

# 天弘新价值灵活配置混合型证券投资基金

## 2017 半年度 报告摘要

2017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:上海浦东发展银行股份有限公司  
送出日期:2017年8月28日

### 5.1 重要提示

重要提示: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。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。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。

### 5.2 基金简介

基金名称:天弘新价值灵活配置混合型证券投资基金  
基金代码:004084

### 2.1 基金基本情况

基金管理人:天弘基金管理有限公司  
基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司

### 2.2 基金产品说明

基金类型:混合型证券投资基金  
基金运作方式:契约型开放式

### 2.3 基金管理人及基金托管人

基金管理人:天弘基金管理有限公司  
基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司

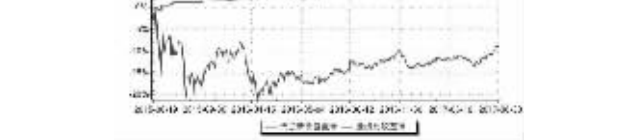
### 2.4 信息披露方式

信息披露网站: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场所

### 3.1 主要会计数据和财务指标

| 项目                       | 本报告期   | 上年同期   |
|--------------------------|--------|--------|
| 本期基金份额净值增长率              | 2.27%  | 1.18%  |
| 本期基金份额净值增长率标准差           | 0.62%  | 0.61%  |
| 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的偏差 | -0.03% | -0.03% |

### 3.2 基金业绩表现



### 4.1 基金管理人及基金托管人

基金管理人:天弘基金管理有限公司  
基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司

### 4.2 基金业绩表现

| 项目                       | 本报告期   | 上年同期   |
|--------------------------|--------|--------|
| 本期基金份额净值增长率              | 2.27%  | 1.18%  |
| 本期基金份额净值增长率标准差           | 0.62%  | 0.61%  |
| 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的偏差 | -0.03% | -0.03% |

### 4.3 基金业绩表现

基金管理人:天弘基金管理有限公司  
基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司

### 4.4 基金业绩表现

| 项目                       | 本报告期   | 上年同期   |
|--------------------------|--------|--------|
| 本期基金份额净值增长率              | 2.27%  | 1.18%  |
| 本期基金份额净值增长率标准差           | 0.62%  | 0.61%  |
| 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的偏差 | -0.03% | -0.03% |

### 4.5 基金业绩表现

基金管理人:天弘基金管理有限公司  
基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司

### 4.6 基金业绩表现

| 项目                       | 本报告期   | 上年同期   |
|--------------------------|--------|--------|
| 本期基金份额净值增长率              | 2.27%  | 1.18%  |
| 本期基金份额净值增长率标准差           | 0.62%  | 0.61%  |
| 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的偏差 | -0.03% | -0.03% |

### 4.7 基金业绩表现

基金管理人:天弘基金管理有限公司  
基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司

### 4.8 基金业绩表现

| 项目                       | 本报告期   | 上年同期   |
|--------------------------|--------|--------|
| 本期基金份额净值增长率              | 2.27%  | 1.18%  |
| 本期基金份额净值增长率标准差           | 0.62%  | 0.61%  |
| 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的偏差 | -0.03% | -0.03% |

### 4.9 基金业绩表现

基金管理人:天弘基金管理有限公司  
基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司

### 4.10 基金业绩表现

| 项目                       | 本报告期   | 上年同期   |
|--------------------------|--------|--------|
| 本期基金份额净值增长率              | 2.27%  | 1.18%  |
| 本期基金份额净值增长率标准差           | 0.62%  | 0.61%  |
| 本期基金份额净值增长率与业绩比较基准收益率的偏差 | -0.03% | -0.03% |

### 4.11 基金业绩表现

基金管理人:天弘基金管理有限公司  
基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司

### 4.6 管理人

基金管理人:天弘基金管理有限公司  
基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司

### 4.7 管理人

基金管理人:天弘基金管理有限公司  
基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司

### 4.8 管理人

基金管理人:天弘基金管理有限公司  
基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司

### 4.9 管理人

基金管理人:天弘基金管理有限公司  
基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司

### 4.10 管理人

基金管理人:天弘基金管理有限公司  
基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司

### 4.11 管理人

基金管理人:天弘基金管理有限公司  
基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司

### 4.12 管理人

基金管理人:天弘基金管理有限公司  
基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司

### 4.13 管理人

基金管理人:天弘基金管理有限公司  
基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司

### 4.14 管理人

基金管理人:天弘基金管理有限公司  
基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司

### 4.15 管理人

基金管理人:天弘基金管理有限公司  
基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司

### 4.16 管理人

基金管理人:天弘基金管理有限公司  
基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司

### 4.17 管理人

基金管理人:天弘基金管理有限公司  
基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司

### 4.18 管理人

基金管理人:天弘基金管理有限公司  
基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司

### 4.19 管理人

基金管理人:天弘基金管理有限公司  
基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司

### 4.20 管理人

基金管理人:天弘基金管理有限公司  
基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司

### 4.21 管理人

基金管理人:天弘基金管理有限公司  
基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司

### 4.22 管理人

基金管理人:天弘基金管理有限公司  
基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司

### 4.23 管理人

基金管理人:天弘基金管理有限公司  
基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司

### 4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2007]47号《财政部、国家税务总局关于证券投资基金税收政策的通知》、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》、财税[2016]36号《关于全面推开营业税改征增值税试点的通知》、财税[2016]46号《关于进一步明确全面推开营改增试点金融业有关政策的通知》、财税[2016]70号《关于金融机构同业往来等增值税政策的通知》及其他相关法律法规和实务操作,主要税项列示如下:

### 4.7 基金管理人

基金管理人:天弘基金管理有限公司  
基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司

### 4.8 基金管理人

基金管理人:天弘基金管理有限公司  
基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司

### 4.9 基金管理人

基金管理人:天弘基金管理有限公司  
基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司

### 4.10 基金管理人

基金管理人:天弘基金管理有限公司  
基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司

### 4.11 基金管理人

基金管理人:天弘基金管理有限公司  
基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司

### 4.12 基金管理人

基金管理人:天弘基金管理有限公司  
基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司

### 4.13 基金管理人

基金管理人:天弘基金管理有限公司  
基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司

### 4.14 基金管理人

基金管理人:天弘基金管理有限公司  
基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司

### 4.15 基金管理人

基金管理人:天弘基金管理有限公司  
基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司

### 4.16 基金管理人

基金管理人:天弘基金管理有限公司  
基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司

### 4.17 基金管理人

基金管理人:天弘基金管理有限公司  
基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司

### 4.18 基金管理人

基金管理人:天弘基金管理有限公司  
基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司

### 4.19 基金管理人

基金管理人:天弘基金管理有限公司  
基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司

### 4.20 基金管理人

基金管理人:天弘基金管理有限公司  
基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司

### 4.21 基金管理人

基金管理人:天弘基金管理有限公司  
基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司

### 4.22 基金管理人

基金管理人:天弘基金管理有限公司  
基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司

### 4.23 基金管理人

基金管理人:天弘基金管理有限公司  
基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 期末持仓数量(股)     | 占期末基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------------|----------------|
| 1  | 600028 | 中国石化 | 12,096,833.00 | 7.57           |
| 2  | 601166 | 中国铁建 | 11,633,027.60 | 7.31           |
| 3  | 000033 | 深证成指 | 10,751,040.00 | 6.73           |
| 4  | 000001 | 平安银行 | 10,377,000.00 | 6.64           |
| 5  | 000009 | 中小板综 | 10,066,440.00 | 6.34           |
| 6  | 002241 | 纳思达  | 9,797,490.00  | 6.12           |
| 7  | 600967 | 泰达宏利 | 9,566,740.00  | 5.98           |
| 8  | 000061 | 东方电机 | 8,930,350.00  | 5.60           |
| 9  | 000005 | 民生银行 | 8,923,250.00  | 5.59           |
| 10 | 000002 | 万科A  | 7,933,247.47  | 4.99           |
| 11 | 600048 | 保利地产 | 7,500,570.00  | 4.71           |
| 12 | 600087 | 伊泰股份 | 7,311,768.00  | 4.59           |
| 13 | 600004 | 白云机场 | 7,303,326.66  | 4.58           |
| 14 | 000025 | 海信电子 | 7,173,415.97  | 4.49           |
| 15 | 600003 | 浦发银行 | 7,142,440.00  | 4.46           |
| 16 | 600014 | 上汽集团 | 6,936,575.34  | 4.27           |
| 17 | 000003 | 中国平安 | 6,668,453.12  | 4.18           |
| 18 | 001979 | 招商局T | 6,608,007.00  | 4.18           |
| 19 | 000029 | 招商局A | 6,461,363.13  | 4.04           |
| 20 | 000001 | 平安银行 | 6,352,000.00  | 3.96           |
| 21 | 600009 | 浦发银行 | 6,144,000.00  | 3.89           |
| 22 | 000021 | 招商局B | 6,068,280.00  | 3.81           |
| 23 | 002048 | 华天科技 | 5,970,040.00  | 3.75           |
| 24 | 600045 | 东方证券 | 5,733,150.00  | 3.59           |
| 25 | 000002 | 万科A  | 5,682,250.00  | 3.56           |
| 26 | 300076 | 华信新材 | 5,607,915.00  | 3.55           |
| 27 | 600000 | 浦发银行 | 5,538,000.00  | 3.49           |
| 28 | 000022 | 招商局T | 5,340,427.13  | 3.35           |
| 29 | 600029 | 招商局A | 4,888,210.00  | 3.07           |
| 30 | 000001 | 平安银行 | 4,799,270.00  | 3.00           |
| 31 | 000002 | 万科A  | 4,758,180.00  | 2.99           |
| 32 | 000029 | 招商局A | 4,750,000.00  | 2.98           |
| 33 | 000036 | 新希望  | 4,733,210.00  | 2.98           |
| 34 | 600015 | 浦发银行 | 4,711,756.64  | 2.98           |
| 35 | 000766 | 东方集团 | 4,677,420.00  | 2.94           |
| 36 | 002075 | 中顺洁柔 | 4,662,300.00  | 2.92           |
| 37 | 000007 | 中国国贸 | 4,623,233.00  | 2.91           |
| 38 | 000006 | 大港钢铁 | 4,507,400.00  | 2.89           |
| 39 | 000069 | 华侨城A | 3,990,000.00  | 2.50           |
| 40 | 000008 | 五矿发展 | 3,861,261.00  | 2.42           |
| 41 | 000016 | 民生银行 | 3,806,066.00  | 2.42           |
| 42 | 000009 | 浦发银行 | 3,806,000.00  | 2.41           |
| 43 | 002078 | 中顺洁柔 | 3,753,363.00  | 2.32           |
| 44 | 300075 | 中顺洁柔 | 3,462,270.00  | 2.19           |
| 45 | 300119 | 东鹏饮料 | 3,288,050.00  | 2.06           |
| 46 | 000061 | 东方电机 | 3,268,790.00  | 2.06           |
| 47 | 000009 | 浦发银行 | 3,266,000.00  | 2.05           |
| 48 | 300036 | 晶瑞化学 | 3,268,510.00  | 2.05           |
| 49 | 000048 | 保利地产 | 3,207,200.00  | 2.01           |

注:本表的“期末持仓数量”按买入成交金额(成交金额/买入成交均价)计算,不考虑相关交易费用。  
7.4.2 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

| 序号 | 股票代码   | 股票名称 | 期末持仓数量(股)     | 占期末基金资产净值比例(%) |
|----|--------|------|---------------|----------------|
| 1  | 600028 | 中国石化 | 12,042,000.00 | 7.56           |
| 2  | 000033 | 深证成指 | 11,077,858.76 | 7.03           |
| 3  | 000001 | 平安银行 | 10,368,000.00 | 6.66           |
| 4  | 000026 | 中国铝业 | 9,853,112.00  | 6.31           |
| 5  | 600009 | 浦发银行 | 9,792,751.45  | 6.14           |
| 6  | 601166 | 中国铁建 | 9,292,019.78  | 5.79           |
| 7  | 600067 | 泰达宏利 | 9,151,327.00  | 5.74           |
| 8  | 000009 | 浦发银行 | 8,923,250.00  | 5.69           |
| 9  | 000025 | 海信电子 | 7,173,415.97  | 4.66           |
| 10 | 600048 | 保利地产 | 7,130,261.47  | 4.60           |
| 11 | 600003 | 浦发银行 | 7,007,100.00  | 4.49           |
| 12 | 600087 | 伊泰股份 | 7,193,833.14  | 4.57           |
| 13 | 000061 | 东方电机 | 7,123,415.97  | 4.51           |
| 14 | 000009 | 浦发银行 | 6,862,250.00  | 4.41           |
| 15 | 002046 | 紫光股份 | 6,663,300.00  | 4.19           |
| 16 | 000079 | 招商局T | 6,628,143.74  | 4.16           |
| 17 | 600015 | 浦发银行 | 6,420,010.00  | 4.07           |
| 18 | 000029 | 招商局A | 6,268,210.00  | 3.98           |
| 19 | 000009 | 浦发银行 | 6,266,000.00  | 3.98           |
| 20 | 002121 | 招商局T | 6,062,120.00  | 3.83           |
| 21 | 000005 | 民生银行 | 6,068,453.12  | 3.77           |
| 22 | 000001 | 平安银行 | 5,773,210.00  | 3.62           |
| 23 | 600000 | 浦发银行 | 5,607,915.00  | 3.52           |
| 24 | 000022 | 招商局T | 5,682,250.00  | 3.53           |
| 25 | 300076 | 华信新材 | 5,616,264.00  | 3.58           |
| 26 | 001366 | 华信新材 | 4,879,248.30  | 3.06           |
| 27 | 002048 | 华天科技 | 4,883,744.00  | 3.03           |
| 28 | 600004 | 白云机场 | 4,828,668.20  | 3.03           |
| 29 | 000029 | 招商局T | 4,723,075.00  | 2.97           |
| 30 | 000009 | 浦发银行 | 4,682,250.00  | 2.96           |