天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金

(原天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)转型)

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03月30日

§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25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。

自2015年5月7日天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)终止上市之日起,原天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)名称变更为天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金。原天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)本报告期自2015年1月1日至2015年5月6日止,天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金本报告期自2015年5月7日至2015年12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

2.1.1 天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金(转型后)	
基金名称	天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金
基金简称	天弘鑫动力混合
基金主代码	164205
交易代码	164205
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年05月07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	196,809,475.68份
基金合同存续期	不定期
2.1.2 天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)(转型前)	
基金名称	天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)
基金简称	天弘深证成份指数(LOF)
场内简称	天弘深成
基金主代码	164205
交易代码	164205
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2010年08月12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	62,053,556.54份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2010年09月17日

2.2 基金产品说明

2.2.1 天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金(转型后)	
投资目标	本基金通过资产配置和灵活运用多种投资策略,把握市场机会,在有效控制风险的前提下力求获取高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金采取灵活资产配置,主动投资管理的投资模式。在投资策略上,本基金从两个层次进行,首先是进行大类资产配置,在一定程度上尽可能地降低证券市场的系统性风险,把握市场波动中产生的投资机会;其次是采取自下而上的分析方法,从定量和定性两个方面,通过深入的基本面研究分析,精选具有良好投资价值的投资品种,构建投资组合。
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	本基金为混合型基金,属于中等风险、中等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。
2.2.2 天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)(转型前)	
投资目标	本基金通过被动的指数化投资管理,实现对深证成份指数的有效跟踪,力求将基金净值收益率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差控制在0.35%以内,年跟踪误差控制在4%以内。
投资策略	本基金为被动式指数基金,采用指数复制投资策略,按照个股在标的指数中的基准权重构建股票组合,并根据标的指数成份股及其权重的变动进行相应地调整,以复制和跟踪标的指数。 当预期指数成份股调整和成份股将发生分红、配股、增发等行为时,或者因特殊情况(如成份股停牌、成份股流动性受限等)导致基金无法有效复制和跟踪标的指数时,基金管理人可以对基金的投资组合进行适当调整,并可在条件允许的情况下,辅以金融衍生工具进行投资管理,以有效控制基金的跟踪误差。
业绩比较基准	深证成份指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%
风险收益特征	本基金为股票型基金,属于证券投资基金产品中高风险、高收益的基金品种,其风险收益预期高于货币市场基金、债券型基金和混合型基金。

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

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

§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(转型后)

金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2015年05月07日-2015年12月31日
本期已实现收益	75,767,019.88
本期利润	58,352,435.84
加权平均基金份额本期利润	0.0263
本期基金加权平均净值利润率	2.45%
本期基金份额净值增长率	17.03%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末
期末可供分配利润	-27,408,454.23
期末可供分配基金份额利润	-0.1393
期末基金资产净值	215,248,135.42
期末基金份额净值	1.0940
3.1.3 累计期末指标	2015年末
基金份额累计净值增长率	17.03%

3.2 主要会计数据和财务指标(转型前)

金额单位:人民币元

3.2.1 期间数据和指标	2015年01月01日-2015年05月06日	2014年	2013年
本期已实现收益	7,431,669.29	-9,649,589.79	-10,663,609.69
本期利润	18,065,821.33	16,533,914.15	-6,974,535.17
加权平均基金份额本期利润	0.2209	0.1939	-0.0723
本期基金加权平均净值利润率	23.19%	30.82%	-10.49%
本期基金份额净值增长率	25.66%	33.49%	-10.12%
3.2.2 期末数据和指标	2015年05月06日	2014年末	2013年末
期末可供分配利润	-12,061,010.52	-23,429,318.36	-31,945,140.76
期末可供分配基金份额利润	-0.1944	-0.2972	-0.3523
期末基金资产净值	67,462,830.42	68,170,922.48	58,722,274.03
期末基金份额净值	1.0870	0.8650	0.6480
3.2.3 累计期末指标	2015年05月06日	2014年末	2013年末
基金份额累计净值增长率	8.70%	-13.50%	-35.20%

注:1、2015年5月7日,原天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)转型为天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金。
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),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
3、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。
4、期末可供分配利润采用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。

3.3 基金净值表现(天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金)

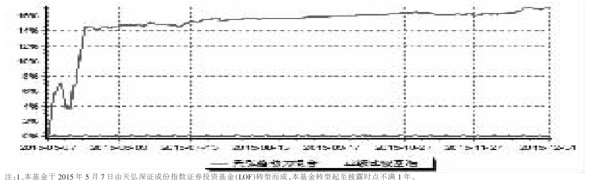
3.3.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较(转型后)

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	0.83%	0.09%	0.90%	0.01%	-0.07%	0.08%
过去六个月	1.86%	0.08%	1.90%	0.01%	-0.04%	0.07%
自基金合同生效日起至今(2015年05月07日-2015年12月31日)	17.03%	0.53%	2.56%	0.01%	14.47%	0.52%

注:天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金业绩比较基准为: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%。

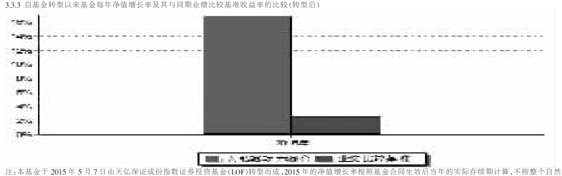
3.3.2 自基金转型以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较(转型后)

天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2015年05月07日-2015年12月31日)



注:1、本基金于2015年5月7日由天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)转型而成,本基金转型起至披露时点不满1年。
2、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5月7日-2015年11月6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。

3.3.3 自基金转型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(转型后)



注:本基金于2015年5月7日由天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)转型而成,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。

3.4 基金净值表现(天弘深证成份指数证券投资基金(LOF))

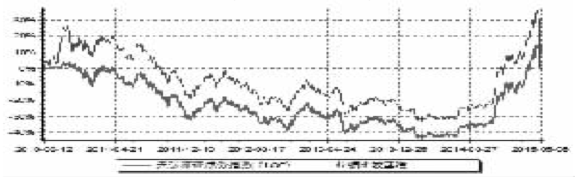
3.4.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较(转型前)

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	6.78%	1.76%	7.75%	1.68%	-0.97%	0.08%
过去六个月	25.66%	1.70%	27.67%	1.68%	-2.01%	0.02%
过去一年	84.24%	1.44%	87.79%	1.44%	-3.55%	0.00%
过去三年	46.10%	1.36%	47.46%	1.35%	-1.36%	0.01%
自基金合同生效日起至今(2010年08月12日-2015年05月06日)	8.70%	1.31%	30.88%	1.38%	-22.18%	-0.07%

注:天弘深证成份指数(LOF)业绩比较基准:深证成份指数收益率×95%+银行同业存款利率×5%。本基金是以深证成份指数为标的指数的被动式、指数型基金,以此为业绩比较基准,能够准确地反映本基金的投资绩效。

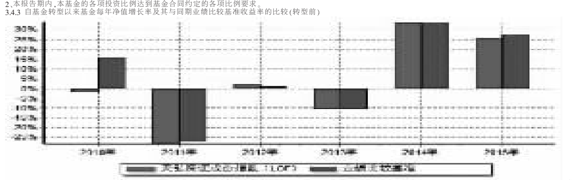
3.4.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较(转型前)

天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2010年08月12日-2015年05月06日)



注:1、本基金合同于2010年8月12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。

3.4.3 自基金转型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(转型前)



注:本基金合同于2010年8月12日生效。基金合同生效当年2010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。2015年的净值增长率按照基金转型前当年的实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.5 过去三年基金的利润分配情况

3.5.1 天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金(转型后)

本基金于2015年5月7日由天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)转型而成,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。

3.5.2 天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)(转型前)

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。	2015年6月	-	6年	女,经济学硕士,历任本公司固定收益研究员、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。	2015年6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。
李蕴炜	本基金基金经理。	2012年3月	2015年6月	9年	男,理学硕士,历任[illegible],Ophelge investment services运营分析师,2007年加盟本公司,历任交易员、行业研究员、高级研究员、股票研究部副总经理、基金经理助理、天弘永定价值成长混合型证券投资基金基金经理等。

注:1、上述任职日期为本基金管理人对外披露的任职日期,上述离任日期为本基金管理人对外披露的离任日期。
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

本基金管理人严格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。

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有关法律法规、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场外网下申购,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

为规范投资运作,防范投资风险,公司制定《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等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的原则。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与本基金管理人管理的其他投资组合之间的同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量5%的情况,也未发现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,经济基本面整体疲弱,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,[illegible]。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配合,以及下半年资产荒局面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。

报告期内,本基金成立之后初期我们保持较低的股票和债券仓位,积极参与了股票一级市场的机会,下半年则根据市场情况及时进行调整,以债券仓位为主,同时也持有部分股票参与二级市场的机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2015年5月6日,本基金份额净值为1.087元,本报告期份额净值增长率25.66%,同期业绩比较基准增长率27.67%。报告期内,日均跟踪误差为0.1608%,年化跟踪误差为2.4806%。

截至2015年12月31日,本基金份额净值为1.094元,本报告期份额净值增长率为17.03%,同期业绩比较基准增长率为2.56%。

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,虽然前期稳增长政策的累积效应逐渐显现,对经济有一定支撑作用,但是经济下行压力依然较大,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,基本面对债市仍偏利好。政策方面,[illegible]。

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估值政策、方法及流程的,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、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。

公司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

本基金本报告期内未进行利润分配,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鑫动力灵活配置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,天弘鑫动力灵活配置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鑫动力灵活配置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,天弘鑫动力灵活配置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鑫动力灵活配置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(天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金)

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 审计报告(天弘深证成份指数证券投资基金(LOF))

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。

§8 年度财务报表(天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金)

转型后:
报告期(2015年05月07日(基金合同转型日)-2015年12月31日)

8.1 资产负债表(转型后)

会计主体:天弘鑫动力灵活配置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
资产:		
银行存款	8.4.7.1	4,546,237.74
结算备付金		647,238.77
存出保证金		145,627.09
交易性金融资产	8.4.7.2	152,623,062.59
其中:股票投资		18,513,867.59
基金投资		-
债券投资		134,109,195.00
资产支持证券投资		-
贵金属投资		-
衍生金融资产	8.4.7.2	-
买入返售金融资产	8.4.7.3	100,000,350.00
应收证券清算款		-
应收利息	8.4.7.4	2,181,692.13
应收股利		-
应收申购款		5,772.92
递延所得税资产		-
其他资产	8.4.7.5	-
资产总计		260,149,981.24
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年12月31日
负债:		
短期借款		-
交易性金融负债		-
衍生金融负债	8.4.7.2	-
卖出回购金融资产款		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		43,675,255.82
应付管理人报酬		404,193.46
应付托管费		67,365.58
应付销售服务费		-
应付交易费用	8.4.7.6	121,528.12
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	8.4.7.7	633,502.84
负债合计		44,901,845.82
所有者权益:		
实收基金	8.4.7.8	169,257,426.42
未分配利润	8.4.7.9	45,990,709.00
所有者权益合计		215,248,135.42
负债和所有者权益总计		260,149,981.24

注:1.报告截止日2015年12月31日,基金份额净值1.094元,基金份额总额196,809,475.68份。
2.本财务报表的实际编制期间为2015年5月7日(基金合同生效日)至2015年12月31日。

8.2 利润表(转型后)

会计主体:天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金
本报告期:2015年05月07日(基金合同转型日)至2015年12月31日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2015年05月07日(基金合同转型日)至2015年12月31日
一、收入		86,971,075.39
1.利息收入		24,861,265.06
其中:存款利息收入	8.4.7.10	6,984,384.92
债券利息收入		10,874,638.52
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		7,002,241.62
其他利息收入		-
2.投资收益(损失以"-"填列)		52,147,287.28
其中:股票投资收益	8.4.7.11	49,334,241.31
基金投资收益		-
债券投资收益	8.4.7.12	1,643,642.83
资产支持证券投资收益		-
贵金属投资收益	8.4.7.13	-
衍生工具收益	8.4.7.14	-
股利收益	8.4.7.15	1,169,403.14
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	8.4.7.16	-17,414,584.04
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	8.4.7.17	27,377,107.09
减:二、费用		28,618,639.55
1.管理人报酬	8.4.10.2.	23,050,217.63
2.托管费	8.4.10.2.	3,841,702.83
3.销售服务费	8.4.10.2.	-
4.交易费用	8.4.7.18	1,076,433.18
5.利息支出		380,349.53
其中:卖出回购金融资产支出		380,349.53
6.其他费用	8.4.7.19	269,936.38
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		58,352,435.84
减:所得税费用		-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		58,352,435.84

8.3 所有者权益(基金净值)变动表(转型后)

会计主体:天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金
本报告期:2015年05月07日(基金合同转型日)至2015年12月31日

单位:人民币元

项目	本期 2015年05月07日(基金合同转型日)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)	62,053,556.54	5,409,273.88	67,462,830.42
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	58,352,435.84	58,352,435.84
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)	107,203,869.88	-17,771,000.72	89,432,869.16
其中:1.基金申购款	6,320,399,438.79	1,544,388,787.35	7,864,788,226.14
2.基金赎回款	-6,213,195,568.91	-1,562,159,788.07	-7,775,355,356.98
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)	169,257,426.42	45,990,709.00	215,248,135.42

报表附注为财务报表的组成部分。
本报告8.1至8.4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

8.4 报表附注(转型后)

8.4.1 基金基本情况

天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金(原名为天弘深证成份指数证券投资基金(LOF),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")证监基金字[2010]第666号《关于核准天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)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《天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币440,562,172.73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(2010)第203号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)基金合同》于2010年8月12日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为440,630,636.78份基金份额,其中认购资金利息折合68,464.05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。

经深圳证券交易所(以下简称"深交所")深证上字[2010]第281号文审核同意,本基金25,552,506份基金份额于2010年9月17日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外,基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据本基金份额持有人大会以通讯方式审议通过的《关于天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)转型有关事项的议案》,并经中国证监会备案证券基金机构监管部部函[2014]1249号核准,本基金的基金管理人天弘基金管理有限公司于2015年4月24日发布了《关于天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)基金份额持有人大会决议生效的公告》。根据《天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)转型方案说明书》以及相关法律法规的规定,经与基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致,基金管理人已将《天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)基金合同》、《天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)托管协议》修订为《天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金托管协议》,并已经中国证监会变更注册。《天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金托管协议》自本基金份额折算基准日次日,即2015年5月7日起生效,《天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)基金合同》、《天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)托管协议》自2015年5月7日失效。

天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)于2015年5月6日的基金资产净值为67462830.42元,已于《天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效日全部转为本基金的基金资产。根据《关于原天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)基金份额折算结果公告》的有关规定,本基金以2015年5月20日为基金份额折算基准日,对投资人持有的原天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)进行了折算,折算比例为1.16278180,折算后基金份额为72,140,292.33份。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资对象是具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票(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、中小企业私募债、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)、股指期货以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金股票投资占基金资产的比例范围为基金资产的0%-95%,每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为: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%。

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2015年3月25日批准报出。

8.4.2 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颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注8.4.4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。

8.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2015年5月7日(基金合同转型日)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5月7日(基金合同转型日)至2015年12月31日止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

8.4.4 重要会计政策和会计估计

8.4.4.1 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。本期财务报表的实际编制期间为2015年5月7日(基金合同生效日)至2015年12月31日。

8.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

8.4.4.3 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、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)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变动计入当期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划分为应收款项,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。

8.4.4.4 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其一部分。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。

8.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)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,按照其估值日在活跃市场上的市场报价确定公允价值。估值日无交易的,且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报价确定公允价值。

(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。

8.4.4.6 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。

8.4.4.7 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。

8.4.4.8 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)。

8.4.4.9 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,其公允价值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中转出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,实际利率与直线法差异较小的则按直线法计算。

8.4.4.10 费用的确认和计量

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

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

8.4.4.11 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(已实现部分扣减未实现部分)。

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。

8.4.4.12 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。

8.4.4.13 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固定收益品种按照中央国债登记结算有限责任公司独立提供的估值结果确定公允价值。

(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》所独立提供的估值结果确定公允价值。

8.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

8.4.5.1 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。

8.4.5.2 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。

8.4.5.3 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。

8.4.6 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。

8.4.7 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
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。

8.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

8.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

8.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行股票交易。

8.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期未通过关联方交易单元进行权证交易。

8.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期末均无应支付关联方的佣金。

8.4.8.2 关联方报酬

8.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2015年05月07日(基金合同转型日)至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	23,050,217.63
其中:支付销售机构的客户维护费	341,961.84

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1.5%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日管理人报酬=前一日基金资产净值X1.5%/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。

8.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2015年05月07日(基金合同转型日)至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	3,841,702.83

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0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日托管费=前一日基金资产净值X0.25%/当年天数。

8.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

8.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

8.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金的情况。

8.4.8.4.2 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

本基金本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

8.4.8.5 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05月07日(基金合同转型日)至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	4,546,237.74	4,439,935.12

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。

8.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期未在承销期内参与关联方承销证券交易。

8.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

8.4.9 期末(2015年12月31日)本基金持有的流通受限证券

8.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

8.4.9.2 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股票。

8.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

8.4.9.3.1 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。

8.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2015年12月31日,本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

§9 年度财务报表(天弘深证成份指数证券投资基金(LOF))

转型前:
报告期(2015年01月01日-2015年05月06日)

9.1 资产负债表(转型前)

会计主体:天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)
报告截止日:2015年05月06日

单位:人民币元

资产	附注号	本期末 2015年05月06日	上年度末 2014年12月31日
资产:			
银行存款	9.4.7.1	4,822,484.80	4,774,391.21
结算备付金		-	609.58
存出保证金		7,804.86	2,370.75
交易性金融资产	9.4.7.2	62,818,221.97	64,358,340.88
其中:股票投资		62,818,221.97	64,358,340.88
基金投资		-	-
债券投资		-	-
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	9.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	9.4.7.4	-	-
应收证券清算款		1,225,243.16	-
应收利息	9.4.7.5	12,483.31	1,082.34
应收股利		-	-
应收申购款		779,372.59	59,669.23
递延所得税资产		-	-
其他资产	9.4.7.6	-	-
资产总计		69,665,610.69	69,196,463.99
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年05月06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	9.4.7.3	-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	-
应付赎回款		1,676,826.88	412,390.76
应付管理人报酬		10,153.06	40,930.62
应付托管费		2,030.61	8,186.09
应付销售服务费		-	-
应付交易费用	9.4.7.7	16,662.05	2,909.29
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	9.4.7.8	497,107.67	561,124.75
负债合计		2,202,780.27	1,025,541.51
所有者权益:			
实收基金	9.4.7.9	62,053,556.54	78,846,489.83
未分配利润	9.4.7.10	5,409,273.88	-10,675,567.35
所有者权益合计		67,462,830.42	68,170,922.48
负债和所有者权益总计		69,665,610.69	69,196,463.99

注:1.报告截止日2015年5月6日(基金合同失效前日),基金份额净值1.087元,基金份额总额62,053,556.54份。
2.本财务报表的实际编制期间为2015年1月1日至2015年5月6日。

9.2 利润表(转型前)

会计主体:天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)
本报告期:2015年01月01日至2015年05月06日

单位:人民币元

项目	附注号	本期 2015年01月01日至2015年05月06日	上年度可比期间 2014年01月01日至2014年12月31日
一、收入		18,596,435.29	17,781,011.01
1.利息收入		25,469.10	28,975.74
其中:存款利息收入	9.4.7.11	25,469.10	28,975.74
债券利息收入		-	-
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		-	-
其他利息收入		-	-
2.投资收益(损失以"-"填列)		7,784,220.67	-8,439,687.31
其中:股票投资收益	9.4.7.12	7,608,426.79	-9,502,737.64
基金投资收益		-	-
债券投资收益	9.4.7.13	-	-
资产支持证券投资收益	9.4.7.13	-	-
贵金属投资收益	9.4.7.14	-	-
衍生工具收益	9.4.7.15	-	-
股利收益	9.4.7.16	175,793.88	1,063,050.33
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	9.4.7.17	10,634,152.04	26,183,503.94
4.汇兑收益(损失以"-"号填列)		-	-
5.其他收入(损失以"-"号填列)	9.4.7.18	152,593.48	8,218.64
减:二、费用		530,613.96	1,247,096.86
1.管理人报酬	9.4.10.2.	204,573.75	402,240.59
2.托管费	9.4.10.2.	40,914.70	80,448.13
3.销售服务费	9.4.10.2.	-	-
4.交易费用	9.4.7.19	65,489.72	48,301.03
5.利息支出		-	-
其中:卖出回购金融资产支出		-	-
6.其他费用	9.4.7.20	219,635.79	716,107.11
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		18,065,821.33	16,533,914.15
减:所得税费用		-	-
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		18,065,821.33	16,533,914.15

9.3 所有者权益(基金净值)变动表(转型前)

会计主体:天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)
本报告期:2015年01月01日至2015年05月06日

单位:人民币元

项目	本期 2015年01月01日至2015年05月06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)	78,846,489.83	-10,675,567.35	68,170,922.48
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	18,065,821.33	18,065,821.33
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)	-16,792,933.29	-1,980,980.10	-18,773,913.39
其中:1.基金申购款	130,499,989.00	-4,373,032.59	126,126,956.41
2.基金赎回款	-147,292,922.29	2,392,052.49	-144,900,869.80
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)	62,053,556.54	5,409,273.88	67,462,830.42

项目	上年度可比期间 2014年01月01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)	90,667,414.79	-31,945,140.76	58,722,274.03
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	16,533,914.15	16,533,914.15
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)	-11,820,924.96	4,735,659.26	-7,085,265.70
其中:1.基金申购款	15,555,288.00	-4,886,137.29	10,669,150.71
2.基金赎回款	-27,376,212.96	9,621,796.55	-17,754,416.41
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)	78,846,489.83	-10,675,567.35	68,170,922.48

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

9.4 报表附注(转型前)

9.4.1 基金基本情况

天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)(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")证监基金字[2010]第666号《关于核准天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)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《天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集人民币440,562,172.73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(2010)第203号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)基金合同》于2010年8月12日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为440,630,636.78份基金份额,其中认购资金利息折合68,464.05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。

经深圳证券交易所(以下简称"深交所")深证上字[2010]第281号文审核同意,本基金25,552,506份基金份额于2010年9月17日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外,基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据本基金份额持有人大会以通讯方式审议通过的《关于天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)转型有关事项的议案》,并经中国证监会备案证券基金机构监管部部函[2014]1249号核准,本基金的基金管理人天弘基金管理有限公司于2015年4月24日发布了《关于天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)基金份额持有人大会决议生效的公告》。根据《天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)转型方案说明书》以及相关法律法规的规定,经与基金托管人中国工商银行股份有限公司协商一致,基金管理人已将《天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)基金合同》、《天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)托管协议》修订为《天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金托管协议》,并已经中国证监会变更注册。《天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》、《天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金托管协议》自本基金份额折算基准日次日,即2015年5月7日起生效,《天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)基金合同》、《天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)托管协议》自2015年5月7日失效。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)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,包括深证成份指数成份股、备选成份股、新股(首次公开发行或增发)、债券、货币市场工具及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金采用指数复制投资策略,股票资产跟踪的标的指数为深证成份指数,资产配置比例为:股票资产投资比例不低于基金资产净值的90%-95%,其中,投资于深证成份指数成份股和备选成份股的资产不低于股票资产的90%;现金、债券资产及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他证券品种占基金资产的比例为5%-10%,其中,权证投资占基金资产净值的比例为0%-3%,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%。本基金力求将基金净值收益率与业绩比较基准之间的日平均跟踪误差控制在0.35%以内,年跟踪误差控制在4%以内。本基金的业绩比较基准为:深证成份指数收益率X 95%+银行同业存款利率X 5%。

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。

9.4.2 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颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)基金合同》和如财务报表附注9.4.4所示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

经中国证监会批准,基金管理人天弘基金管理有限公司将本基金于基金合同失效日转型为鑫动力灵活配置混合基金并相应延长存续期至不定期,因此本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

9.4.3 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2015年5月6日(基金合同失效前日)的财务状况以及2015年1月1日至2015年5月6日(基金合同失效前日)止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

9.4.4 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。

9.4.4.1 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的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下:

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

9.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

9.4.5.1 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。

9.4.5.2 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。

9.4.5.3 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。

9.4.6 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。

9.4.7 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
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。

9.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

9.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

9.4.8.1.1 股票交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行股票交易。

9.4.8.1.2 权证交易

本基金本报告期及上年度可比期间均未通过关联方交易单元进行权证交易。

9.4.8.1.3 应支付关联方的佣金

本基金本报告期末及上年度末均无应支付关联方的佣金。

9.4.8.2 关联方报酬

9.4.8.2.1 基金管理费

单位:人民币元

项目	本期 2015年01月01日至2015年05月06日	上年度可比期间 2014年01月01日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	204,573.75	402,240.59
其中:支付销售机构的客户维护费	85,472.46	182,453.07

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0.75%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X0.75%/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。

9.4.8.2.2 基金托管费

单位:人民币元

项目	本期 2015年01月01日至2015年05月06日	上年度可比期间 2014年01月01日至2014年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	40,914.70	80,448.13

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0.15%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日托管费=前一日基金资产净值X0.15%/当年天数。

9.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期及上年度可比期间未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

9.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

9.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间基金管理人未运用固有资金投资本基金的情况。

9.4.8.4.2 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

本基金本报告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。

9.4.8.5 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01月01日至2015年05月06日		上年度可比期间 2014年01月01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	4,822,484.80	23,512.61	4,774,391.21	28,813.06

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。

9.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券交易。

9.4.8.7 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。

9.4.9 期末(2015年05月06日)本基金持有的流通受限证券

9.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

9.4.9.2 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	期末成本总额	期末估值总额
000024	招商地产	2015-04-03	重大事项	33.93	2015-09-24	28.48	57805	1,212,104.19	1,961,323.65
000783	长江证券	2015-05-04	重大事项	17.54	2015-05-14	18.00	142863	983,222.23	2,505,817.02

注:本基金截至2015年5月6日(基金合同失效前日)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。

9.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

9.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2015年5月6日止,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。

9.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2015年5月6日止,本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

§10 投资组合报告(天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金)

转型后:
报告期(2015年05月07日-2015年12月31日)

10.1 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	18,513,867.59	7.12
	其中:股票	18,513,867.59	7.12
2	固定收益投资	134,109,195.00	51.55
	其中:债券	134,109,195.00	51.55
	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	100,000,350.00	38.44
	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	5,193,476.51	2.00
7	其他各项资产	2,333,092.14	0.90
8	合计	260,149,981.24	100.00

10.2 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	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	-	-
C	制造业	17,812,182.62	8.28
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	-	-
F	批发和零售业	222,304.44	0.01
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	369,988.32	0.17
J	金融业	-	-
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	109,392.21	0.05
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	18,513,867.59	8.60

10.3 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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002415	海康威视	357,258	12,286,102.62	5.71
2	000858	五粮液	200,000	5,456,000.00	2.53
3	300493	润欣科技	7,248	299,632.32	0.14
4	002780	三夫户外	3,566	222,304.44	0.10
5	300492	山鼎设计	6,219	109,392.21	0.05
6	002777	久远银海	4,264	70,356.00	0.03
7	002785	万里石	12,000	70,080.00	0.03

10.4 报告期内股票投资组合的重大变动

10.4.1 累计买入金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600029	南方航空	49,973,831.00	74.08
2	600887	伊利股份	39,993,080.18	59.28
3	601111	中国国航	39,991,965.30	59.28
4	600276	恒瑞医药	29,990,313.25	44.45
5	600687	刚泰控股	29,918,025.64	44.35
6	600358	国旅联合	29,600,540.04	43.88
7	600010	包钢股份	12,999,566.00	19.27
8	600660	福耀玻璃	12,997,208.06	19.27
9	000858	五粮液	12,988,627.00	19.25
10	002415	海康威视	12,977,363.53	19.24
11	000651	格力电器	7,999,218.00	11.86
12	600886	国投电力	7,998,088.00	11.86
13	300471	厚普股份	2,724,966.53	4.04
14	603979	金诚信	1,135,622.97	1.68
15	300473	德尔股份	823,830.20	1.22
16	300476	胜宏科技	738,885.29	1.10
17	603589	口子窖	722,688.00	1.07
18	603616	韩建河山	567,500.00	0.84
19	300470	日机密封	549,448.00	0.81
20	002765	蓝黛传动	506,634.18	0.75

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。

10.4.2 累计卖出金额超出期末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600029	南方航空	64,301,847.05	95.31
2	601111	中国国航	43,720,935.96	64.81
3	600358	国旅联合	36,246,927.95	53.73
4	600887	伊利股份	31,275,059.70	46.36
5	600687	刚泰控股	29,196,155.43	43.28
6	600276	恒瑞医药	27,583,694.17	40.89
7	600660	福耀玻璃	12,978,728.76	19.24
8	600010	包钢股份	12,720,460.00	18.86
9	000651	格力电器	12,558,080.05	18.61
10	000858	五粮液	9,207,009.65	13.65
11	600886	国投电力	7,632,430.00	11.31
12	300471	厚普股份	6,159,938.70	9.13
13	000002	万科A	4,667,105.32	6.92
14	000001	平安银行	3,338,791.80	4.95
15	000333	美的集团	2,884,521.56	4.28
16	000776	广发证券	2,380,751.47	3.53
17	603979	金诚信	2,228,929.80	3.30
18	002024	苏宁云商	2,228,644.40	3.30
19	000783	长江证券	1,920,303.46	2.85
20	000166	申万宏源	1,892,273.39	2.80
21	601968	宝钢包装	1,823,971.00	2.70
22	300476	胜宏科技	1,692,223.00	2.51
23	000024	招商地产	1,663,104.75	2.47
24	002415	海康威视	1,639,813.24	2.43
25	000063	中兴通讯	1,625,799.04	2.41
26	300473	德尔股份	1,625,033.50	2.41
27	000100	TCL集团	1,591,577.80	2.36
28	300104	乐视网	1,555,643.77	2.31
29	603589	口子窖	1,539,147.00	2.28
30	000725	京东方A	1,512,187.76	2.24
31	000625	长安汽车	1,505,792.20	2.23
32	002762	金发拉比	1,484,408.40	2.20
33	000768	中航飞机	1,465,751.46	2.17
34	002230	科大讯飞	1,350,580.46	2.00

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。

10.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票成本(成交)总额	301,830,754.80
卖出股票收入(成交)总额	376,705,565.29

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。

10.5 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	50,055,000.00	23.25
	其中:政策性金融债	50,055,000.00	23.25
4	企业债券	20,920,000.00	9.72
5	企业短期融资券	60,335,000.00	28.03
6	中期票据	-	-
7	可转债	2,799,195.00	1.30
8	其他	-	-
9	合计	134,109,195.00	62.30

注:可转债项下包含可交换债2799195.00元。

10.6 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	150413	15农发13	500,000	50,055,000.00	23.25
2	1580192	15郑州经开债	200,000	20,920,000.00	9.72
3	041551023	15沪强生CP001	200,000	20,150,000.00	9.36
4	041558020	15中原高速CP001	100,000	10,118,000.00	4.70
5	041554045	15昆山经技CP002	100,000	10,038,000.00	4.66

10.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

10.8 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。

10.9 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。

10.10 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。

10.11 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。

10.12 投资组合报告附注

10.12.1 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。

10.12.2 基金投资的前十名股票中,没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

10.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	145,627.09
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	2,181,692.13
5	应收申购款	5,772.92
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,333,092.14

10.12.4 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。

10.12.5 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中不存在流通受限的情况。

10.12.6 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。

§11 投资组合报告(天弘深证成份指数证券投资基金(LOF))

转型前:
报告期(2015年01月01日-2015年05月06日)

11.1 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	62,818,221.97	90.17
	其中:股票	62,818,221.97	90.17
2	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	4,822,484.80	6.92
7	其他各项资产	2,024,903.92	2.91
8	合计	69,665,610.69	100.00

注:1、报告截止日2015年5月6日(基金合同失效前日),基金份额净值1.087元,基金份额总额62,053,556.54份。
2、本财务报表的实际编制期间为2015年1月1日至2015年5月6日(基金合同失效前日)。

11.2 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	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	采矿业	713,145.85	1.06
C	制造业	32,513,995.31	48.20
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
E	建筑业	976,159.08	1.45
F	批发和零售业	2,324,398.17	3.45
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	3,432,005.75	5.09
J	金融业	12,321,757.45	18.26
K	房地产业	7,128,396.93	10.57
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	2,287,069.27	3.39
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	1,121,294.16	1.66
S	综合	-	-
	合计	62,818,221.97	93.12

11.3 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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000651	格力电器	87,917	4,571,684.00	6.78
2	000002	万科A	318,528	4,319,239.68	6.40
3	000001	平安银行	238,280	3,745,761.60	5.55
4	000776	广发证券	109,147	2,941,511.65	4.36
5	000333	美的集团	79,866	2,725,826.58	4.04
6	000783	长江证券	142,863	2,505,817.02	3.71
7	002024	苏宁云商	150,837	2,324,398.17	3.45
8	000166	申万宏源	132,327	2,289,257.10	3.39
9	000063	中兴通讯	71,466	1,981,752.18	2.94
10	000024	招商地产	57,805	1,961,323.65	2.91

11.4 报告期内股票投资组合的重大变动

11.4.1 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	000166	申万宏源	2,959,354.00	4.34
2	000001	平安银行	694,601.00	1.02
3	002456	欧菲光	657,709.75	0.96
4	000333	美的集团	630,380.78	0.92
5	000002	万科A	461,156.00	0.68
6	000783	长江证券	424,563.60	0.62
7	000651	格力电器	400,024.00	0.59
8	002594	比亚迪	379,349.21	0.56
9	000776	广发证券	371,664.00	0.55
10	002415	海康威视	330,095.00	0.48
11	000024	招商地产	255,932.00	0.38
12	300104	乐视网	238,343.00	0.35
13	000338	潍柴动力	228,216.00	0.33
14	002142	宁波银行	214,459.00	0.31
15	000625	长安汽车	202,086.00	0.30
16	002024	苏宁云商	188,113.00	0.28
17	000858	五粮液	158,712.00	0.23
18	000063	中兴通讯	150,382.00	0.22
19	000725	京东方A	145,722.00	0.21
20	300027	华谊兄弟	132,681.00	0.19

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。

11.4.2 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	000002	万科A	2,324,940.07	3.41
2	000651	格力电器	1,830,458.05	2.69
3	000001	平安银行	1,777,846.17	2.61
4	000776	广发证券	1,496,716.36	2.20
5	000333	美的集团	1,185,837.95	1.74
6	000166	申万宏源	1,145,587.90	1.68
7	002024	苏宁云商	1,011,266.10	1.48
8	000783	长江证券	949,122.89	1.39
9	000625	长安汽车	849,471.92	1.25
10	000100	TCL集团	822,308.66	1.21
11	000063	中兴通讯	785,144.37	1.15
12	300104	乐视网	776,539.66	1.14
13	000858	五粮液	772,989.95	1.13
14	000725	京东方A	711,760.75	1.04
15	002415	海康威视	704,223.74	1.03
16	000983	西山煤电	681,264.92	1.00
17	000338	潍柴动力	631,324.40	0.93
18	002594	比亚迪	581,646.06	0.85
19	000768	中航飞机	570,671.37	0.84
20	000157	中联重科	545,758.38	0.80

注:本项的"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。

11.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

单位:人民币元

买入股票成本(成交)总额	10,842,803.16
卖出股票收入(成交)总额	30,625,500.90

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。

11.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

11.6 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

11.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名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。

11.8 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。

11.9 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。

11.10 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。

11.11 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。

11.12 投资组合报告附注

11.12.1 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。

11.12.2 基金投资的前十名股票中,没有投资超出基金合同规定备选股票库之外的股票。

11.12.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	7,804.86
2	应收证券清算款	1,225,243.16
3	应收股利	-
4	应收利息	12,483.31
5	应收申购款	779,372.59
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	2,024,903.92

11.12.4 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。

11.12.5 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	000024	招商地产	1,961,323.65	2.91	重大事项公布
2	000783	长江证券	2,505,817.02	3.71	重大事项公布

11.12.6 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。

§12 基金份额持有人信息(天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金)

转型后:
报告期(2015年05月07日-2015年12月31日)

12.1 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
3,947	49,863.05	156,553,366.93	79.55%	40,256,108.75	20.45%

12.2 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	3,402.56	0.002%

12.3 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。

§13 基金份额持有人信息(天弘深证成份指数证券投资基金(LOF))

转型前:
报告期(2015年01月01日-2015年05月06日)

13.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位:份

份额级别	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
天弘深证成份指数(LOF)	3,136	19,787.49	17,642.30	0.03%	62,035,914.24	99.97%
合计	3,136	19,787.49	17,642.30	0.03%	62,035,914.24	99.97%

13.2 期末上市基金前十名持有人

13.2.1 天弘深证成份指数(LOF)

序号	持有人名称	持有份额(份)	占上市总份额比例
1	魏涛	104,900.00	14.46%
2	陈志英	90,000.00	12.41%
3	李淑珍	62,100.00	8.56%
4	杨小燕	45,651.00	6.29%
5	张小平	40,900.00	5.64%
6	王莉琴	30,000.00	4.14%
7	吴献生	29,653.00	4.09%
8	郑金庆	27,400.00	3.78%
9	李小劲	24,100.00	3.32%
10	叶杰州	20,300.00	2.80%

13.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数(份)	占基金总份额比例
基金管理公司所有从业人员持有本开放式基金	天弘深证成份指数(LOF)	324,947.78	0.524%
	合计	324,947.78	0.524%

13.4 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

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

§14 开放式基金份额变动

14.1 开放式基金份额变动(转型后)

单位:份

项目	天弘鑫动力混合
基金转型生效日(2015年05月07日)基金份额总额	62,053,556.54
本报告期期初基金份额总额	62,053,556.54
本基金转型生效日起至报告期期末基金总申购份额	7,349,861,970.43
减:本基金转型生效日起至报告期期末基金总赎回份额	7,225,205,217.51
本基金转型生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	10,099,166.22
本报告期期末基金份额总额	196,809,475.68

14.2 开放式基金份额变动(转型前)

单位:份

项目	天弘深证成份指数(LOF)
基金合同生效日(2010年08月12日)基金份额总额	440,630,636.78
本报告期期初基金份额总额	78,846,489.83
本报告期期间基金总申购份额	130,499,989.00
减:本报告期期间基金总赎回份额	147,292,922.29
本报告期期间基金拆分变动份额	-
本报告期期末基金份额总额	62,053,556.54

§15 重大事件揭示

15.1 基金份额持有人大会决议

自2015年3月20日起至2015年4月21日17:00止,天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)基金份额持有人大会以通讯方式召开,会议审议通过了《关于天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)转型有关事项的议案》。根据《公开募集证券投资基金运作管理办法》的有关规定,基金份额持有人大会决定的事项自表决通过之日起生效。根据2015年4月22日的计票结果,本次会议议案获得通过,本次大会决议自2015年4月22日起生效。本基金管理人已将表决通过的事项报中国证监会备案。根据深圳证券交易所《终止上市通知书》(深证上[2015]174号),天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)已于2015年5月7日终止上市。自终止上市之日起,原《天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)基金合同》失效,《天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》生效。

15.2 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。

15.3 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。

15.4 基金投资策略的改变

本报告期内,转型后的天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金与原天弘深证成份指数证券投资基金(LOF)相比,在投资目标、投资范围、投资策略、投资限制、业绩比较基准、风险收益特征等内容均有所调整。调整后的上述内容可查阅本基金管理人于2015年5月6日在指定媒介披露的《天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金基金合同》中的相关约定。

15.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内应向普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)支付服务费6万元整。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)已为天弘鑫动力混合基金提供审计服务5年。

15.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况

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。

15.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位:人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		债券交易		债券回购交易		权证交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占股票成交总额比例	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	佣金	占当期佣金总量的比例	
渤海证券	2	359,308,865.57	51.29%	-	-	454,000,000.00	1.13%	-	-	329,272.69	51.42%	
国泰君安	2	58,834,585.81	8.40%	2,127,302.61	100.00%	-	-	-	-	53,878.67	8.41%	
东兴证券	1	4,068,942.72	0.58%	-	-	-	-	-	-	3,704.38	0.58%	
海通证券	1	193,126,043.45	27.57%	-	-	39,768,800,000.00	98.87%	-	-	175,821.19	27.46%	
平安证券	1	21,882,577.95	3.12%	-	-	-	-	-	-	19,922.03	3.11%	
国金证券	1	61,718,122.61	8.81%	-	-	-	-	-	-	56,188.38	8.78%	
长江证券	1	1,639,813.24	0.23%	-	-	-	-	-	-	1,527.17	0.24%	

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。

§16 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。

天弘基金管理有限公司
二〇一六年三月三十日