn