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:2016年3月30日

天弘永定价值成长混合型证券投资基金

2015 年度 报告摘要

2015年12月31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。
基金托管人兴业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。
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	115,596,935.37份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	在合理控制风险的基础上,追求基金资产的长期稳健增值。与投资人创造绝对收益。
投资策略	本基金为主动管理的混合型基金,主要投资于沪深A股市场上成长性较好、估值水平具有比较优势的上市公司,以及国内债券市场上利息债、金融债、企业债、可转债债券以及权证、货币市场工具等投资品种。本基金投资组合股票方面,精选个股+行业配置+股票、债券等资产间动态配置的投资策略,以优化基金净值收益。
业绩比较基准	沪深300指数收益率×80%+上证国债指数收益率×20%。
风险收益特征	本基金为主动投资的混合型基金,属于风险较高、收益较高的证券投资基金产品。本基金的风险与预期收益高于债券型基金和货币市场基金,低于股票型基金。

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		天弘基金管理有限公司	兴业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	聂建林	蔡志永
	联系电话	022-83331028	021-62677777*212004
	电子邮箱	service@thfund.com.cn	zhangdy@cib.com.cn
客户服务电话		4007109999	95561
传真		022-83865569	021-62539237

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

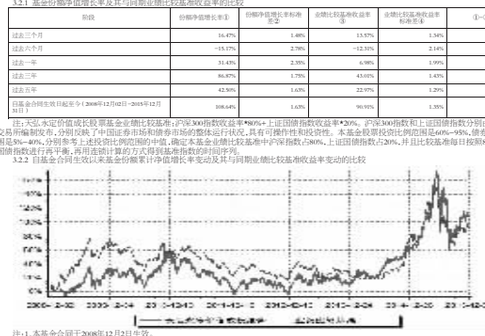
金额单位:人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2015年	2014年	2013年
本期已实现收益	70,584,278.04	36,269,903.51	4,612,859.27
本期利润	70,679,573.74	33,91,4,644.74	2,644,540.66
加权平均基金份额本期利润	0.4258	0.3319	0.0356
本期基金份额净值增长率	31.43%	41.80%	0.27%
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	0.5244	0.1904	-0.1605
期末基金资产净值	180,852,050.23	143,392,456.16	54,252,540.32
期末基金份额净值	1.5645	1.1904	0.8395

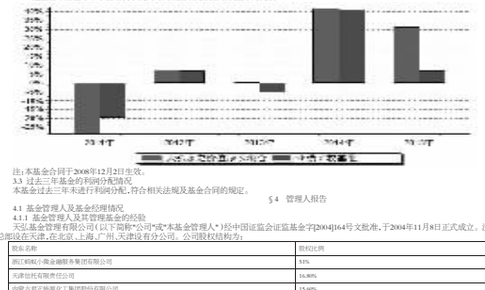
注:1.所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用(例如,开放式基金的申购赎回费等),计入费用后实际收益水平要低于所列数字。
2.本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入(不含公允价值变动收益)扣除相关费用后的余额,本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。
3.期末可供分配利润采用期末资产负债表本分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。
3.2 基金净值表现
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

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	16.47%	1.48%	13.57%	1.34%	2.90%	0.14%
过去六个月	-15.17%	2.78%	-12.31%	2.14%	-2.86%	0.64%
过去一年	31.43%	2.35%	6.98%	1.99%	24.45%	0.36%
过去三年	42.50%	1.63%	22.97%	1.29%	19.53%	0.34%
自基金合同生效日起至今(2008年12月23日-2015年12月31日)	108.64%	1.63%	90.90%	1.35%	17.73%	0.28%

注:天弘永定价值成长股票基金业绩比较基准:沪深300指数收益率*80%+上证国债指数收益率*20%。沪深300指数和上证国债指数分别由中证指数有限公司和上海证券交易所编制发布,分别以她人了中国证券市场和债券市场的整体运行状况,具有可操作性和投资性。本基金股票投资比例范围为60%-95%,债券和短期金融工具的投资比例范围为5%-40%,分别参考上述投资比例范围的中值,确定本基金业绩比较基准中沪深指数占80%,上证国债指数占20%,并且比较基准每日按照80%和20%对沪深300指数和上证国债指数进行再平衡,再用连续计算的方式得到基准指数的时间序列。
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注:1.本基金合同于2008年12月23日生效。
2.本报告期内,本基金的各项投资比例达到基金合同约定的各项比例要求。
3.2.3 过去五年基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注:本基金合同于2008年12月23日生效。
3.3 过去三年基金的利润分配情况
本基金过去三年未进行利润分配,符合相关法规及基金合同的规定。

§4 管理人报告

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

股东名称	股权比例
浙江蚂蚁小微金融服务集团有限公司	51%
天津经托有限责任公司	16.80%
内蒙古君正能源化工集团股份有限公司	15.60%
宏图高新投资有限公司	5.60%
新疆天瑞博丰股权投资合伙企业(有限合伙)	3.50%
新疆天惠新盛股权投资合伙企业(有限合伙)	2%
新疆天阜信基股权投资合伙企业(有限合伙)	2%
新疆天赐富兴股权投资合伙企业(有限合伙)	3.50%
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、天弘永定价值成长股票型证券投资基金、天弘周期策略混合型证券投资基金、天弘盛动力灵活配置混合型证券投资基金、天弘证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、天弘安康养老混合型证券投资基金、天弘安康养老混合型证券投资基金、天弘稳利定期开放债券型证券投资基金、天弘信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、天弘福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证券投资基金、天弘普惠养老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、天弘中证金融地产指数型发起式证券投资基金、天弘中证全指证券公司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、天弘中证申万宏源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、天弘中证海螺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500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、天弘证宝货币市场基金、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		
肖志刚	本基金基金经理、投资研究部总经理。	2014年1月	—	9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4月加盟本公司,历任股票研究部总经理、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 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。
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投权、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》和公司内部规外,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交易行为配置的原则或比例分配比例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督稽核工作,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;公司内、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核验,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,公司旗下基金本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
无规范投资行为、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,和定期监控、分析和的控措施。
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,以公司名义进行的申购一般市场申购的申购方式进行操作和监控,保证分配比例原则的公平性。报告期内,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单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1季度,市场将结束前年底一步反转大气,经过2014年4季度的风格切换行情,以蓝筹股为代表的回归,和底部活跃于全市场的活跃度,也即时激活了融资融券成为市场最主要的资金来源。市场在没有经济基本面支撑的情况下,维持了一段时间的上涨,在2季度开始了去泡沫的过程。
由于在1季度过去结束了市场最活跃的阶段,到了2季度,其基本用于,市场进入更为快速的行情,在股价涨幅、市盈率、市净率等方面,都有了明显上升,在位则做了适当下降。
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投资则日渐活跃。
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。
4.4.2 报告期内基金的业绩表现
截至2015年12月31日,本基金份额净值为1.5645元,本报告期份额净值增长率31.43%,同期业绩比较基准增长率6.98%。
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4季度,以史为鉴,回顾过去,我们大概可以看出,分别是1991年、2007年、2014年,其中近两次牛市,分别与互联网、移动互联网的普及有着密切关系。
从CNNIC公布的网民数可以看出,2006-2007年是中国网民数快速增长的阶段,且增速在2008年初见顶回落至今,而在这之前,互联网快速应用在游戏市场,催生了当时的网游巨涉,如盛大、到了2013年起,以微信为代表的移动互联网快速普及,如果跟踪微信的用户数增长,能观察到就至目前的峰值出现在2015年7月。
A股历来是一个资金驱动型市场,伴随着互联网的普及,投资者触达交易的便利性大增,使得以往线投资者数量的上升,这一点从2014年起的A股交易量剧增得到佐证,同时2007年市场交易额也得到了数量级的提升,以至于两次牛市中,无论是利润还是投资,提升幅度最大的就是各板块。可以说,在新技术的推动下,使得能够触达交易的投资者数量出现数量级的上升,并因此推动市场动来再轮互联网红利,是A股近两次牛市的最大特点。
如果从这个角度看,A股目前或正处于移动互联网红利爆发的阶段,预计2016年市场将迎来回归常态,市场机会将主要出现在逐级下行中的反弹。
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,对因市场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,负责审定调整已实施的估值政策、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、公募基金业务部门和基金监督、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资产净值计算、份额申购赎回价格、收益分配等的合法性、准确性、及时性进行监督和复核。托管人根据法律法规要求对基金资产估值方法的合理性、合规性发表意见。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。
4.7 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 报告期内管理人及其高级管理人员持有本基金份额变动情况的说明
本报告期内本基金管理人无应说明披露信息。

§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,本基金托管人在对天弘永定价值成长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,天弘永定价值成长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永定价值成长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,天弘永定价值成长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永定价值成长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对,认为内容真实、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鉴别审计报告全文。

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表
会计主体:天弘永定价值成长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	34,639,098.77	26,164,055.26
结算备付金		2,261,580.63	1,110,555.68
存出保证金		1,044,887.51	226,005.45
交易性金融资产	7.4.7.2	148,890,865.44	132,323,616.01
其中:股票投资		148,890,865.44	132,323,616.01
基金投资		—	—
债券投资		—	—
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
衍生金融资产	7.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	7.4.7.4	—	—
应收证券清算款		2,428,558.44	—
应收利息	7.4.7.5	24,623.02	17,497.76
应收股利		—	—
应收申购款		54,335.48	1,041,941.38
递延所得税资产		—	—
其他资产	7.4.7.6	—	—
资产总计		189,344,549.29	160,891,651.54

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		—	—
应付证券清算款		5,757,948.47	13,238,952.23
应付赎回款		890,322.97	2,767,062.10
应付管理人报酬		239,773.30	205,901.28
应付托管费		39,962.22	34,318.21
应付销售服务费		—	—
应付交易费用	7.4.7.7	1,057,608.34	839,486.68
应交税费		39,378.70	39,378.70
应付利息		—	—
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	7.4.7.8	467,505.06	374,088.28
负债合计		8,492,499.06	17,499,195.48
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	115,596,935.37	120,456,640.43
未分配利润	7.4.7.10	65,255,114.86	22,935,815.63
所有者权益合计		180,852,050.23	143,392,456.06
负债和所有者权益合计		189,344,549.29	160,891,651.54

注:报告截止日2015年12月31日,基金份额净值1.5645元,基金份额总额115,596,935.37份。
7.2 利润表
会计主体:天弘永定价值成长混合型证券投资基金
本报告期: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		87,438,954.67	38,879,145.96
1.利息收入		1,096,795.26	523,356.81
其中:存款利息收入	7.4.7.11	1,096,795.26	523,356.81
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)		85,114,484.19	40,426,869.70
其中:股票投资收益	7.4.7.12	82,899,337.41	40,072,784.97
基金投资收益	7.4.7.13	—	—
债券投资收益	7.4.7.14	—	—
资产支持证券投资收益		—	—
贵金属投资收益	7.4.7.15	—	—
衍生工具收益	7.4.7.16	—	—
股利收益	7.4.7.17	2,217,126.78	354,086.73
3.公允价值变动收益(损失以"-"号填列)	7.4.7.18	95,295.71	-2,355,264.77
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	1,220,469.52	284,178.22
减:二.费用		16,759,380.93	4,964,501.22
1.管理人报酬		3,808,389.79	1,714,262.23
2.托管费		634,731.63	285,710.31
3.销售服务费		—	—
4.交易费用	7.4.7.20	11,936,377.15	2,382,064.78
5.利息支出		—	—
其中:卖出回购金融资产支出		—	—
6.其他费用	7.4.7.21	385,882.39	582,463.90
三、利润总额(亏损总额以"-"号填列)		70,679,573.74	33,914,644.74
减:所得税费用		—	—
四、净利润(净亏损以"-"号填列)		70,679,573.74	33,914,644.74

7.3 所有者权益(基金净值)变动表
会计主体:天弘永定价值成长混合型证券投资基金
本报告期: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			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	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一.期初所有者权益(基金净值)	120,456,640.43	22,935,815.63	143,392,456.06	54,252,540.32	—	54,252,540.32
二.本期经营活动产生的基金净值变动(本期利润)	—	70,679,573.74	70,679,573.74	—	33,914,644.74	33,914,644.74
三.本期基金份额交易产生的基金净值变动(本期净申购数)	-4,859,704.06	-286,360,274.52	-291,219,978.58	66,204,099.68	388,900,171.78	455,104,271.46
其中:1.基金申购款	4,158,295.27	244,198,494.82	248,356,790.09	66,491,721.98	390,711,701.58	457,203,423.56
2.基金赎回款	-9,017,999.33	-530,558,769.34	-539,576,768.67	-287,622.30	-1,811,529.80	-2,099,152.10
四.本期向投资者分配利润产生的基金净值变动(净值减少以"-"号填列)	—	—	—	—	—	—
五.期末所有者权益(基金净值)	115,596,935.37	65,255,114.86	180,852,050.23	120,456,640.43	22,935,815.63	143,392,456.06

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:

聂桂国	韩春雨	陈贺龙
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注
7.4.1 基金基本情况
天弘永定价值成长混合型证券投资基金(原名为天弘永定价值成长股票型证券投资基金,以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2008]1755号《关于核准天弘永定价值成长股票型证券投资基金募集的批复》核准,由天弘基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘永定价值成长股票型证券投资基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集291,076,882.00元,业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2008)第184号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《天弘永定价值成长股票型证券投资基金合同》于2008年12月23日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为291,108,692.74份基金份额,其中认购资金利息折合31,810.74份基金份额。本基金的基金管理人为天弘基金管理有限公司,基金托管人为兴业银行股份有限公司。
根据2014年中国证监会令第104号《公开募集证券投资基金运作管理办法》,天弘永定价值成长股票型证券投资基金于2015年08月08日公告后更名为天弘永定价值成长混合型证券投资基金。
根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《天弘永定价值成长混合型证券投资基金基金合同》和最新公告的《天弘永定价值成长混合型证券投资基金招募说明书(更新)》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票、债券、货币市场工具、权证、资产支持证券以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金股票投资比例范围是基金资产的60%-95%;现金、债券、权证及中国证监会允许基金投资的其他证券品种的投资比例范围是基金资产的5%-40%;现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金的业绩比较基准为:沪深300指数收益率X80%+上证国债指数收益率X20%。
本财务报表由本基金的基金管理人天弘基金管理有限公司于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13号-年度报告和半年度报告》,中国证券投资基金业协会公示下简称"中国基金业协会")颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》,《天弘永定价值成长混合型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会、中国基金业协会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。
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 重要会计政策和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政策与最近一期年度报告相一致的说明
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投资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《中国证券业协会基金估值工作小组关于停牌股票估值的参考方法》提供的指数收益法等估值技术进行估值。
7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明
7.4.5.1 会计政策变更的说明
本基金本报告期无会计政策变更。
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[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》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应税范围,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,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,暂减按25%计入应纳税所得额。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
兴业银行股份有限公司(兴业银行)	基金托管人,基金代销机构
浙江蚂蚁小微金融服务集团有限公司	基金管理人的股东
天津经托有限责任公司	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
宏图高新投资有限公司	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
新疆天惠新盛股权投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
新疆天阜信基股权投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
新疆天赐富兴股权投资合伙企业(有限合伙)	基金管理人的股东
天弘创业投资(天津)有限公司(天弘创投)	基金管理人的全资子公司

注:1.下述关联交易均以正常业务范围内按一般商业条款订立。
2.2015年度内,本基金管理人授权"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12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)、新疆天惠新盛股权投资合伙企业(有限合伙)、新疆天阜信基股权投资合伙企业(有限合伙)、新疆天赐富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 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	3,808,389.79	1,714,262.23
其中:支付销售机构的客户维护费	400,627.09	425,028.79

注:1.支付基金管理人大成基金管理有限公司的管理人报酬按前一日基金资产净值1.50%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日管理人报酬=前一日基金资产净值X1.50%/当年天数。
2.客户维护费是指基金管理人与基金销售机构在基金销售协议中约定的依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费,用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用,该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支,不属于从基金资产中再次的费用项目。
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	634,731.60	285,710.31

注:1.支付基金托管人兴业银行的托管费按前一日基金资产净值0.25%的年费率计提,逐日累计至每月月底,按月支付。其计算公式为:日托管费=前一日基金资产净值X0.25%/当年天数。
7.4.8.3 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。
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: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
基金合同生效日(2008年12月23日)持有的基金份额	—	—
期初持有的基金份额	6,353,124.04	6,353,124.04
期间申购/买入总份额	—	—
期间因拆分变动份额	—	—
减:期间赎回/卖出总份额	—	—
期末持有的基金份额	6,353,124.04	6,353,124.04
期末持有的基金份额占基金总份额比例	5.50%	5.27%

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
兴业银行活期存款	34,639,098.77	919,799.39	26,164,055.26	510,022.02

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。
7.4.8.6 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。
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。