



天弘余额宝货币市场基金

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
基金托管人中国银行股份有限公司
报告送出日期2016年7月19日

1.1 重要提示
基金管理人天弘基金管理有限公司董事会及监事会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。
基金托管人中国银行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、误导性陈述或重大遗漏。
本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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失或本金增值。基金的投资与业绩并不代表其未来表现，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。
本报告刊登日期为2016年7月19日起至2016年6月30日止。

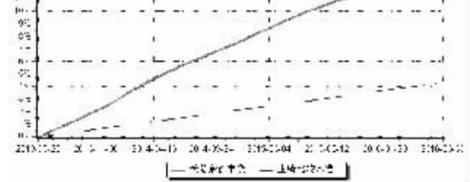
基金产品概况	
基金名称	天弘余额宝货币
基金代码	001900
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2013年5月20日
报告期内基金总份额	816,312,411.434.03
报告期内基金份额持有人数量	816,312,411.434.03
投资目标	在保持基金资产的流动性和低风险的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金根据对短期利率变动的预测，采用自上而下与自下而上相结合的投资策略，利用久期、分散化和择时等方式，通过积极主动的资产配置，有效控制风险并在动态的基础上，力争获得稳定的当期收益。
业绩比较基准	同期1年期定期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为货币市场基金，属于证券投资基金中的低风险品种，其预期收益和风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。
基金管理人	天弘基金管理有限公司
基金托管人	中国银行股份有限公司

3.1 主要财务指标
单位:人民币元

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	4,822,215,076.79
2.本期利润	4,822,215,076.79
3.期末基金份额净值	816,312,411.434.03

3.2 基金净值表现
3.2.1 本报告期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	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.0649%	0.0010%	0.3418%	0.0009%	0.2769%	0.0001%



3.2.2 基金净值增长率与业绩比较基准收益率年度对比表

年度	基金净值增长率	业绩比较基准收益率
2015年	1.12%	1.12%
2016年1-6月	0.06%	0.34%

4.1 基金经理 基金经理小组 简介

姓名	职务	任本基金基金经理期间	证券从业年限	说明
王瑞峰	本基金基金经理	2015年1月	7年	男,经济学硕士,现任中国建设银行股份有限公司总行资产负债管理部主任,2012年12月加入天弘基金,历任本公司固定收益研究员等。

4.2 投资决策程序
本基金管理人实行投资决策委员会制度,投资决策委员会由公司总经理和首席基金经理组成,负责制定基金投资策略,并负责审批基金投资方案。投资决策委员会下设投资决策委员会办公室,负责日常基金投资决策工作。

4.3 风险控制
本基金管理人建立了完善的风险管理体系,包括事前、事中和事后风险控制。事前风险控制包括投资标的筛选、资产配置和分散化投资;事中风险控制包括实时监控和预警;事后风险控制包括绩效归因和风险评估。

4.4 基金费用
本基金管理人按照基金合同约定收取基金管理费、基金托管费、销售服务费和申购赎回费。基金费用从基金资产中列支,不影响基金份额持有人的收益。

4.5 基金收益分配
本基金管理人按照基金合同约定进行收益分配。收益分配原则包括:收益分配对象为基金份额持有人;收益分配方式为现金分红;收益分配频率为每季度一次。

4.6 基金信息披露
本基金管理人按照法律法规和基金合同约定进行信息披露,包括定期报告和临时报告。基金信息披露旨在保障基金份额持有人的知情权,维护基金份额持有人的合法权益。

4.7 基金管理人承诺
本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,不从事任何可能导致基金资产损失或基金份额持有人利益受损的行为。

4.8 基金托管人承诺
基金托管人承诺按照法律法规和基金合同约定履行托管职责,安全保管基金财产,按照规定监督基金管理人的投资运作,并定期向基金份额持有人提供基金净值和份额信息。

4.9 基金份额持有人承诺
基金份额持有人承诺遵守基金合同约定,按时缴纳基金认购、申购款项,并承担基金投资风险,不得进行任何损害基金份额持有人利益的活动。

4.10 基金合同生效
本基金合同于2013年5月20日生效。自生效之日起,本基金管理人将按照基金合同约定开展投资运作,基金托管人将按照基金合同约定履行托管职责。

4.11 基金合同终止
本基金合同在出现以下情形之一时终止:基金合同期限届满且未延期;基金份额持有人大会决定终止;基金管理人或基金托管人依法解散、破产或被撤销;法律法规及中国证监会规定的其他情形。

4.12 基金合同变更
本基金合同在符合法律法规和基金合同约定条件下,经基金份额持有人大会审议通过,并报中国证监会备案后,可以对基金合同进行变更。

4.13 基金合同修订
本基金合同在符合法律法规和基金合同约定条件下,经基金份额持有人大会审议通过,并报中国证监会备案后,可以对基金合同进行修订。

4.14 基金合同其他条款
本基金合同未尽事宜,按照相关法律法规和基金合同约定执行。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,维护基金份额持有人的合法权益。

4.15 基金合同其他事项
本基金合同其他事项按照相关法律法规和基金合同约定执行。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,维护基金份额持有人的合法权益。

4.16 基金合同其他事项
本基金合同其他事项按照相关法律法规和基金合同约定执行。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,维护基金份额持有人的合法权益。

4.17 基金合同其他事项
本基金合同其他事项按照相关法律法规和基金合同约定执行。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,维护基金份额持有人的合法权益。

4.18 基金合同其他事项
本基金合同其他事项按照相关法律法规和基金合同约定执行。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,维护基金份额持有人的合法权益。

4.19 基金合同其他事项
本基金合同其他事项按照相关法律法规和基金合同约定执行。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,维护基金份额持有人的合法权益。

4.20 基金合同其他事项
本基金合同其他事项按照相关法律法规和基金合同约定执行。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,维护基金份额持有人的合法权益。

4.21 基金合同其他事项
本基金合同其他事项按照相关法律法规和基金合同约定执行。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,维护基金份额持有人的合法权益。

4.22 基金合同其他事项
本基金合同其他事项按照相关法律法规和基金合同约定执行。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,维护基金份额持有人的合法权益。

4.23 基金合同其他事项
本基金合同其他事项按照相关法律法规和基金合同约定执行。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,维护基金份额持有人的合法权益。

4.24 基金合同其他事项
本基金合同其他事项按照相关法律法规和基金合同约定执行。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,维护基金份额持有人的合法权益。

4.25 基金合同其他事项
本基金合同其他事项按照相关法律法规和基金合同约定执行。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,维护基金份额持有人的合法权益。

4.26 基金合同其他事项
本基金合同其他事项按照相关法律法规和基金合同约定执行。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,维护基金份额持有人的合法权益。

4.27 基金合同其他事项
本基金合同其他事项按照相关法律法规和基金合同约定执行。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,维护基金份额持有人的合法权益。

4.28 基金合同其他事项
本基金合同其他事项按照相关法律法规和基金合同约定执行。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,维护基金份额持有人的合法权益。

5.2 报告期末资产组合情况
金额单位:人民币元

序号	项目	金额	占基金资产净值比例(%)
1	报告期内新增申购资金	0.58	-
2	其中:买入申购资金	-	-
3	报告期内赎回资金	8,992,296,438.85	1.10
4	其中:卖出赎回资金	-	-

5.3 投资组合平均持仓期限
单位:天

项目	天数
报告期内投资组合平均持仓期限	22.678
报告期内新增申购资金平均持仓期限	109
报告期内赎回资金平均持仓期限	70

5.4 报告期末按行业分类的股票投资组合
金额单位:人民币元

序号	行业名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	农林牧渔	22,678,832,299.66	2.78
2	制造业	1,401,846,228.88	0.17
3	金融保险	22,678,988,653.63	2.78
4	其中:政策性金融债	22,678,988,653.63	2.78
5	企业债	-	-
6	央行票据	14,043,872,506.56	1.72
7	中期票据	-	-
8	同业存单	151,489,231,466.01	18.56
9	其他	200,229,882.85	0.02
10	债券回购	212,492,622,997.99	26.03

5.5 报告期末按行业分类的债券投资组合
金额单位:人民币元

序号	债券品种	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国债	111,615,114	100.0000
2	央行票据	14,043,872,506.56	12.6182
3	中期票据	-	-
4	企业债	-	-
5	公司债	-	-
6	可转债	-	-
7	其他	200,229,882.85	0.1801
8	债券回购	212,492,622,997.99	190.0000

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债券投资明细
金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	111615114	16国债(11)	100,000,000	9,853,808,995.68	1.21
2	109001	16政安债	62,000,000	6,199,125,450.69	0.76
3	111617003	16国债(10)	50,000,000	4,997,479,084.05	0.61
4	111609015	16国债(10)	50,000,000	4,995,986,345.51	0.61
5	111607023	16国债(10)	50,000,000	4,986,393,080.12	0.61
6	111607029	16国债(10)	50,000,000	4,982,838,343.58	0.61
7	111608151	16国债(11)	50,000,000	4,941,441,347.06	0.61
8	111615114	16国债(11)	50,000,000	4,928,138,741.05	0.60
9	111615115	16国债(11)	50,000,000	4,928,138,741.05	0.60
10	111617002	16国债(10)	45,000,000	4,498,097,187.69	0.55

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	001900	天弘余额宝货币	1,000,000,000	816,312,411.43	0.10

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十名权证投资明细
金额单位:人民币元

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	001900	天弘余额宝货币	1,000,000,000	816,312,411.43	0.10

5.9 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
金额单位:人民币元

序号	资产支持证券名称	数量(元)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	央行票据	14,043,872,506.56	14,043,872,506.56	1.72
2	同业存单	151,489,231,466.01	151,489,231,466.01	18.56
3	其他	200,229,882.85	200,229,882.85	0.02
4	债券回购	212,492,622,997.99	212,492,622,997.99	26.03

5.10 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权证投资明细
金额单位:人民币元

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	001900	天弘余额宝货币	1,000,000,000	816,312,411.43	0.10

5.11 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权证投资明细
金额单位:人民币元

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	001900	天弘余额宝货币	1,000,000,000	816,312,411.43	0.10

5.12 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权证投资明细
金额单位:人民币元

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	001900	天弘余额宝货币	1,000,000,000	816,312,411.43	0.10

5.13 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权证投资明细
金额单位:人民币元

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	001900	天弘余额宝货币	1,000,000,000	816,312,411.43	0.10

5.14 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权证投资明细
金额单位:人民币元

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	001900	天弘余额宝货币	1,000,000,000	816,312,411.43	0.10

5.15 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权证投资明细
金额单位:人民币元

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	001900	天弘余额宝货币	1,000,000,000	816,312,411.43	0.10

5.16 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权证投资明细
金额单位:人民币元

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	001900	天弘余额宝货币	1,000,000,000	816,312,411.43	0.10

5.17 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权证投资明细
金额单位:人民币元

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	001900	天弘余额宝货币	1,000,000,000	816,312,411.43	0.10

5.18 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权证投资明细
金额单位:人民币元

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	001900	天弘余额宝货币	1,000,000,000	816,312,411.43	0.10

5.19 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权证投资明细
金额单位:人民币元

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	001900	天弘余额宝货币	1,000,000,000	816,312,411.43	0.10

5.20 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权证投资明细
金额单位:人民币元

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	001900	天弘余额宝货币	1,000,000,000	816,312,411.43	0.10

5.21 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权证投资明细
金额单位:人民币元

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	001900	天弘余额宝货币	1,000,000,000	816,312,411.43	0.10

5.22 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权证投资明细
金额单位:人民币元

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	001900	天弘余额宝货币	1,000,000,000	816,312,411.43	0.10

5.23 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权证投资明细
金额单位:人民币元

序号	权证代码	权证名称	数量(份)	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	001900	天弘余额宝货币	1,000,000,000	816,312,411.43	0.10

基金管理人天弘基金管理有限公司
基金托管人中国银行股份有限公司
报告送出日期2016年7月19日

1.1 重要提示
基金管理人天弘基金管理有限公司董事会及监事会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。
基金托管人中国银行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、误导性陈述或重大遗漏。
本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，也不保证基金份额持有人的本金不受损失或本金增值。基金的投资与业绩并不代表其未来表现，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。
本报告刊登日期为2016年7月19日起至2016年6月30日止。

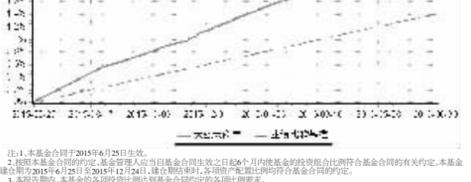
基金产品概况	
基金名称	天弘云端生活
基金代码	001929
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2016年4月1日
报告期内基金总份额	2,794,832,380.0份
报告期内基金份额持有人数量	2,794,832,380.0份
投资目标	在保持基金资产的流动性和低风险的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金根据对短期利率变动的预测，采用自上而下与自下而上相结合的投资策略，利用久期、分散化和择时等方式，通过积极主动的资产配置，有效控制风险并在动态的基础上，力争获得稳定的当期收益。
业绩比较基准	同期1年期定期存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为货币市场基金，属于证券投资基金中的低风险品种，其预期收益和风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。
基金管理人	天弘基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司

3.1 主要财务指标
单位:人民币元

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	14,000,461.05
2.本期利润	14,000,461.05
3.期末基金份额净值	2,794,832,380.00

3.2 基金净值表现
3.2.1 本报告期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	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.5999%	0.0040%	0.3418%	0.0009%	0.2572%	0.0040%



3.2.2 基金净值增长率与业绩比较基准收益率年度对比表

年度	基金净值增长率	业绩比较基准收益率
2016年1-6月	0.60%	0.34%

4.1 基金经理 基金经理小组 简介

姓名	职务	任本基金基金经理期间	证券从业年限	说明
王瑞峰	本基金基金经理	2015年6月	7年	男,经济学硕士,现任中国建设银行股份有限公司总行资产负债管理部主任,2012年12月加入天弘基金,历任本公司固定收益研究员等。

4.2 投资决策程序
本基金管理人实行投资决策委员会制度,投资决策委员会由公司总经理和首席基金经理组成,负责制定基金投资策略,并负责审批基金投资方案。投资决策委员会下设投资决策委员会办公室,负责日常基金投资决策工作。

4.3 风险控制
本基金管理人建立了完善的风险管理体系,包括事前、事中和事后风险控制。事前风险控制包括投资标的筛选、资产配置和分散化投资;事中风险控制包括实时监控和预警;事后风险控制包括绩效归因和风险评估。