

## 天弘丰利债券型证券投资基金(LOF)

### 2016 第二季度 报告

2016年6月30日

基金管理人:天弘基金管理有限公司  
基金托管人:中国银河证券股份有限公司  
报告送出日期:2016年7月19日

**1.1 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、准确性和完整性承担个别及连带责任。  
基金托管人中国银河证券股份有限公司根据本基金合同规定,于2016年7月18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、误导性陈述或者重大遗漏。  
本报告所载数据截止日为2016年6月30日,财务数据未经审计。  
基金的投资业绩并不预示其未来业绩,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。  
本基金合同于2016年4月1日起正式生效。  
本基金合同于2016年4月1日起正式生效。

**1.2 基金产品概况**

基金名称	天弘丰利债券(LOF)
基金代码	420009
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年11月28日
报告期末基金份额总额	1,910,047,487.82份
投资目标	本基金在追求基金资产长期增值的基础上,力求获得超过业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金在追求基金资产长期增值的基础上,力求获得超过业绩比较基准的投资收益。本基金在追求基金资产长期增值的基础上,力求获得超过业绩比较基准的投资收益。本基金在追求基金资产长期增值的基础上,力求获得超过业绩比较基准的投资收益。
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	本基金为债券型基金,属于证券投资基金中较低风险的投资品种,其风险收益特征与同期银行存款利率相近。
基金管理人	天弘基金管理有限公司
基金托管人	中国银河证券股份有限公司

### 3.1 主要财务指标

主要财务指标		报告期(2016年4月1日至2016年6月30日)	
1.本期已实现收益		22,739,571.90	
2.本期利润		2,148,739.61	
3.本期基金份额持有人申购金额		1,009,000.00	
4.本期基金份额持有人赎回金额		2,120,747,967.06	
5.本期基金份额净值		1.1103	

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。  
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。

**3.2 自基金合同成立以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益变动的比较**

**3.3 自基金转型以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益变动的比较**

**4.1 基金经理(或基金经理小组)简介**

姓名	职务	任职日期	截止日期	证券从业年限	说明
魏明	基金经理	2016年11月	-	14年	男,工商管理硕士,历任华泰证券基金事业部副经理、华泰证券基金事业部副经理、华泰证券基金事业部副经理、华泰证券基金事业部副经理、华泰证券基金事业部副经理。

注:1.上述任职日期为基金合同生效日。  
2.证券从业年限指从事证券行业(含基金)从业年限。  
3.基金经理魏明先生,曾任华泰证券基金事业部副经理、华泰证券基金事业部副经理、华泰证券基金事业部副经理、华泰证券基金事业部副经理、华泰证券基金事业部副经理。

**4.2 基金管理人报告期内基金运作遵规守信情况说明**  
本基金按照国家法律法规及基金合同的约定进行操作,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;公平对待不同投资品种,禁止各投资组合之间进行利益输送为目的的投资交易活动;在确保各投资组合投资标的符合投资限制的前提下,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标的管理流程和审批程序,保证不同投资组合之间的重大公平交易信息的相互隔离;加强对投资行为的合规性监督,建立有效的异常交易行为日常监控分析体系等。

**4.4 报告期内基金的投资策略和业绩分析**  
报告期内,本基金投资策略执行情况良好,未出现异常波动。场内、场外公平交易制度执行情况良好,未出现异常波动。

**4.5 报告期内基金的投资策略和业绩分析**  
报告期内,本基金投资策略执行情况良好,未出现异常波动。场内、场外公平交易制度执行情况良好,未出现异常波动。

**4.6 报告期内基金的投资策略和业绩分析**  
报告期内,本基金投资策略执行情况良好,未出现异常波动。场内、场外公平交易制度执行情况良好,未出现异常波动。

**4.7 报告期内基金的投资策略和业绩分析**  
报告期内,本基金投资策略执行情况良好,未出现异常波动。场内、场外公平交易制度执行情况良好,未出现异常波动。

**4.8 报告期内基金的投资策略和业绩分析**  
报告期内,本基金投资策略执行情况良好,未出现异常波动。场内、场外公平交易制度执行情况良好,未出现异常波动。

**4.9 报告期内基金的投资策略和业绩分析**  
报告期内,本基金投资策略执行情况良好,未出现异常波动。场内、场外公平交易制度执行情况良好,未出现异常波动。

**4.10 报告期内基金的投资策略和业绩分析**  
报告期内,本基金投资策略执行情况良好,未出现异常波动。场内、场外公平交易制度执行情况良好,未出现异常波动。

**4.11 报告期内基金的投资策略和业绩分析**  
报告期内,本基金投资策略执行情况良好,未出现异常波动。场内、场外公平交易制度执行情况良好,未出现异常波动。

**4.12 报告期内基金的投资策略和业绩分析**  
报告期内,本基金投资策略执行情况良好,未出现异常波动。场内、场外公平交易制度执行情况良好,未出现异常波动。

**4.13 报告期内基金的投资策略和业绩分析**  
报告期内,本基金投资策略执行情况良好,未出现异常波动。场内、场外公平交易制度执行情况良好,未出现异常波动。

**4.14 报告期内基金的投资策略和业绩分析**  
报告期内,本基金投资策略执行情况良好,未出现异常波动。场内、场外公平交易制度执行情况良好,未出现异常波动。

**4.15 报告期内基金的投资策略和业绩分析**  
报告期内,本基金投资策略执行情况良好,未出现异常波动。场内、场外公平交易制度执行情况良好,未出现异常波动。

**4.16 报告期内基金的投资策略和业绩分析**  
报告期内,本基金投资策略执行情况良好,未出现异常波动。场内、场外公平交易制度执行情况良好,未出现异常波动。

**4.17 报告期内基金的投资策略和业绩分析**  
报告期内,本基金投资策略执行情况良好,未出现异常波动。场内、场外公平交易制度执行情况良好,未出现异常波动。

**4.18 报告期内基金的投资策略和业绩分析**  
报告期内,本基金投资策略执行情况良好,未出现异常波动。场内、场外公平交易制度执行情况良好,未出现异常波动。

**4.19 报告期内基金的投资策略和业绩分析**  
报告期内,本基金投资策略执行情况良好,未出现异常波动。场内、场外公平交易制度执行情况良好,未出现异常波动。

**4.20 报告期内基金的投资策略和业绩分析**  
报告期内,本基金投资策略执行情况良好,未出现异常波动。场内、场外公平交易制度执行情况良好,未出现异常波动。

**4.21 报告期内基金的投资策略和业绩分析**  
报告期内,本基金投资策略执行情况良好,未出现异常波动。场内、场外公平交易制度执行情况良好,未出现异常波动。

**4.22 报告期内基金的投资策略和业绩分析**  
报告期内,本基金投资策略执行情况良好,未出现异常波动。场内、场外公平交易制度执行情况良好,未出现异常波动。

**4.23 报告期内基金的投资策略和业绩分析**  
报告期内,本基金投资策略执行情况良好,未出现异常波动。场内、场外公平交易制度执行情况良好,未出现异常波动。

**4.24 报告期内基金的投资策略和业绩分析**  
报告期内,本基金投资策略执行情况良好,未出现异常波动。场内、场外公平交易制度执行情况良好,未出现异常波动。

**4.25 报告期内基金的投资策略和业绩分析**  
报告期内,本基金投资策略执行情况良好,未出现异常波动。场内、场外公平交易制度执行情况良好,未出现异常波动。

**4.26 报告期内基金的投资策略和业绩分析**  
报告期内,本基金投资策略执行情况良好,未出现异常波动。场内、场外公平交易制度执行情况良好,未出现异常波动。

**4.27 报告期内基金的投资策略和业绩分析**  
报告期内,本基金投资策略执行情况良好,未出现异常波动。场内、场外公平交易制度执行情况良好,未出现异常波动。

**4.28 报告期内基金的投资策略和业绩分析**  
报告期内,本基金投资策略执行情况良好,未出现异常波动。场内、场外公平交易制度执行情况良好,未出现异常波动。

**4.29 报告期内基金的投资策略和业绩分析**  
报告期内,本基金投资策略执行情况良好,未出现异常波动。场内、场外公平交易制度执行情况良好,未出现异常波动。

**4.30 报告期内基金的投资策略和业绩分析**  
报告期内,本基金投资策略执行情况良好,未出现异常波动。场内、场外公平交易制度执行情况良好,未出现异常波动。

经济、货币政策维持稳健,三季度虽然仍有降准空间,但降息及OMO利率下调概率不大。资金面方面,央行着力建立利率走廊制度,资金面波动显著下降,央行公开市场操作利率对资金利率起到的作用,资金利率得以回落下行,债券市场收益率进一步下行,综合以上因素,债券市场收益率三季度将呈现区间波动的态势。

投资策略上,综合上述判断,组合仍以资质较好信用债为主,同时根据经济及政策形势变化及时调整组合仓位,继续为投资者创造稳健收益。

**5 投资组合报告**  
**5.1 报告期末基金资产组合情况**

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-
2	其中:股票	-	-
3	固定收益投资	1,909,996,556.80	89.92
4	其中:银行存款	1,909,996,556.80	89.92
5	资产支持证券	-	-
6	贵金属投资	-	-
7	买入返售金融资产	-	-
8	其他金融资产投资	-	-
9	其中:买入返售金融资产	-	-
10	其他金融资产投资	-	-
11	银行存款和结算备付金合计	19,858,938.73	0.95
12	其他金融资产投资	93,246,682.81	4.61
13	其他金融资产投资	2,126,696,062.34	100.00

**5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合**  
本基金本报告期末未持有股票。

**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细**  
本基金本报告期末未持有股票。

**5.4 报告期末按券种分类的债券投资组合**

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	140,154,000.00	6.61
4	其中:政策性金融债	140,154,000.00	6.61
5	企业债券	1,015,070,116.60	47.86
6	企业短期融资券	578,479,000.00	17.47
7	中期票据	879,204,000.00	17.88
8	可转换(可交换)债	5,089,440.20	0.23
9	其他	-	-
10	其他	-	-
11	其他	-	-
12	其他	-	-
13	其他	-	-
14	其他	-	-
15	其他	-	-
16	其他	-	-
17	其他	-	-
18	其他	-	-
19	其他	-	-
20	其他	-	-
21	其他	-	-
22	其他	-	-
23	其他	-	-
24	其他	-	-
25	其他	-	-
26	其他	-	-
27	其他	-	-
28	其他	-	-
29	其他	-	-
30	其他	-	-
31	其他	-	-
32	其他	-	-
33	其他	-	-
34	其他	-	-
35	其他	-	-
36	其他	-	-
37	其他	-	-
38	其他	-	-
39	其他	-	-
40	其他	-	-
41	其他	-	-
42	其他	-	-
43	其他	-	-
44	其他	-	-
45	其他	-	-
46	其他	-	-
47	其他	-	-
48	其他	-	-
49	其他	-	-
50	其他	-	-
51	其他	-	-
52	其他	-	-
53	其他	-	-
54	其他	-	-
55	其他	-	-
56	其他	-	-
57	其他	-	-
58	其他	-	-
59	其他	-	-
60	其他	-	-
61	其他	-	-
62	其他	-	-
63	其他	-	-
64	其他	-	-
65	其他	-	-
66	其他	-	-
67	其他	-	-
68	其他	-	-
69	其他	-	-
70	其他	-	-
71	其他	-	-
72	其他	-	-
73	其他	-	-
74	其他	-	-
75	其他	-	-
76	其他	-	-
77	其他	-	-
78	其他	-	-
79	其他	-	-
80	其他	-	-
81	其他	-	-
82	其他	-	-
83	其他	-	-
84	其他	-	-
85	其他	-	-
86	其他	-	-
87	其他	-	-
88	其他	-	-
89	其他	-	-
90	其他	-	-
91	其他	-	-
92	其他	-	-
93	其他	-	-
94	其他	-	-
95	其他	-	-
96	其他	-	-
97	其他	-	-
98	其他	-	-
99	其他	-	-
100	其他	-	-

**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**

序号	股票代码	债券简称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	140004	14国债附息(TN01)	1,200,000	122,184,000.00	5.76
2	140058	14国债附息(TN02)	1,000,000	102,280,000.00	5.13
3	0405107	10国债附息(TN01)	1,000,000	109,900,000.00	4.78
4	121216	11国债附息(TN01)	800,000	81,574,000.00	3.91
5	121275	11国债附息(TN01)	800,000	81,344,000.00	3.84

**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**  
本基金本报告期末未持有国债期货。

**5.11 投资组合报告附注**  
**5.11.1 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。**

**5.11.2 报告期内基金投资的前十名股票中超出基金合同规定之备选股票范围的说明**  
本基金本报告期末未持有股票,故不存在所投资的前十名股票中超出基金合同规定之备选股票范围的情况。

**5.11.3 其他资产构成**

序号	名称	金额
1	应收利息	23,567.42
2	应收股利	15,037,500.00
3	应收申购款	43,910,664.84
4	其他应收款	27,418,958.95
5	其他	-
6	其他	-
7	其他	-
8	其他	-
9	其他	-
10	其他	-
11	其他	-
12	其他	-
13	其他	-
14	其他	-
15	其他	-
16	其他	-
17	其他	-
18	其他	-
19	其他	-
20	其他	-
21	其他	-
22	其他	-
23	其他	-
24	其他	-
25	其他	-
26	其他	-
27	其他	-
28	其他	-
29	其他	-
30	其他	-
31	其他	-
32	其他	-
33	其他	-
34	其他	-
35	其他	-
36	其他	-
37	其他	-
38	其他	-
39	其他	-
40	其他	-
41	其他	-
42	其他	-
43	其他	-
44	其他	-
45	其他	-
46	其他	-
47	其他	-
48	其他	-
49	其他	-
50	其他	-
51	其他	-
52	其他	-
53	其他	-
54	其他	-
55	其他	-
56	其他	-
57	其他	-
58	其他	-
59	其他	-
60	其他	-
61	其他	-
62	其他	-
63	其他	-
64	其他	-
65	其他	-
66	其他	-
67	其他	-
68	其他	-
69	其他	-
70	其他	-
71	其他	-
72	其他	-
73	其他	-
74	其他	-
75	其他	-
76	其他	-
77	其他	-
78	其他	-
79	其他	-
80	其他	-
81	其他	-
82	其他	-
83	其他	-
84	其他	-
85	其他	-
86	其他	-
87	其他	-
88	其他	-
89	其他	-
90	其他	-
91	其他	-
92	其他	-
93	其他	-
94	其他	-
95	其他	-
96	其他	-
97	其他	-
98	其他	-
99	其他	-
100	其他	-

**5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	110008	电气转债	2,610,856.50	0.12
2	120020	15广核EB	1,192,621.59	0.06
3	000001	浦发转债	1,049,939.80	0.05

**5.11.5 报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明**  
本基金本报告期末未持有股票。

**5.11.6 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。

**5.6 开放式基金投资组合**

序号	代码	名称	数量(份)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	002013	广发货币	2,371,14		