天弘债券型发起式证券投资基金

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：中国工商银行股份有限公司
送出日期：2017年08月28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。本半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2017年8月22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。
本半年度报告摘要摘自半年度报告正文，投资者欲了解详细内容，应阅读半年度报告正文。
本报告中财务资料未经审计。
本报告期自2017年1月1日起至2017年6月30日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	天弘债券发起式	
基金主代码	420008	
基金运作方式	契约型开放式、发起式	
基金合同生效日	2012年08月10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	343,484,409.67份	
基金合同存续期	不定期	
下属两级基金的基金简称	天弘债券型发起式A	天弘债券型发起式B
下属两级基金的交易代码	420008	420108
报告期末下属两级基金的份额总额	64,277,573.97份	279,206,835.70份

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金在追求基金资产长期稳健增值的基础上，力争获得高于业绩比较基准的投资收益。
投资策略	本基金通过对宏观经济、利率走势、资金供求、信用风险状况、证券市场走势等方面的分析和预测，在严格的风险控制基础上，主动构建及调整投资组合，力求实现基金资产的稳定增值。
业绩比较基准	中债综合指数
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基金品种，其风险收益预期高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。

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	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	童建林	郭明
	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

登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.thfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公地址

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要会计数据和财务指标

单位：人民币元

	天弘债券型发起式A	天弘债券型发起式B
3.1.1 期间数据和指标	报告期（2017年01月01日-2017年06月30日）	
本期已实现收益	-248,625.50	-3,318,178.36
本期利润	-649,294.10	-4,003,785.22
加权平均基金份额本期利润	-0.0100	-0.0104
本期基金份额净值增长率	-0.88%	-1.08%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2017年06月30日)	
期末可供分配基金份额利润	0.1217	0.1002
期末基金资产净值	72,102,296.27	307,182,225.58
期末基金份额净值	1.1220	1.1000

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。

3.2 基金净值表现

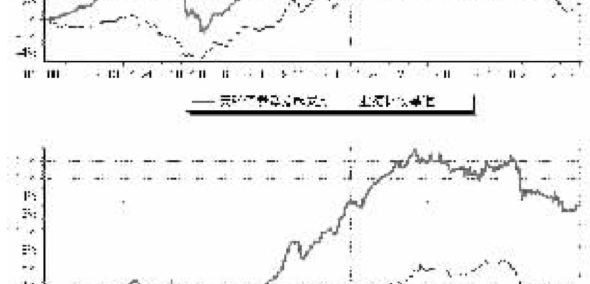
3.2.1 基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

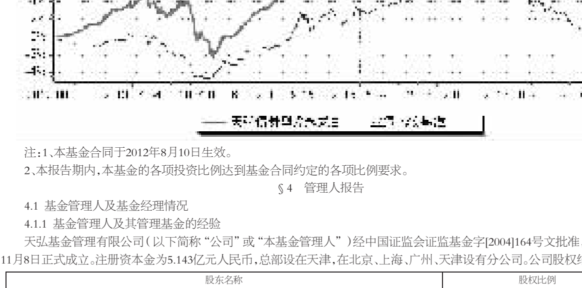
阶段（天弘债券型发起式A)	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去一个月	0.63%	0.04%	0.90%	0.06%	-0.27%	-0.02%
过去三个月	-0.27%	0.14%	-0.88%	0.08%	0.61%	0.06%
过去六个月	-0.88%	0.11%	-2.11%	0.08%	1.23%	0.03%
过去一年	-2.77%	0.17%	-3.50%	0.10%	0.73%	0.07%
过去三年	11.20%	0.15%	2.70%	0.10%	8.50%	0.05%
自基金合同生效日起至今（2012年08月10日-2017年06月30日）	15.42%	0.16%	1.86%	0.09%	13.56%	0.07%

阶段（天弘债券型发起式B)	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
过去一个月	0.55%	0.05%	0.90%	0.06%	-0.35%	-0.01%
过去三个月	-0.36%	0.14%	-0.88%	0.08%	0.52%	0.06%
过去六个月	-1.08%	0.12%	-2.11%	0.08%	1.03%	0.04%
过去一年	-3.17%	0.17%	-3.50%	0.10%	0.33%	0.07%
过去三年	9.78%	0.15%	2.70%	0.10%	7.08%	0.05%
自基金合同生效日起至今（2012年08月10日-2017年06月30日）	13.05%	0.16%	1.86%	0.09%	11.19%	0.07%

注：天弘债券发起式基金业绩比较基准：中债综合指数。中债综合指数由中央国债登记结算有限责任公司编制并发布，该指数样本具有广泛的市场代表性，涵盖主要交易市场（银行间市场、交易所市场等）、不同发行主体（政府、企业等）和期限（长期、中期、短期等），是中国目前最权威，应用也最广的指数。中债综合指数的构成品种完全覆盖了本基金的投资范围，反映债券全市场的整体价格和投资回报情况，适合作为本基金的业绩比较基准。

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其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2012年8月10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。

§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股份有限公司	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2017年6月30日，本基金管理人共管理54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、天弘同利债券型证券投资基金（LOF）、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、天弘中证银行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、天弘中证休闲娱乐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、天弘弘运宝货币市场基金、天弘裕利灵活配置混合型证券投资基金、天弘乐享保本混合型证券投资基金、天弘价值精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、天弘安盈灵活配置混合型证券投资基金、天弘喜利灵活配置混合型证券投资基金、天弘信利债券型证券投资基金、天弘聚利灵活配置混合型证券投资基金、天弘金利灵活配置混合型证券投资基金、天弘金明灵活配置混合型证券投资基金、天弘天盈灵活配置混合型证券投资基金、天弘策略精选灵活配置混合型发起式证券投资基金。

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		
凌超	本基金基金经理。	2016年5月	-	11年	男，经济学硕士。历任长江证券股份有限公司研究员、投资经理，光大保德信基金管理有限公司基金经理，海富通基金管理有限公司投资顾问、基金经理。2016年1月加盟本公司。

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。

3、本半年度报告截止日至报告批准送出日之间，本基金管理人于2017年7月13日增聘刘洋女士为本基金基金经理；凌超先生于2017年7月13日离任，不再担任本基金基金经理。

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》及其配套规则和其他相关法律法规、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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

为规范投资行为，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同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

2017年上半年，经济基本面表现较好，下游需求走势平稳，经济增长表现超市场预期；通胀方面PPI则主要受基数效应影响，先上后下，但是CPI由于食品价格表现低迷，除1月由于春节错位效应较高之外，较去年明显放缓，通胀担忧显著缓解。政策面方面，货币政策边际趋于紧缩，央行两次提高操作利率，4月银监会连续发文，对银行监管加强，中央政治局会议更是将金融安全提到国家安全层面，引发市场对监管政策的极度担忧，但此后监管协调成为重点，市场过度悲观预期逐步修正。资金面方面，资金利率中枢在央行"加息"之下有所抬升，且波动率进一步加大。债市方面，在政策收紧、央行提高政策利率等利空下，整体呈下跌态势，收益率水平突破了去年年底高点，尤其是4、5月份在政策收紧、监管加强等利空下，呈现大幅下跌态势，此后6月由于悲观预期修正出现明显反弹。

本基金在报告期内，整体维持低杠杆短久期的谨慎态度，同时在严控股票仓位的情况下参与权益市场机会。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2017年6月30日，天弘债券发起式A基金份额净值为1.122元，天弘债券发起式B基金份额净值为1.100元。报告期内份额净值增长率天弘债券发起式A为-0.88%，天弘债券发起式B为-1.08%，同期业绩比较基准增长率为-2.11%。

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2017年下半年，我们认为后续经济增长将逐步小幅放缓，但是下行幅度和速度可能不及市场预期，也不足以触发政策立场的迅速转向，尤其是三季度将呈现较为平稳的态势。资金面方面，伴随着去杠杆进程的逐步推进，资金利率中枢将有所下行，但是脉冲式收紧仍将出现，资金利率中枢也尚不会出现大幅下行。政策面方面，货币政策中性稳健立场未变，加强监管、维护国家金融安全的立场也不会改变。对应到债市来看，由于基本面后续将有一定下行压力，未来收益率也有一定的下行空间，但是暂难以形成趋势性机会。

投资策略上，本基金将选择有利配置时点，积极布局后续的市场机会，同时将在严守投资纪律的前提下适当参与股票市场的机会，争取为持有人创造稳健收益。

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已实施的估值政策、方法和流程的，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、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。

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

本基金本报告期末进行利润分配，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债券型发起式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，天弘债券型发起式证券投资基金的管理人--天弘基金管理有限公司在天弘债券型发起式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，天弘债券型发起式证券投资基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本半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债券型发起式证券投资基金2017年半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：天弘债券型发起式证券投资基金

报告截止日：2017年06月30日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2017年06月30日	上年度末 2016年12月31日
资 产：			
银行存款	6.4.7.1	553,045.78	24,797,310.15
结算备付金		108,330.53	7,639,966.60
存出保证金		292,484.50	606,277.61
交易性金融资产	6.4.7.2	335,679,439.20	609,942,726.54
其中：股票投资		-	4,597,642.96
基金投资		-	-
债券投资		335,679,439.20	605,345,083.58
资产支持证券投资		-	-
贵金属投资		-	-
衍生金融资产	6.4.7.3	-	-
买入返售金融资产	6.4.7.4	33,900,284.85	-
应收证券清算款		-	24,214,847.81
应收利息	6.4.7.5	9,635,502.15	7,106,169.33
应收股利		-	-
应收申购款		324.73	4,434.40
递延所得税资产		-	-
其他资产	6.4.7.6	-	-
资产总计		380,169,411.74	674,311,732.44
负债和所有者权益	附注号	本期末 2017年06月30日	上年度末 2016年12月31日
负 债：			
短期借款		-	-
交易性金融负债		-	-
衍生金融负债		-	-
卖出回购金融资产款		-	-
应付证券清算款		-	255,069.63
应付赎回款		27,608.10	196,884.57
应付管理人报酬		217,517.91	416,585.89
应付托管费		62,147.99	119,024.55
应付销售服务费		100,645.06	212,866.08
应付交易费用	6.4.7.7	285,960.30	1,735,021.50
应交税费		-	-
应付利息		-	-
应付利润		-	-
递延所得税负债		-	-
其他负债	6.4.7.8	191,010.53	406,018.07
负债合计		884,889.89	3,341,470.29
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	343,484,409.67	602,046,708.27
未分配利润	6.4.7.10	35,800,112.18	68,923,553.88
所有者权益合计		379,284,521.85	670,970,262.15
负债和所有者权益总计		380,169,411.74	674,311,732.44

注：报告截止日2017年6月30日，天弘债券型发起式证券投资基金A类基金份额净值1.122元，天弘债券型发起式证券投资基金B类基金份额净值1.100元，基金份额总额343,484,409.67份，其中天弘债券型发起式证券投资基金A类基金份额的份额总额为64,277,573.97份，天弘债券型发起式证券投资基金B类基金份额的份额总额为279,206,835.70份。

6.2 利润表

会计主体：天弘债券型发起式证券投资基金

本报告期：2017年01月01日-2017年06月30日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2017年01月01日-2017年06月30日	上年度可比期间2016年01月01日-2016年06月30日
一、收入		127,861.02	-9,272,529.52
1.利息收入		10,308,479.10	19,880,661.18
其中：存款利息收入	6.4.7.11	133,617.55	233,668.15
债券利息收入		10,135,482.74	19,612,672.37
资产支持证券利息收入		-	-
买入返售金融资产收入		39,378.81	34,320.66
其他利息收入		-	-
2.投资收益		-9,104,453.37	-15,909,883.63
其中：股票投资收益	6.4.7.12	-3,253,744.35	-30,087,337.09
基金投资收益		-	-
债券投资收益	6.4.7.13	-5,850,709.02	14,136,707.28
资产支持证券投资收益	6.4.7.13.3	-	-
贵金属投资收益	6.4.7.14	-	-
衍生工具收益	6.4.7.15	-	-
股利收益	6.4.7.16	-	40,746.18
3.公允价值变动收益	6.4.7.17	-1,086,275.46	-13,305,085.06
4.汇兑收益（损失以"-"号填列）		-	-
5.其他收入（损失以"-"号填列）	6.4.7.18	10,110.75	61,777.99
减：二、费用		4,780,940.34	12,480,439.91
1. 管理人报酬		1,757,156.41	3,432,049.06
2. 托管费		502,044.69	980,585.49
3. 销售服务费		859,286.28	1,367,737.12
4. 交易费用	6.4.7.19	1,370,646.65	6,285,499.70
5. 利息支出		84,487.96	207,653.81
其中：卖出回购金融资产支出		84,487.96	207,653.81
6. 其他费用	6.4.7.20	207,318.35	206,914.73
三、利润总额（亏损总额以"-"号填列）		-4,653,079.32	-21,752,969.43
减：所得税费用		-	-
四、净利润（净亏损以"-"号填列）		-4,653,079.32	-21,752,969.43

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：天弘债券型发起式证券投资基金

本报告期：2017年01月01日-2017年06月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2017年01月01日-2017年06月30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)	602,046,708.27	68,923,553.88	670,970,262.15
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-4,653,079.32	-4,653,079.32
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）	-258,562,298.60	-28,470,362.38	-287,032,660.98
其中：1.基金申购款	35,633,305.44	4,142,736.73	39,776,042.17
2.基金赎回款	-294,195,604.04	-32,613,099.11	-326,808,703.15
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）	343,484,409.67	35,800,112.18	379,284,521.85

项 目	上年度可比期间 2016年01月01日-2016年06月30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)	809,123,352.02	136,170,400.77	945,293,752.79
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	-21,752,969.43	-21,752,969.43
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）	148,322,159.52	19,472,920.60	167,795,080.12
其中：1.基金申购款	470,047,247.78	69,698,771.88	539,746,019.66
2.基金赎回款	-321,725,088.26	-50,225,851.28	-371,950,939.54
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）	957,445,511.54	133,890,351.94	1,091,335,863.48

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

郭树强	韩海潮	薄贺龙
基金管理人负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

天弘债券型发起式证券投资基金(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[2012]957号《关于核准天弘债券型发起式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《天弘债券型发起式证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型定期开放式基金，存续期限不定，首次设立募集不包括认购资金利息共募集3,346,686,228.75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(2012)第271号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《天弘债券型发起式证券投资基金基金合同》于2012年8月10日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为3,346,943,389.22份基金份额，其中认购资金利息折合257,160.47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。

本基金为发起式基金。基金管理人股东资金、基金管理人固有资金、基金管理人高级管理人员、基金经理等投资管理人员认购金额不低于1,000万元，认购的基金份额持有期限不低于三年。

根据《天弘债券型发起式证券投资基金基金合同》和《天弘债券型发起式证券投资基金招募说明书》的有关规定，本基金根据认购、申购费用收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。在投资者认购、申购基金时收取认购、申购费用的，称为A类基金份额；不收取认购、申购费用，而是从本类别基金资产中计提销售服务费的，称为B类基金份额，两级基金份额分别设置基金代码。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘债券型发起式证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围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、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)及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。本基金对债券等固定收益类证券的投资比例不低于基金资产的80%，持有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%；对股票等权益类资产的投资比例不超过基金资产的20%，其中，权证投资占基金资产净值的比例为0%-3%。本基金的业绩比较基准为：中债综合指数。

6.4.2 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(以下简称"中国基金业协会")颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《天弘债券型发起式证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4 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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2017年度上半年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2017年6月30日的财务状况以及2017年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

6.4.4 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、会计估计与最近一期年度会计报表所采用的会计政策、会计估计一致。

6.4.5 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。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2004]78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补充通知》，及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 于2016年5月1日前，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。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入免征营业税。自2016年5月1日起，金融业由缴纳营业税改为缴纳增值税。对证券投资基金管理人运用基金买卖股票、债券的转让收入免征增值税，对国债、地方政府债以及金融同业往来利息收入亦免征增值税。

(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，股票的股息、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，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。

6.4.7 关联方关系

6.4.7.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方未发生变化。

6.4.7.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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
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

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

6.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.8.2 关联方报酬

6.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年01月01日-2017年06月30日	上年度可比期间 2016年01月01日-2016年06月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,757,156.41	3,432,049.06
其中：支付销售机构的客户维护费	19,191.87	27,484.39

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0.70%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X0.70%/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。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

关联方名称	本期 2017年01月01日-2017年06月30日	上年度可比期间 2016年01月01日-2016年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	502,044.69	980,585.49

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0.20%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 X 0.20% / 当年天数。

6.4.8.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2017年01月01日-2017年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	天弘债券型发起式A	天弘债券型发起式B	合计
中国工商银行	-	14,705.87	14,705.87
天弘基金管理有限公司	-	843,008.66	843,008.66
合计	-	857,714.53	857,714.53
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间2016年01月01日-2016年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	天弘债券型发起式A	天弘债券型发起式B	合计
中国工商银行		19,145.05	19,145.05
天弘基金管理有限公司	-	1,344,871.88	1,344,871.88
合计	-	1,364,016.93	1,364,016.93

注：本基金A类基金份额不收取销售服务费，基金支付基金销售机构的销售服务费按B类基金份额前一日基金资产净值一定比例的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给天弘基金，再由天弘基金计算并支付给各基金销售机构。B类基金份额的销售服务费年费率为 0.40%。其计算公式为：日销售服务费＝前一日基金资产净值 X 0.40% / 当年天数。

6.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

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

6.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.8.4.1 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：份

项目	本期 2017年01月01日-2017年06月30日		上年度可比期间 2016年01月01日-2016年06月30日	
	天弘债券型发起式A	天弘债券型发起式B	天弘债券型发起式A	天弘债券型发起式B
期初持有的基金份额	10,287,988.75	-	10,287,988.75	-
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	10,287,988.75	-	10,287,988.75	-
占基金总份额比例	3.00%	-	1.07%	-

注：本基金本报告期及上年度可比期间无基金管理人运用固有资金投资本基金B类基金的情况。

6.4.8.4.2 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除基金管理人以外的其他关联方未投资本基金。

6.4.8.5 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 2017年01月01日-2017年06月30日		上年度可比期间 2016年01月01日-2016年06月30日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国工商银行活期存款	553,045.78	114,458.59	69,625.61	171,098.89

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。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内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。

6.4.8.7 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其他关联交易事项。

6.4.9 期末（2017年06月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.9.1 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。

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

6.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2017年06月30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。

6.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2017年06月30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。

6.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a)金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于2017年6月30日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中无属于第一层次的余额，属于第二层次的余额为335,679,439.20元，无属于第三层次的余额(2016年12月31日：第一层次59,242,631.04元，第二层次550,700,095.50元，无属于第三层次的余额)。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关股票和债券的公允价值列入第一层次；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关股票和债券公允价值应属第二层次还是第三层次。

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于2017年6月30日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2016年12月31日：同)。

(d)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(2) 增值税

根据财政部、国家税务总局于2016年12月21日颁布的财税[2016]140号《关于明确金融 房地产开发 教育辅助服务等增值税政策的通知》的规定：(1) 金融商品持有期间(含到期)取得的非保本收益(合同中未明确承诺到期本金可全部收回的投资收益)，不征收增值税；(2) 纳税人购入基金、信托、理财产品等各类资产管理产品持有至到期，不属于金融商品转让；(3) 资管产品运营过程中发生的增值税应税行为，以资管产品管理人为增值税纳税人。上述政策自2016年5月1日起执行。

此外，根据财政部、国家税务总局于2017年1月6日颁布的财税[2017]2号《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》及2017年6月30日颁布的财税[2017]56号《关于资管产品增值税有关问题的通知》的规定，资管产品管理人运营资管产品过程中发生的增值税应税行为，暂适用简易计税方法，按照3%的征收率缴纳增值税。对资管产品在2018年1月1日前运营过程中发生的增值税应税行为，未缴纳增值税的，不再缴纳；已缴纳增值税的，已纳税额从资管产品管理人以后月份的增值税应纳税额中抵减。上述税收政策对本基金截至本财务报表批准报出日止的财务状况和经营成果无影响。

§7 投资组合报告

7.1 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	-	-
	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	335,679,439.20	88.30
	其中：债券	335,679,439.20	88.30
	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	33,900,284.85	8.92
	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	661,376.31	0.17
6	其他资产	9,928,311.38	2.61
7	合计	380,169,411.74	100.00

7.2 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。

7.3 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

本基金本报告期末未持有股票。

7.4 报告期内股票投资组合的重大变动

7.4.1 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	601989	中国重工	29,196,315.29	4.35
2	600584	长电科技	25,830,078.18	3.85
3	601186	中国铁建	24,262,892.06	3.62
4	600115	东方航空	13,958,463.00	2.08
5	002748	世龙实业	13,655,780.00	2.04
6	601618	中国中冶	11,255,611.00	1.68
7	600515	海航基础	9,134,966.73	1.36
8	600685	中船防务	9,080,485.61	1.35
9	000928	中钢国际	8,303,688.00	1.24
10	002353	杰瑞股份	8,300,477.61	1.24
11	601800	中国交建	8,292,592.55	1.24
12	600362	江西铜业	7,966,079.97	1.19
13	600809	山西汾酒	7,666,249.37	1.14
14	600320	振华重工	7,337,022.10	1.09
15	600522	中天科技	6,822,559.00	1.02
16	601857	中国石油	6,789,690.64	1.01
17	601006	大秦铁路	6,721,522.96	1.00
18	600502	安徽水利	6,712,344.00	1.00
19	300575	中旗股份	6,545,974.50	0.98
20	601688	华泰证券	6,272,759.95	0.93

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。

7.4.2 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	本期累计买入金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	601989	中国重工	30,162,490.00	4.50
2	600584	长电科技	25,970,992.76	3.87
3	601186	中国铁建	24,372,418.49	3.63
4	600115	东方航空	13,805,906.00	2.06
5	002748	世龙实业	12,362,124.21	1.84
6	601618	中国中冶	11,366,302.00	1.69
7	600685	中船防务	9,503,188.34	1.42
8	600515	海航基础	8,717,911.61	1.30
9	000928	中钢国际	8,497,003.00	1.27
10	002353	杰瑞股份	8,268,700.97	1.23
11	601800	中国交建	8,214,579.20	1.22
12	600809	山西汾酒	7,818,848.10	1.17
13	600362	江西铜业	7,577,815.70	1.13
14	600320	振华重工	7,417,813.00	1.11
15	300575	中旗股份	6,833,545.20	1.02
16	600502	安徽水利	6,831,928.00	1.02
17	600522	中天科技	6,820,414.03	1.02
18	601857	中国石油	6,740,769.24	1.00
19	601006	大秦铁路	6,699,716.49	1.00
20	601688	华泰证券	6,265,840.38	0.93

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。

7.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

金额单位：人民币元

买入股票成本（成交）总额	453,928,729.60
卖出股票收入（成交）总额	455,251,117.92

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。

7.5 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	109,996,000.00	29.00
	其中：政策性金融债	109,996,000.00	29.00
4	企业债券	185,528,439.20	48.92
5	企业短期融资券	30,039,000.00	7.92
6	中期票据	10,116,000.00	2.67
7	可转债	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	335,679,439.20	88.50

7.6 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	140220	14国开20	600,000	60,078,000.00	15.84
2	041659045	16海淀国资CP001	300,000	30,039,000.00	7.92
3	170206	17国开06	300,000	29,880,000.00	7.88
4	112130	12华包债	225,780	22,587,031.20	5.96
5	140225	14国开25	200,000	20,038,000.00	5.28

7.7 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。

7.8 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。

7.9 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。

7.10 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。

7.11 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。

7.12 投资组合报告附注

7.12.1 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。

7.12.2 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库的情况

7.12.3 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	292,484.50
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	9,635,502.15
5	应收申购款	324.73
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,928,311.38

7.12.4 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。

7.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

7.12.6 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。

§8 基金份额持有人信息

8.1 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	机构投资者 持有份额	机构投资者 占总份额比例	个人投资者 持有份额	个人投资者 占总份额比例
天弘债券型发起式A	4,452	14,437.91	60,342,591.70	93.88%	3,934,982.27	6.12%
天弘债券型发起式B	471	592,795.83	272,055,792.61	97.44%	7,151,043.09	2.56%
合计	4,923	69,771.36	332,398,384.31	96.77%	11,086,025.36	3.23%

注：机构/个人投资者持有基金份额占总份额比例的计算中，针对A、B类分级基金，比例的分母采用A、B类各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用A、B类分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

8.2 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	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本开放式基金	天弘债券型发起式A	1,223.29	0.00%
	天弘债券型发起式B	17,602.72	0.01%
	合计	18,826.01	0.01%

8.3 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

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间（万份）
本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人持有本开放式基金	天弘债券型发起式A	0
	天弘债券型发起式B	0
	合计	0
本基金基金经理持有本开放式基金	天弘债券型发起式A	0
	天弘债券型发起式B	0
	合计	0

8.4 发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,000,800.08	2.91%	10,000,800.08	2.91%	三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	
基金经理等人员	-	-	-	-	
基金管理人股东	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	10,000,800.08	2.91%	10,000,800.08	2.91%	

§9 开放式基金份额变动

单位：份

	天弘债券型发起式A	天弘债券型发起式B
基金合同生效日(2012年08月10日)基金份额总额	583,956,910.70	2,762,986,478.52
本报告期期初基金份额总额	65,238,185.04	536,808,523.23
本报告期基金总申购份额	1,578,919.30	34,054,386.14
减：本报告期基金总赎回份额	2,539,530.37	291,656,073.67
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	64,277,573.97	279,206,835.70

注：总申购份额含转换转入份额；总赎回份额含转换转出份额。

§10 重大事件揭示

10.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会。

10.2 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，熊军先生已任职本公司副总经理职务，具体信息请参见基金管理人于2017年4月26日披露的《天弘基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。

本报告期内，基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 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。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略没有改变。

10.5 基金改聘会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生变化。

10.6 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。

10.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

10.7.1 基金租用证券公司交易单元进行股票投资及佣金支付情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易 成交金额	股票交易 占当期股票成交总额比例	应支付该券商的佣金 佣金	应支付该券商的佣金 占当期佣金总量的比例	备注
渤海证券	1	-	-	-	-	
长江证券	1	111,477,010.22	12.26%	103,817.42	12.55%	
东北证券	1	72,423,119.41	7.97%	67,446.81	8.15%	
东方证券	2	249,204,381.86	27.41%	232,082.41	28.06%	
广发证券	1	146,840,903.89	16.15%	136,753.06	16.53%	
国金证券	1	16,319,849.93	1.8%	15,198.71	1.84%	
国开证券	1	7,861,116.96	0.86%	5,748.87	0.7%	
国信证券	1	3,622,997	0.4%	3,374.15	0.41%	
华创证券	1	3,370,985.59	0.37%	3,139.43	0.38%	
华泰证券	2	121,168,290.87	13.33%	112,844.33	13.64%	
中泰证券	1	2,772,566.36	0.3%	2,582.09	0.31%	
申万宏源	1	3,780,442.59	0.42%	3,520.77	0.43%	
兴业证券	1	11,930,007.21	1.31%	11,109.7	1.34%	
银河证券	1	18,855,345.22	2.07%	17,560.01	2.12%	
中信建投	1	38,077,534.39	4.19%	35,460.91	4.29%	
中信证券	1	11,202,801.99	1.23%	10,433.25	1.26%	
中银国际	1	90,272,494.03	9.93%	66,016.01	7.98%	

10.7.2 基金租用证券公司交易单元进行其他证券投资的情况

金额单位：人民币元

券商名称	债券交易 成交金额	债券交易 占当期债券成交总额比例	债券回购交易 成交金额	债券回购交易 占当期债券回购成交总额比例	权证交易 成交金额	权证交易 占当期权证成交总额比例
渤海证券	126,672,120	36.91%	-	-	-	-
长江证券	55,777,364.3	16.25%	43,500,000	18.16%	-	-
东北证券	6,811,036.6	1.98%	27,900,000	11.65%	-	-
东方证券	-	-	55,200,000	23.05%	-	-
广发证券	8,319,776.83	2.42%	-	-	-	-
国金证券	-	-	-	-	-	-
国开证券	22,756,467.4	6.63%	2,000,000	0.84%	-	-
国信证券	2,546,431.34	0.74%	-	-	-	-
华创证券	-	-	-	-	-	-
华泰证券	14,070,656.3	4.1%	58,300,000	24.34%	-	-
中泰证券	4,955,000	1.44%	4,000,000	1.67%	-	-
申万宏源	-	-	-	-	-	-
兴业证券	-	-	-	-	-	-
银河证券	-	-	-	-	-	-
中信建投	9,117,144.8	2.66%	48,600,000	20.29%	-	-
中信证券	92,182,965	26.86%	-	-	-	-
中银国际	-	-	-	-	-	-

注：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：西南证券上海交易单元1个；

4、本基金报告期内停止租用交易单元2个，其中包括：中信建投证券上海交易单元1个、民族证券深圳交易单元1个。

§11 影响投资者决策的其他重要信息

11.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	2017/1/1-2017/6/30	245,907,920.00	-	-	245,907,920.00	71.59%
产品特有风险							
基金管理人秉承谨慎勤勉、独立决策、规范运作、充分披露原则，公平对待投资者，保障投资者合法权益。当单一投资者持有基金份额比例达到或超过 20%时，由此可能导致的特有风险主要包括：（1）超出基金管理人允许的单一投资者持有基金份额比例的申购申请不被确认的风险；（2）极端市场环境下投资者集中赎回，基金管理人可能无法及时变现基金资产以应对赎回申请的风险；（3）持有基金份额占比较高的投资者大额赎回可能引发基金净值大幅波动的风险；（4）持有基金份额占比较高的投资者在召开基金份额持有人大会并对重大事项进行投票表决时，可能拥有较大话语权；（5）极端情况下，持有基金份额占比较高的投资者大量赎回后，可能出现连续六十个工作日基金资产净值低于5000万元而面临的转换基金运作方式、与其他基金合并或者终止基金合同等风险。							

11.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

天弘基金管理有限公司

二〇一七年八月二十八日