天弘安康养老混合型证券投资基金

2015 年度 报告摘要

2015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:中国工商银行股份有限公司
送出日期:2016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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年3月24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、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书及其更新。

本年度报告摘要摘自年度报告正文,投资者欲了解详细内容,应阅读年度报告正文。

本报告期自2015年1月1日起至2015年12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	天弘安康养老混合
基金主代码	420009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年11月28日
基金管理人	天弘基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	2,080,056,562.43
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金主要投资于债券等固定收益类金融工具,辅助投资于精选的价值型股票,通过灵活的资产配置与严谨的风险管理,力求实现基金资产持续稳定增值,为投资者提供稳健的养老理财工具。
投资策略	本基金采取稳健的投资策略,通过债券等固定收益类资产的投资获取平稳收益,并适度参与股票等权益类资产的投资增强回报,在灵活配置各类资产以及严格的风险管理基础上,力争实现基金资产的持续稳定增值。
业绩比较基准	三年期银行定期存款利率(税后)+0.75%
风险收益特征	本基金为债券投资为主的混合型基金,属于中低风险、中低收益预期的基金品种,其风险收益预期高于货币市场基金和债券型基金,低于股票型基金。

注:本基金自2015年4月14日起,业绩比较基准由"五年期银行定期存款利率(税后)",变更为"三年期银行定期存款利率(税后)+0.75%"。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		天弘基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	童建林	洪渊
	联系电话	022-83310208	010-66105799
	电子邮箱	service@thfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4007109999	95588
传真		022-83865569	010-66105798

2.4 信息披露方式

登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.thfund.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公地址

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2015年	2014年	2013年
本期已实现收益	252,433,405.87	148,315,327.17	10,956,018.94
本期利润	352,848,157.22	168,604,061.48	7,889,638.83
加权平均基金份额本期利润	0.1117	0.1351	0.0374
本期基金份额净值增长率	18.89%	14.86%	1.89%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末	2014年末	2013年末
期末可供分配基金份额利润	0.2796	0.1753	0.0235
期末基金资产净值	2,906,536,484.21	865,460,735.63	132,155,384.99
期末基金份额净值	1.397	1.175	1.023

注:1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如,开放式基金的申购赎回费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

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

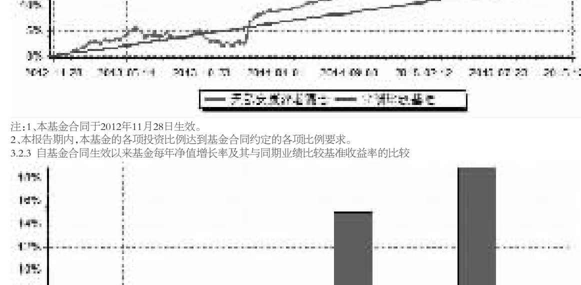
3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	3.25%	0.15%	0.80%	0.01%	2.45%	0.14%
过去六个月	3.56%	0.33%	1.70%	0.01%	1.86%	0.32%
过去一年	18.89%	0.39%	3.82%	0.01%	15.07%	0.38%
过去三年	39.14%	0.28%	13.77%	0.01%	25.37%	0.27%
自基金合同生效日起至今(2012年11月28日-2015年12月31日)	39.70%	0.28%	14.28%	0.01%	25.42%	0.27%

注:天弘安康养老混合基金业绩比较基准:五年期银行定期存款利率(税后),即中国人民银行公布并执行的五年期金融机构人民币存款基准利率(税后)。2015年4月14日开始变更为:三年期银行定期存款利率(税后)+0.75%,即中国人民银行公布并执行的三年期金融机构人民币存款基准利率(税后)+0.75%。

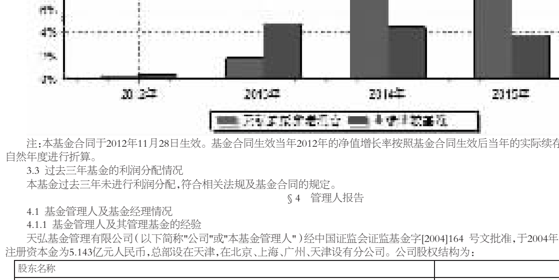
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1、本基金合同于2012年11月28日生效。

2、本报告期内,本基金的各项投资比例达到基金合同约定的各项比例要求。

3.2.3 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2012年11月28日生效。基金合同生效当年2012年的净值增长率按照基金合同生效后当年的实际续存期计算,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

本基金过去三年未进行利润分配,符合相关法规及基金合同的规定。

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

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

股东名称	股权比例
浙江蚂蚁小微金融服务集团有限公司	51%
天津信托有限责任公司	16.8%
内蒙古君正能源化工集团股份有限公司	15.6%
芜湖高新投资有限公司	5.6%
新疆天瑞博丰股权投资合伙企业(有限合伙)	3.5%
新疆天惠新盟股权投资合伙企业(有限合伙)	2%
新疆天阜恒基股权投资合伙企业(有限合伙)	2%
新疆天聚宸兴股权投资合伙企业(有限合伙)	3.5%
合计	100%

截至2015年12月31日,本基金管理人共管理46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、天弘同利分级债券型证券投资基金、天弘季加利理财债券型证券投资基金、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、天弘中证银行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、天弘中证休闲娱乐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。

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		
姜晓丽	本基金基金经理。	2013年1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、基金经理助理等。
钱文成	本基金基金经理。	2014年1月	-	9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、上述任职日期为本基金管理人对外披露的任职日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明

本基金管理人按照国家法律法规及基金合同的相关约定进行操作,不存在违法违规及未履行基金合同承诺的情况。

本报告期内,本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其配套规则和其他相关法律法规、基金合同的有关规定,勤勉尽责地管理和运用基金资产,在严格控制风险的基础上,为基金份额持有人谋求最大利益。

本报告期内,本基金运作合法合规,不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

基金管理人一直坚持公平对待旗下所有基金的原则,严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度,在研究分析、投资决策和交易执行等各个环节落实公平交易原则。公平交易范围包括各类投资组合、所有投资交易品种,以及一级市场申购、二级市场交易等所有投资交易管理活动及授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

针对公司旗下所有投资组合的交易所公开竞价交易,通过交易系统中的公平交易程序,对于不同投资组合同日同向买卖同一证券的指令自动进行比例分配。针对场外网下交易业务,依照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部场外、网下交易业务的相关规定,确保各投资组合享有公平的交易执行机会。对于以公司名义进行的交易严格按照发行分配的原则或价格优先、比例分配的原则在各投资组合间进行分配。

4.3.2 公平交易制度的执行情况

公平交易的执行情况包括:建立统一的研究平台和公共信息平台,保证各组合得到公平的投资资讯;公平对待不同投资组合,禁止各投资组合之间进行以利益输送为目的的投资交易活动;在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时,严格执行授权审批程序;实行集中交易制度和公平交易分配制度;建立不同投资组合投资信息的管理及保密制度,保证不同投资组合经理之间的重大非公开投资信息的相互隔离;加强对投资交易行为的监察稽核力度,建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估体系等。

报告期内,公司公平交易程序运作良好,未出现异常情况;场外、网下业务公平交易制度执行情况良好,未出现异常情况。

公司对旗下各投资组合的交易行为进行监控和分析,对各投资组合不同时间窗口(1日、3日、5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。

本报告期内,未出现违反公平交易制度的情况,公司旗下各基金不存在因非公平交易等导致的利益输送行为,公平交易制度的整体执行情况良好。

4.3.3 异常交易行为的专项说明

为规范投资行为,公平对待投资组合,制定《异常交易监控和报告办法》对可能显著影响市场价格、可能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

2015年,经济基本面继续疲弱,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。以基建投资扩张为核心的经济托底政策,无法充分对冲内需快速回落的冲击,只能在一定程度上延缓经济增速回落的速度,无法扭转整体的趋势。政策方面,经济下行压力大以及外汇流出加剧等因素使得货币政策依然处于宽松途中,央行多次进行了降准降息等宽松操作,呵护二季度以来流动性的宽松局面。资金面方面,得益于央行构建利率走廊的政策意图,资金利率稳定性显著提升。上半年股票市场的牛市给一级市场带来了较好的机会,下半年债券市场在基本面、政策面和资金面三方面配合,以及下半年资产荒格局下增量资金的涌入的条件下,债券收益率于2015年出现了显著下行,尤其是利率债收益率于四季度一举突破前期低点,走出了一轮牛市。

本基金在报告期内,以债券仓位为主,上半年大幅度提高了股票投资的比例并在三季度进行了较大幅度减持,选股以新兴成长和消费类股票为主,同时也积极参与了一级市场的打新机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2015年12月31日,本基金的基金份额净值为1.397元,本报告期份额净值增长率为18.89%,同期业绩比较基准增长率为3.82%。

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2016年,基本面方面,虽然指标增长政策的累积效应逐渐显现,但是经济下行压力仍存,且中央有意推进供给侧结构性改革,去产能过程将对经济增长形成进一步冲击,并且对CPI通胀也将形成制约,基本面对债市仍属利好。政策方面,虽然目前货币政策有转趋稳健的迹象,但在经济杠杆率较高、企业还本付息压力仍大的情况下,预计货币政策仍将维持稳健偏松态势。资金面方面,央行对于资金面的控制能力已经经过2015年的多重考验,而且目前央行也有动力维持资金面稳定,因此2016年资金面仍将维持相对稳定的态势,尤其是当经济下行压力较大,央行采取进一步降息操作之后,当前相对较高的资金利率也将相应下调,从而打开债券收益率进一步下行的空间。除此之外,我们认为资产稀缺的状况依旧具有持续性,资产荒的状况依旧难以改变,债市仍有增量资金入场。综合以上因素,债券市场行情整体仍将趋暖,总体仍不改长期牛市格局。

投资策略上,本基金将继续以债券仓位为主,同时将积极参与一级市场打新的机会,并且适当精选个股参与二级市场的机会。

4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构,负责制定公司所管理基金的基本估值政策,对公司旗下基金已采用的估值政策、方法、流程的执行情况进行审核监督,对因经营环境或市场变化等导致需调整已实施的估值政策、方法和流程的,负责审查批准基金估值政策、方法和流程的变更和执行。确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定,确保基金资产估值的公平、合理,有效维护投资人的利益。估值委员会由公司分管固定收益投资估值业务的高级管理人员、督察长、投资总监、分管估值业务的IT运维总监、投资研究部负责人组成。

公司基金估值委员会下设基金估值工作小组,由具备丰富专业知识、两年以上基金行业相关领域工作经历、熟悉基金投资品种定价及基金估值法律法规、具备较强专业胜任能力的基金经理、基金会计、风险管理人员及监察稽核人员组成。

基金经理作为估值工作小组的成员之一,在基金估值定价过程中,充分表达对相关问题及定价方案的意见或建议,参与估值方案提议的制定。但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。

参与估值流程的各方还包括本基金托管银行和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

报告期内,本基金管理人未与任何第三方签订与估值相关的定价服务。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

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。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内本基金管理人无应说明预警信息。

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内,本基金托管人在对天弘安康养老混合型证券投资基金的托管过程中,严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

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

本报告期内,天弘安康养老混合型证券投资基金的管理人--天弘基金管理有限公司在天弘安康养老混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上,不存在任何损害基金份额持有人利益的行为,在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期内,天弘安康养老混合型证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对天弘基金管理有限公司编制和披露的天弘安康养老混合型证券投资基金2015年年度报告中财务指标、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进行了核查,以上内容真实、准确和完整。

§6 审计报告

本报告期本基金财务会计报告经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)审计,该所出具了"无保留意见的审计报告",且在审计报告中无强调事项。投资者可通过年 度报告正文查看审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体:天弘安康养老混合型证券投资基金

报告截止日:2015年12月31日

单位:人民币元

资 产	附注号	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
资 产:			
银行存款	7.4.7.1	1,808,401.52	51,043,712.59
结算备付金		28,380,597.85	85,979,231.07
存出保证金		822,183.19	74,516.19
交易性金融资产	7.4.7.2	3,126,586,084.22	1,654,973,491.48
其中:股票投资		279,618,066.86	73,110,636.59
基金投资		-	-
债券投资		2,846,968,017.36	1,581,862,854.89
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	7.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	-	-
应收证券清算款		7,440,205.48	8,972,399.12
应收利息	7.4.7.5	75,424,351.28	44,029,829.17
应收股利		-	-
应收申购款		2,556,664.87	3,115.50
递延所得税资产		-	-
其他资产	7.4.7.6	-	-
资产总计		3,243,018,488.41	1,845,076,295.12
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年12月31日	上年度末 2014年12月31日
负 债:			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债	7.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		323,700,000.00	916,758,229.66
应付证券清算款		-	54,991,246.37
应付赎回款		8,399,991.15	5,962,515.85
应付管理人报酬		2,871,580.94	800,566.16
应付托管费		638,129.11	177,903.58
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	7.4.7.7	373,270.67	114,093.76
应交税费		-	-
应付利息		-	392,004.11
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	7.4.7.8	499,032.33	419,000.00
负债合计		336,482,004.20	979,615,559.49
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	2,080,056,562.43	736,377,437.70
未分配利润	7.4.7.10	826,479,921.78	129,083,297.93
所有者权益合计		2,906,536,484.21	865,460,735.63
负债和所有者权益总计		3,243,018,488.41	1,845,076,295.12

注:报告截止日2015年12月31日,份额净值1.397元,基金份额总额2,080,056,562.43份。

7.2 利润表

会计主体:天弘安康养老混合型证券投资基金

本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

项 目	附注号	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
一、收入		416,858,158.19	201,225,778.87
1.利息收入		183,233,493.03	86,885,125.82
其中:存款利息收入	7.4.7.11	3,361,033.72	1,477,010.01
债券利息收入		172,061,277.80	84,746,685.80
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		7,811,181.51	661,430.01
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		52,684,785.41	76,517,170.60
其中:股票投资收益	7.4.7.12	14,169,734.09	46,276,555.07
基金投资收益	7.4.7.13	-	-
债券投资收益	7.4.7.14	33,861,779.78	30,097,433.47
资产支持证券投资收益		-	-
贵金属投资收益	7.4.7.15	-	-
衍生工具收益	7.4.7.16	-	-
股利收益	7.4.7.17	4,653,271.54	143,182.06
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	7.4.7.18	100,414,751.35	20,288,734.31
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	7.4.7.19	80,525,128.40	17,534,748.14
减:二、费用		64,010,000.97	32,621,717.39
1.管理人报酬		37,688,375.07	12,461,783.45
2.托管费		8,375,194.43	2,769,285.23
3.销售服务费		-	-
4.交易费用	7.4.7.20	7,150,381.48	606,199.55
5.利息支出		10,331,414.80	16,288,667.29
其中:卖出回购金融资产支出		10,331,414.80	16,288,667.29
6.其他费用	7.4.7.21	464,635.19	495,781.87
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		352,848,157.22	168,604,061.48
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		352,848,157.22	168,604,061.48

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体:天弘安康养老混合型证券投资基金

本报告期:2015年1月1日至2015年12月31日

单位:人民币元

项 目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益(基金净值)	736,377,437.70	129,083,297.93	865,460,735.63
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	352,848,157.22	352,848,157.22
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)	1,343,679,124.73	344,548,466.63	1,688,227,591.36
其中:1.基金申购款	7,481,153,925.45	2,361,796,349.07	9,842,950,274.52
2.基金赎回款	-6,137,474,800.72	-2,017,247,882.44	-8,154,722,683.16
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)	2,080,056,562.43	826,479,921.78	2,906,536,484.21

项 目	上年度可比期间 2014年1月1日至2014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)	129,125,815.08	3,029,569.91	132,155,384.99
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	168,604,061.48	168,604,061.48
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)	607,251,622.62	-42,550,333.46	564,701,289.16
其中:1.基金申购款	2,171,537,275.32	167,660,924.49	2,339,198,199.81
2.基金赎回款	-1,564,285,652.70	-210,211,257.95	-1,774,496,910.65
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)	736,377,437.70	129,083,297.93	865,460,735.63

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 基金管理人负责人	韩海潮 主管会计工作负责人	薄贺龙 会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

天弘安康养老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[2012]1064号《关于核准天弘安康养老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《天弘安康养老混合型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型证券投资基金,首次设立募集不包括认购资金利息共募集329,475,073.08元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2012)第466号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《天弘安康养老混合型证券投资基金基金合同》于2012年11月28日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为329,530,789.56份基金份额,其中认购资金利息折合55,716.48份基金份额。本基金的基金管理人为天弘基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘安康养老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: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)、权证、债券等固定收益类金融工具(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、中期票据、可转换债券(含分离交易可转债)、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款等)及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金股票投资占基金资产的比例为0-30%,其中,投资于精选的价值型股票的比例不低于股票投资部分的80%,权证投资占基金资产净值的比例为0-3%;债券等固定收益类金融工具投资占基金资产的比例不低于70%,其中,现金及到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。自基金合同生效日期至2015年4月13日,本基金业绩比较基准:五年期银行定期存款利率(税后)。根据本基金的基金管理人于2015年4月14日发布的《天弘基金管理有限公司关于变更天弘安康养老混合型证券投资基金业绩比较基准并相应修改基金合同部分条款的公告》,自2015年4月14日起本基金的业绩比较基准更改为三年期银行定期存款利率(税后)+0.75%。

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2016年3月25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》、《天弘安康养老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。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2015年1月1日至2015年12月31日止期间的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2015年12月31日的财务状况以及2015年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策与最近一期年度会计报表所采用的会计政策一致,但会计估计(附注7.4.4.1)发生了变更。

7.4.4.1 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和债券,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

本基金本报告期末发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

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),鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息,本基金本报告期改为采用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》所独立提供的估值结果确定公允价值。

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[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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》及其他相关财税法规和实务操作,主要税项列示如下:

(1)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。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(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,股权的股息、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,于2015年9月8日前暂减按25%计入应纳税所得额,自2015年9月8日起,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关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
天弘基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构、注册登记机构
中国工商银行股份有限公司("中国工商银行")	基金托管人、基金销售机构
浙江蚂蚁小微金融服务集团有限公司	基金管理人的股东
天津信托有限责任公司	基金管理人的股东
内蒙古君正能源化工集团股份有限公司	基金管理人的股东
芜湖高新投资有限公司	基金管理人的股东
新疆天瑞博丰股权投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
新疆天惠新盟股权投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
新疆天阜恒基股权投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
新疆天聚宸兴股权投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
天弘创新资产管理有限公司("天弘创新")	基金管理人的全资子公司

注:1、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2、2015年度内,本基金管理人股东"内蒙古君正能源化工股份有限公司"的名称变更为"内蒙古君正能源化工集团股份有限公司"。

3、根据本基金管理人于2015年2月26日披露的关于完成增资扩股相关工商变更登记的公告,浙江蚂蚁小微金融服务集团有限公司、新疆天瑞博丰股权投资合伙企业(有限合伙)、新疆天惠新盟股权投资合伙企业(有限合伙)、新疆天阜恒基股权投资合伙企业(有限合伙)、新疆天聚宸兴股权投资合伙企业(有限合伙)为本基金管理人新增股东。

7.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.8.2 关联方报酬

7.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	37,688,375.07	12,461,783.45
其中:支付销售机构的客户维护费	5,440,156.80	4,496,931.61

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0.90%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 0.90% / 当年天数。

2.客户维护费是指基金管理人与基金销售机构在基金销售协议中约定的依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费,用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用,该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支,不属于从基金资产中列支的费用项目。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	8,375,194.43	2,769,285.23

注:支付基金托管人中国工商银行的托管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。其计算公式为:

日托管费=前一日基金资产净值 X 0.20% / 当年天数。

7.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

单位:人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	本期 2015年1月1日至2015年12月31日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国工商银行	-	-	-	-	1,395,400,000.00	313,076.75

单位:人民币元

银行间市场交易的各关联方名称	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日					
	债券交易金额		基金逆回购		基金正回购	
	基金买入	基金卖出	交易金额	利息收入	交易金额	利息支出
中国工商银行	134,219,416.98	-	-	-	31,000,000.00	2,615.50

7.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位:份

项目	本期 2015年1月1日至2015年12月31日	上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日
基金合同生效日(2012年11月28日)持有的基金份额	-	-
期初持有的基金份额	-	-
期间申购/买入总份额	90,771,558.25	-
期间因拆分变动份额	-	-
减:期间赎回/卖出总份额	-	-
期末持有的基金份额	90,771,558.25	-
期末持有的基金份额占基金总份额比例	4.36%	-

7.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.8.5 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 2015年1月1日至2015年12月31日		上年度可比期间 2014年1月1日至2014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
中国工商银行	1,808,401.52	2,039,586.27	51,043,712.59	287,828.15

注:本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管,按银行同业利率计息。

7.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

金额单位:人民币元

关联方名称	证券代码	证券名称	发行方式	基金在承销期内买入	
本期 2015年1月1日至2015年12月31日					
				数量	总金额
中国工商银行	041551015	15百联集CP001	新债网下分销	1000000	99,940,000.00
上年度可比期间 2014年1月1日至2014年12月31日					
				数量	数量
-	-	-	-	-	-

注:本基金上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券交易。

7.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.9 期末(2015年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 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:新发股票									
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
002778	高科石化	2015-12-28	2016-01-06	新股尚未上市流通	8.50	8.50	5,600	47,600.00	47,600.00
123001	蓝标转债	2015-12-23	2016-01-08	新股尚未上市流通	100.00	99.99	6,520	651,957.13	651,957.13

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。此外,基金还可作为特定投资者,认购由中国证监会《上市公司证券发行管理办法》规范的非公开发行股票,所认购的股票自发行结束之日起12个月内不得转让。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位:人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量(单位:股)	期末成本总额	期末估值总额
600153	建发股份	2015-06-29	重大资产重组	14.69	-	-	1,248,500	19,967,003.21	18,340,465.00

注:本基金截至2015年12月31日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票,该类股票将在所公布事项的重大影响消除后,经交易所批准复牌。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末(2015年12月31日),本基金未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2015年12月31日,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323,700,000.00元,于2016年1月4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。

§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	279,618,066.86	8.62
	其中:股票	279,618,066.86	8.62
2	固定收益投资	2,846,968,017.36	87.79
	其中:债券	2,846,968,017.36	87.79
	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	30,188,999.37	0.93
7	其他各项资产	86,243,404.82	2.66
8	合计	3,243,018,488.41	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	-	-
C	制造业	143,306,953.25	4.93
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	19,565,880.95	0.67
E	建筑业	195,136.20	0.01
F	批发和零售业	18,562,769.44	0.64
G	交通运输、仓储和邮政业	-	-
H	住宿和餐饮业	-	-
I	信息传输、软件和信息技术服务业	26,588,208.18	0.91
J	金融业	-	-
K	房地产业	-	-
L	租赁和商务服务业	14,548,254.00	0.50
M	科学研究和技术服务业	109,392.21	-
N	水利、环境和公共设施管理业	41,415,948.23	1.42
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	15,325,524.40	0.53
S	综合	-	-
	合计	279,618,066.86	9.62

8.3 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	603001	奥康国际	1,399,949	47,066,285.38	1.62
2	300070	碧水源	799,999	41,415,948.23	1.42
3	002184	海得控制	567,650	24,414,626.50	0.84
4	300182	捷成股份	1,000,000	24,000,000.00	0.83
5	300124	汇川技术	477,425	22,534,460.00	0.78
6	000669	金鸿能源	876,215	19,565,880.95	0.67
7	600153	建发股份	1,248,500	18,340,465.00	0.63
8	300178	腾邦国际	499,940	14,548,254.00	0.50
9	600136	道博股份	230,000	14,342,800.00	0.49
10	600660	福耀玻璃	871,200	13,233,528.00	0.46

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	300159	新研股份	120,786,171.37	13.96
2	600030	中信证券	79,712,576.14	9.21
3	600115	东方航空	69,967,632.25	8.08
4	600029	南方航空	69,909,797.69	8.08
5	300172	中电环保	60,126,925.79	6.95
6	002431	棕榈园林	53,130,497.20	6.14
7	000669	金鸿能源	50,377,533.86	5.82
8	300072	三聚环保	49,987,102.30	5.78
9	002074	国轩高科	49,965,211.97	5.77
10	300284	苏交科	45,790,050.92	5.29
11	600005	武钢股份	44,557,745.46	5.15
12	300070	碧水源	42,228,267.30	4.88
13	002154	报 喜 鸟	41,931,388.77	4.85
14	300124	汇川技术	41,257,164.21	4.77
15	600703	三安光电	39,999,514.68	4.62
16	600048	保利地产	39,999,335.00	4.62
17	600887	伊利股份	39,996,648.45	4.62
18	300017	网宿科技	39,996,086.80	4.62
19	000963	华东医药	39,989,632.60	4.62
20	002262	恩华药业	39,988,983.00	4.62
21	002477	雏鹰农牧	39,988,422.55	4.62
22	600363	联创光电	39,986,849.48	4.62
23	600221	海南航空	39,950,398.01	4.62
24	000800	一汽轿车	39,854,527.56	4.61
25	603555	贵人鸟	36,916,924.46	4.27
26	300392	腾信股份	35,976,159.69	4.16
27	603001	奥康国际	35,781,842.86	4.13
28	000035	中国天楹	34,928,309.52	4.04
29	300350	华鹏飞	34,110,380.02	3.94
30	002672	东江环保	32,547,189.86	3.76
31	002363	隆基机械	31,982,337.48	3.70
32	002437	誉衡药业	31,878,096.36	3.68
33	600872	中炬高新	31,746,382.98	3.67
34	002653	海思科	30,968,436.16	3.58
35	300182	捷成股份	30,570,888.40	3.53
36	000961	中南建设	29,990,637.34	3.47
37	002098	浔兴股份	29,942,055.47	3.46
38	300384	三联虹普	28,767,340.00	3.32
39	002249	大洋电机	28,202,803.61	3.26
40	600576	万家文化	24,987,371.80	2.89
41	300273	和佳股份	24,984,674.29	2.89
42	300251	光线传媒	24,633,888.10	2.85
43	600391	成发科技	24,070,614.02	2.78
44	300295	三六五网	22,867,923.50	2.64
45	300156	神雾环保	21,853,918.61	2.53
46	300367	东方网力	21,170,332.05	2.45
47	000657	中钨高新	20,852,550.17	2.41
48	600622	嘉宝集团	19,997,978.40	2.31
49	600409	三友化工	19,996,054.00	2.31
50	000024	招商地产	19,994,999.77	2.31
51	600358	国旅联合	19,994,311.00	2.31
52	600276	恒瑞医药	19,994,062.20	2.31
53	002145	中核钛白	19,989,523.02	2.31
54	300422	博世科	19,982,824.35	2.31
55	600426	华鲁恒升	19,980,922.48	2.31
56	002184	海得控制	19,975,711.90	2.31
57	002345	潮宏基	19,975,138.69	2.31
58	002267	陕天然气	19,967,052.75	2.31
59	600153	建发股份	19,967,003.21	2.31
60	000333	美的集团	19,964,032.69	2.31
61	000400	许继电气	19,856,917.82	2.29
62	002230	科大讯飞	19,765,626.05	2.28
63	600570	恒生电子	19,547,829.13	2.26

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	300159	新研股份	73,910,272.50	8.54
2	600029	南方航空	70,572,957.20	8.15
3	600115	东方航空	69,268,979.26	8.00
4	600030	中信证券	63,367,566.78	7.32
5	600005	武钢股份	58,333,298.88	6.74
6	000800	一汽轿车	56,367,439.75	6.51
7	000963	华东医药	55,881,960.07	6.46
8	603555	贵人鸟	50,344,293.26	5.82
9	300392	腾信股份	49,896,000.00	5.77
10	300350	华鹏飞	48,748,278.82	5.63
11	002437	誉衡药业	45,732,429.90	5.28
12	002431	棕榈园林	45,323,582.49	5.24
13	002074	国轩高科	45,008,632.32	5.20
14	300017	网宿科技	43,573,903.68	5.03
15	002154	报 喜 鸟	42,810,719.72	4.95
16	600048	保利地产	42,706,708.77	4.93
17	600703	三安光电	41,924,405.44	4.84
18	000035	中国天楹	41,910,950.44	4.84
19	000961	中南建设	39,884,357.84	4.61
20	300444	双杰电气	38,900,155.33	4.49
21	002363	隆基机械	37,184,054.06	4.30
22	300172	中电环保	36,280,966.74	4.19
23	300072	三聚环保	35,447,877.96	4.10
24	002262	恩华药业	35,414,871.52	4.09
25	600887	伊利股份	34,273,040.00	3.96
26	300152	科融环境	33,650,167.00	3.89
27	600221	海南航空	32,575,666.00	3.76
28	002672	东江环保	31,908,794.60	3.69
29	300384	三联虹普	31,395,409.60	3.63
30	300284	苏交科	30,821,630.62	3.56
31	600576	万家文化	29,580,760.00	3.42
32	600276	恒瑞医药	28,779,621.70	3.33
33	600872	中炬高新	28,523,501.85	3.30
34	002098	浔兴股份	28,103,073.10	3.25
35	000024	招商地产	27,315,091.02	3.16
36	002653	海思科	24,730,402.31	2.86
37	300273	和佳股份	24,545,452.22	2.84
38	002477	雏鹰农牧	23,849,305.92	2.76
39	000657	中钨高新	23,747,418.50	2.74
40	600391	成发科技	23,288,648.57	2.69
41	002249	大洋电机	23,008,379.07	2.66
42	600363	联创光电	22,856,350.00	2.64
43	300367	东方网力	22,484,355.72	2.60
44	000333	美的集团	21,767,202.96	2.52
45	600622	嘉宝集团	21,692,910.42	2.51
46	600409	三友化工	21,416,389.88	2.47
47	002271	东方雨虹	21,358,446.40	2.47
48	300251	光线传媒	21,323,640.40	2.46
49	000669	金鸿能源	19,919,642.31	2.30
50	002267	陕天然气	19,537,776.52	2.26
51	300156	神雾环保	19,258,513.58	2.23
52	600570	恒生电子	18,885,362.13	2.18
53	002230	科大讯飞	18,824,372.62	2.18
54	300182	捷成股份	17,695,736.64	2.04

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	2,444,475,878.92
卖出股票的收入(成交)总额	2,278,622,703.95

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	280,771,000.00	9.66
	其中:政策性金融债	280,771,000.00	9.66
4	企业债券	2,006,092,898.03	69.02
5	企业短期融资券	211,234,000.00	7.27
6	中期票据	340,703,000.00	11.72
7	可转债	8,167,119.33	0.28
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	2,846,968,017.36	97.95

注:可转债项下包含可交换债7,515,162.20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	150206	15国开06	1,500,000	150,645,000.00	5.18
2	1380231	13新郑债	1,000,000	104,710,000.00	3.60
3	011599500	15中油股SCP004	1,000,000	100,250,000.00	3.45
4	150301	15进出01	1,000,000	100,090,000.00	3.44
5	1280298	12奉化债	1,000,000	85,520,000.00	2.94

8.7 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。

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	822,183.19
2	应收证券清算款	7,440,205.48
3	应收股利	-
4	应收利息	75,424,351.28
5	应收申购款	2,556,664.87
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	86,243,404.82

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

金额单位:人民币元

序号	股票代码	股票名称	流通受限部分的公允价值	占基金资产净值比例(%)	流通受限情况说明
1	600153	建发股份	18,340,465.00	0.63	重大资产重组

8.12.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因,分项之和与合计项之间可能存在尾差。

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
230,104	9,039.64	1,062,013,852.89	51.06%	1,018,042,709.54	48.94%

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	359,465.47	0.02%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§10 开放式基金份额变动

单位:份

基金合同生效日(2012年11月28日)基金份额总额	329,530,789.56
本报告期期初基金份额总额	736,377,437.70
本报告期基金总申购份额	7,481,153,925.45
减:本报告期基金总赎回份额	6,137,474,800.72
本报告期基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	2,080,056,562.43

注:总申购份额含转换入份额;总赎回份额含转换出份额。

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内,天弘基金管理有限公司(以下简称"公司")股东会选举井贤栋先生、卢信群先生、袁雷鸣先生、屠剑威先生、付岩先生、郭树强先生、魏新顺先生、张军先生和贺强先生担任新一届董事会董事,其中井贤栋先生、袁雷鸣先生、屠剑威先生、张军先生和贺强先生为新任董事;公司董事会选举井贤栋先生为新一届董事会董事长(公司法定代表人),以上重大人事变动事宜已经依照相关规定履行备案程序。

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9万元。截至本报告期末,普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)已为天弘安康养老混合型证券投资基金提供审计服务38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	
安信证券	1	112,947,135.31	2.41%	105,186.40	2.45%	
渤海证券	1	-	-	-	-	
长江证券	1	472,624,771.50	10.08%	440,155.91	10.24%	
东兴证券	1	164,149,447.55	3.50%	149,442.03	3.48%	
广发证券	1	1,136,037,091.72	24.24%	1,034,248.65	24.07%	
国金证券	1	355,272,728.38	7.58%	323,440.22	7.53%	
国泰君安	2	456,754,270.08	9.74%	423,994.01	9.87%	
国信证券	1	303,538,669.00	6.48%	282,685.77	6.58%	
民族证券	1	284,641,234.27	6.07%	261,638.77	6.09%	
平安证券	1	449,004,514.66	9.58%	408,773.80	9.51%	
中金公司	1	952,484,830.75	20.32%	867,136.68	20.18%	

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
安信证券	20,771,200.00	2.54%	18,791,200,000.00	19.11%	-	-
渤海证券	359,910,315.55	44.03%	-	-	-	-
长江证券	27,997,380.00	3.43%	-	-	-	-
东兴证券	-	-	1,171,000,000.00	1.19%	-	-
广发证券	175,900,501.18	21.52%	1,766,500,000.00	1.80%	-	-
国金证券	62,650,681.63	7.66%	420,000,000.00	0.43%	-	-
国泰君安	90,243,719.86	11.04%	3,442,900,000.00	3.50%	-	-
国信证券	10,765,567.13	1.32%	1,132,224,000.00	1.15%	-	-
民族证券	20,532,735.25	2.51%	-	-	-	-
平安证券	-	-	-	-	-	-
中金公司	48,591,687.08	5.94%	71,615,800,000.00	72.82%	-	-

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状况稳定;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1个,其中包括:方正证券深圳交易单元1个;

4、本基金报告期内停止租用交易单元:无。

§12 影响投资者决策的其他重要信息

1、2015年度内,天弘基金管理有限公司(以下简称"公司")注册资本由1.8亿元人民币增加至5.143亿元人民币,浙江蚂蚁小微金融服务集团有限公司持有公司51%的股权。

2、2015年度内,公司住所由"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"变更为"天津自贸区(中心商务区)响螺湾旷世国际大厦A座1704-241号",上述住所变更已办理完毕工商变更登记。

3、由于中国人民银行已停止发布五年期银行定期存款利率,自2015年4月14日起,本基金业绩比较基准由"五年期银行定期存款利率(税后)"变更为"三年期银行定期存款利率(税后)+0.75%",上述变更事项对本基金份额持有人利益无实质性不利影响,投资者欲了解详细信息,敬请关注本基金管理人于2015年4月14日在指定媒介披露的《天弘基金管理有限公司关于变更天弘安康养老混合型证券投资基金业绩比较基准并相应修改基金合同部分条款的公告》中相关内容。

天弘基金管理有限公司

二〇一六年三月三十日