

天弘永定价值成长混合型证券投资基金2016年年度报告摘要

2016年12月31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

送出日期：2017年3月30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2017年3月28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2016年1月1日起至2016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2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	473,526,045.44
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，为投资人创造超额收益。
投资策略	本基金为主动管理的混合型基金，主要投资于国内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的国债、金融债、企业债、可转换债券以及权证、货币市场工具等投资品种。本基金投资坚持"股票为主、精选个股"的投资策略，同时适当运用股票、债券等资产灵活配置的投资策略，以优化基金净值的波动。
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
信息披露人姓名	童建林	张志永

露负责人	联系电话	022-83310208	021-62677777*212004
	电子邮箱	service@thfund.com.cn	zhangzhy@cib.com.cn
客户服务电话		4007109999	95561
传真		022-83865569	021-62159217

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	2016年	2015年	2014年
本期已实现收益	25,242,482.91	70,584,278.04	36,269,903.51
本期利润	30,809,927.20	70,679,573.74	33,914,644.74
加权平均基金份额本期利润	0.1495	0.4258	0.3109
本期基金份额净值增长率	17.45%	31.43%	41.80%
3.1.2 期末数据和指标	2016年末	2015年末	2014年末
期末可供分配基金份额利润	0.7388	0.5244	0.1904
期末基金资产净值	870,096,066.07	180,852,050.23	143,392,456.06
期末基金份额净值	1.8375	1.5645	1.1904

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	份额净值增长	份额净值增长	业绩比较基准	业绩比较基准	①-③	②-④
----	--------	--------	--------	--------	-----	-----

	率①	率标准 差②	收益率 ③	收益率 标准差 ④		
过去三个月	1.28%	0.76%	1.43%	0.57%	-0.15%	0.19%
过去六个月	12.08%	0.83%	4.28%	0.61%	7.80%	0.22%
过去一年	17.45%	1.51%	-8.16%	1.12%	25.61%	0.39%
过去三年	118.88 %	1.73%	38.69%	1.43%	80.19%	0.30%
过去五年	135.43 %	1.65%	40.58%	1.30%	94.85%	0.35%
自基金合同生效日起 至今（2008年12月02 日-2016年12月31日）	145.05 %	1.61%	75.33%	1.32%	69.72%	0.29%

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，分别反映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是60%-95%，债券和短期金融工具的投资比例范围是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，再用连锁计算的方式得到基准指数的时间序列。

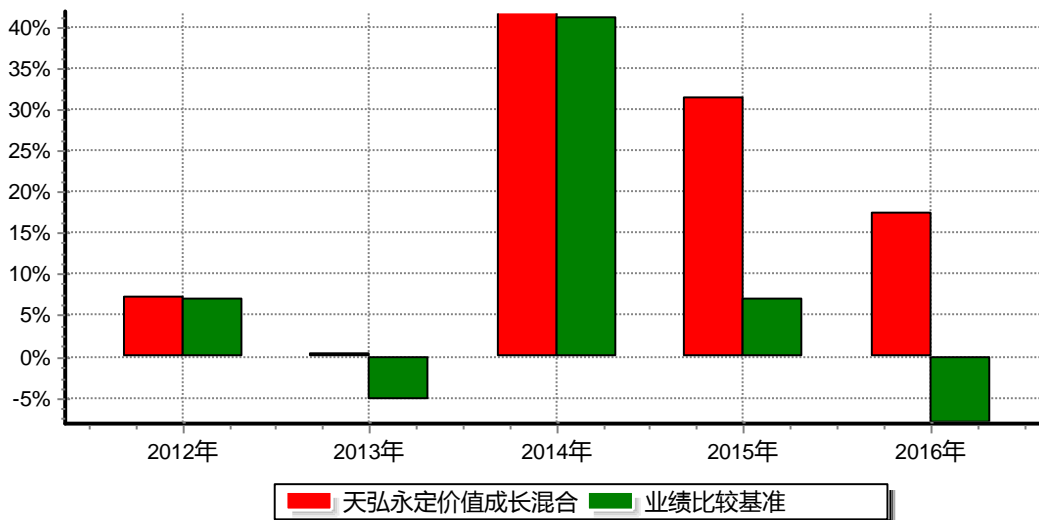
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较



注：1、本基金合同于2008年12月2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2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2016年12月31日，本基金管理人共管理53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、天弘普惠养老保本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、天弘鑫安宝保本混合型证券投资基金、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。

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	2014年1月	—	8年	男，经济学硕士。历任富

	基金经 理;本公 司投资 研究部 总经理。				国基金管理有限公司行业 研究员。2013年8月加盟本 公司，历任股票研究部总 经理、基金经理助理等。
--	-----------------------------------	--	--	--	---

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合规守信情况的说明

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、所有投资交易品种、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授权、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，通过交易系统内的公平交易程序，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》和公司内部场外、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发行分配的原则或价格优先、比例分配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不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

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

2016年A股整体走势以震荡为主，市场机会方面，呈现结构性牛市与结构性熊市并存，上涨的股票集中在生活资料领域，以衣食住行为主线，而下跌的股票集中在传媒、计算机、通信等行业。

本基金在年初重仓配置了养殖、白酒两个行业，持仓特点是行业集中，个股分散，顺应市场风格的配置使得上半年实现了较好的收益，将年初受累于熔断的亏损基本弥补回来了。

在上市公司年报、一季报陆续披露后，经济开始启动新一轮上升周期的信号逐渐清晰，因此年中继续加大了生活资料的配置比例，尤其是景气度显著上升的乘用车行业，以及地产，都获得了较好的收益。

进入三季度，进一步确认经济上升趋势后，逐步增加了生产资料的配置比例，降低了生活资料的仓位，实现了净值的平稳，回撤幅度可控。

回顾全年的运作，超额收益的实现，除了配置方向的正确以外，更为重要的是规避

了市场主要的下跌板块及个股，践行了有所为有所不为的策略，重点回避了高估值的TMT股票。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2016年12月31日，本基金份额净值为1.8375元。本报告期本基金份额净值增长率17.45%，同期业绩比较基准增长率-8.16%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

对于参与股市的投资者，无论是投资股票还是基金，都需要有一套完整的投资体系，如果再往下细拆，可分为三套有机的子系统，分别是解释系统、应对系统、预测系统，各自对应的任务是解释过去、应对当下、预测未来。

这三套子系统的关系是相辅相成的有机一体，首先要面向未来的一个投资决策时，需要对未来进行各种预测，那我们当然首先需要的就是预测系统，以进行科学、合理的预测。要想预测未来，就要掌握一定的规律，包括经济规律、金融规律、社会规律等，而这些规律一定是在过去某些时候显过灵，否则就不称为规律了。所以我们就得从已经过去的历史中寻找规律，要善于从历史中观察、归纳出规律来，这就需要我们有一套解释系统，用来科学、合理地解释过去发生的历史。正所谓，我们如何预测这个世界，取决于我们如何看待这个世界。

有了解释系统与预测系统，我们就可以开始构建自己的投资组合了，看好什么就配什么。由于我们对世界的认知是不完备的，随着时间的推移，有些我们以为的规律其实并不准确，有更正确的规律在发生作用，股价的走势往往并不如我们预期的那样，甚至相反，这个时候，我们就要调整组合了，这就需要一套应对系统了。

美国前国防部长拉姆斯菲尔德的自传取名为《已知与未知》，正是基于他的一段名言“据我们所知，有‘已知的已知’，有些事，我们知道我们知道。我们也知道，有‘已知的未知’，也就是说，有些事，我们现在知道我们不知道。但是，同样存在‘未知的未知’——有些事，我们不知道我们不知道”。

在股市中每天要接收和处理海量信息，这些信息中，有些是已知的已知，比如保险举牌监管收紧，相关股票也跌了。有些是已知的未知，我们都知道特朗普早晚会有针对中国的贸易政策出台，政策是否友好，这就是未知的了。还有一些是未知的未知，比如朝鲜的大部分动向，对于A股投资者都属于此类。事实上，影响A股走向的，是未知的未知，而不是已知的未知，更不是已知的已知。

面对着无法预测的未知的未知，正确的选择是放弃去预测，转而去寻找A股本身运行机理中有机可循的规律，从而提高预测的准确度。

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

报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

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

报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等

方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为；基金管理人在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

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

本托管人认真复核了本年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

§ 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查看审计报告全文。

§ 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：2016年12月31日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	106,069,732.71	34,639,698.77
结算备付金		10,257,750.70	2,261,580.63
存出保证金		1,029,334.80	1,044,887.51
交易性金融资产	7.4.7.2	794,063,732.01	148,890,865.44
其中：股票投资		794,063,732.01	148,890,865.44
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	62,997.63	24,623.02
应收股利		—	—
应收申购款		4,055,853.76	54,335.48
递延所得税资产		—	—
其他资产	7.4.7.6	—	—
资产总计		915,539,401.61	189,344,549.29
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015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		34,347,517.05	5,757,948.47
应付赎回款		4,639,084.61	890,322.97
应付管理人报酬		1,105,977.50	239,773.30
应付托管费		184,329.57	39,962.22
应付销售服务费		—	—
应付交易费用	7.4.7.7	4,750,272.48	1,057,608.34
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	376,775.63	467,505.06
负债合计		45,443,335.54	8,492,499.06
所有者权益:			
实收基金	7.4.7.9	473,526,045.44	115,596,935.37
未分配利润	7.4.7.10	396,570,020.63	65,255,114.86

所有者权益合计		870,096,066.07	180,852,050.23
负债和所有者权益总计		915,539,401.61	189,344,549.29

注：报告截止日2016年12月31日，基金份额净值1.8375元，基金份额总额473,526,045.44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：2016年1月1日至2016年12月31日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2016年1月1日至 2016年12月31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015 年12月31日
一、收入		50,539,921.29	87,438,954.67
1.利息收入		1,028,302.63	1,006,705.26
其中：存款利息收入	7.4.7.11	1,023,302.63	1,006,705.26
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		5,000.00	—
其他利息收入		—	—
2.投资收益（损失以“-”填列）		43,320,130.54	85,116,484.19
其中：股票投资收益	7.4.7.12	40,886,995.50	82,899,357.41
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	2,433,135.04	2,217,126.78
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	5,567,444.29	95,295.70

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	624,043.83	1,220,469.52
减：二、费用		19,729,994.09	16,759,380.93
1. 管理人报酬		5,297,663.44	3,808,389.79
2. 托管费		882,943.85	634,731.60
3. 销售服务费		—	—
4. 交易费用	7.4.7.20	13,184,600.31	11,930,377.15
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	364,786.49	385,882.39
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		30,809,927.20	70,679,573.74
减：所得税费用		—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		30,809,927.20	70,679,573.74

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：2016年1月1日至2016年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2016年1月1日至2016年12月31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)	115,596,935.37	65,255,114.86	180,852,050.23
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	30,809,927.20	30,809,927.20
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)	357,929,110.07	300,504,978.57	658,434,088.64

其中：1.基金申购款	654,163,494.54	526,491,095.00	1,180,654,589.54
2.基金赎回款	-296,234,384.47	-225,986,116.43	-522,220,500.90
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）	473,526,045.44	396,570,020.63	870,096,066.07
项 目	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月31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)	120,456,640.43	22,935,815.63	143,392,456.06
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	70,679,573.74	70,679,573.74
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)	-4,859,705.06	-28,360,274.51	-33,219,979.57
其中：1.基金申购款	618,293,227.46	344,198,494.52	962,491,721.98
2.基金赎回款	-623,152,932.52	-372,558,769.03	-995,711,701.55
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）	115,596,935.37	65,255,114.86	180,852,050.23

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：

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

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(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]第755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基金合同》于2008年12月2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2017年3月30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。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2016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2016年12月31日的财务状况以及2016年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 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相一致。

7.4.5 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。

7.4.6 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。

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、基金销售机构
浙江蚂蚁小微金融服务集团股份有限公司	基金管理人的股东
天津信托有限责任公司	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
芜湖高新投资有限公司	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
新疆天惠新盟股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
新疆天阜恒基股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
新疆天聚宸兴股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
天弘创新资产管理有限公司("天弘创新")	基金管理人的全资子公司

注：1、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

2、2016年度内，本基金管理人股东"浙江蚂蚁小微金融服务集团有限公司"的名称变更为"浙江蚂蚁小微金融服务集团股份有限公司"。

7.4.8 本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	上年度可比期间
----	----	---------

	2016年1月1日至2016年12月 31日	2015年1月1日至2015年12月 31日
当期发生的基金应支付的管理费	5,297,663.44	3,808,389.79
其中：支付销售机构的客户维护费	996,221.46	400,627.09

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列支的费用项目。

7.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年12月 31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月 31日
当期发生的基金应支付的托管费	882,943.85	634,731.60

注：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

本报告期及上年度可比期间未与关联方进行过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 2016年1月1日至2016年12月 31日	上年度可比期间 2015年1月1日至2015年12月 31日
基金合同生效日（2008年12	—	—

月2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	1.34%	5.50%

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 2016年1月1日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年1月1日至2015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	106,069,732.71	935,284.44	34,639,698.77	919,799.70

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。

7.4.9 期末(2016年12月31日)本基金持有的流通受限证券

7.4.9.1 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/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位: 人民币元

股票	股票	停牌	停牌原因	期末	复牌	复牌	数量	期末	期末
----	----	----	------	----	----	----	----	----	----

代码	名称	日期		估值单价	日期	开盘单价	(单位:股)	成本总额	估值总额
000727	华东科技	2016-11-17	重大资产重组	3.37	2017-02-15	3.47	297,123	1,052,864.58	1,001,304.51
002025	航天电器	2016-09-12	重大资产重组	25.20	-	—	61	1,404.21	1,537.20
002156	通富微电	2016-12-28	重大事项	11.38	2017-01-05	11.65	20	287.55	227.60
300100	双林股份	2016-11-07	重大资产重组	34.00	2017-01-25	30.60	79	2,364.21	2,686.00
300449	汉邦高科	2016-11-11	重大资产重组	44.29	2017-02-24	43.88	5	202.19	221.45

注：本基金截至2016年12月31日止持有以上因公布的重大事项可能产生重大影响而被暂时停牌的股票，该类股票将在所公布事项的重大影响消除后，经交易所批准复牌。

7.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2016年12月31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。

7.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2016年12月31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。

7.4.10 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2016年12月31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属于第一层次的余额为793,057,755.25元，属于第二层次的余额为1,005,976.76元，无属于第三层次的余额(2015年12月31日：第一层次143,049,523.19元，第二层次5,841,342.25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2016年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2015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)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 8 投资组合报告

8.1 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	794,063,732.01	86.73
	其中：股票	794,063,732.01	86.73
2	固定收益投资	—	—
	其中：债券	—	—

	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	—	—
	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	116,327,483.41	12.71
7	其他各项资产	5,148,186.19	0.56
8	合计	915,539,401.61	100.00

8.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

金额单位：人民币元

代码	行业类别	公允价值（元）	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	66,196,785.94	7.61
B	采矿业	—	—
C	制造业	672,012,537.89	77.23
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	8,351,207.20	0.96
E	建筑业	129,324.63	0.01
F	批发和零售业	1,043,854.25	0.12
G	交通运输、仓储和邮政业	110,612.47	0.01
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	11,138,640.98	1.28
J	金融业	472,658.89	0.05
K	房地产业	289,852.54	0.03
L	租赁和商务服务业	33,878,916.50	3.89
M	科学研究和技术服务业	590.22	—
N	水利、环境和公共设施管理业	—	—
O	居民服务、修理和其他服务业	—	—
P	教育	—	—
Q	卫生和社会工作	—	—

R	文化、体育和娱乐业	2,890.88	—
S	综合	435,859.62	0.05
	合计	794,063,732.01	91.26

8.3 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

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	601100	恒立液压	4,838,103	77,699,934.18	8.93
2	300257	开山股份	3,928,238	67,408,564.08	7.75
3	603338	浙江鼎力	1,283,572	66,886,936.92	7.69
4	002714	牧原股份	2,843,348	66,193,141.44	7.61
5	300124	汇川技术	3,222,787	65,519,259.71	7.53
6	300476	胜宏科技	2,769,350	63,279,647.50	7.27
7	601633	长城汽车	5,560,661	61,500,910.66	7.07
8	000581	威孚高科	1,812,858	40,680,533.52	4.68
9	600178	东安动力	3,678,037	40,605,528.48	4.67
10	600093	禾嘉股份	2,336,477	33,878,916.50	3.89

注：投资者欲了解本报告期末基金投资的所有股票明细，应阅读登载于本公司网站的年度报告正文。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 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	002714	牧原股份	118,870,148.85	65.73
2	300124	汇川技术	116,861,943.87	64.62
3	601633	长城汽车	106,069,803.84	58.65
4	600178	东安动力	92,347,541.64	51.06
5	600418	江淮汽车	90,203,083.85	49.88
6	600166	福田汽车	82,076,322.00	45.38

7	000581	威孚高科	82,030,320.94	45.36
8	603338	浙江鼎力	80,821,902.75	44.69
9	000338	潍柴动力	72,417,103.88	40.04
10	300257	开山股份	70,608,315.02	39.04
11	601100	恒立液压	67,060,106.14	37.08
12	600499	科达洁能	62,048,702.29	34.31
13	601336	新华保险	61,647,700.22	34.09
14	300476	胜宏科技	60,463,837.38	33.43
15	600741	华域汽车	54,088,818.89	29.91
16	600582	天地科技	53,766,200.53	29.73
17	002501	利源精制	53,630,859.36	29.65
18	600093	禾嘉股份	52,640,226.35	29.11
19	000625	长安汽车	52,049,514.11	28.78
20	002241	歌尔股份	51,042,014.25	28.22
21	600309	万华化学	50,836,117.94	28.11
22	002157	正邦科技	49,356,217.38	27.29
23	601717	郑煤机	49,030,649.13	27.11
24	600660	福耀玻璃	47,664,248.08	26.36
25	002202	金风科技	45,843,909.34	25.35
26	000528	柳 工	45,234,902.56	25.01
27	600104	上汽集团	43,553,224.96	24.08
28	601628	中国人寿	42,004,926.05	23.23
29	002477	雏鹰农牧	40,748,102.87	22.53
30	600702	沱牌舍得	40,593,584.77	22.45
31	002480	新筑股份	40,580,102.55	22.44
32	600016	民生银行	39,911,281.69	22.07
33	002124	天邦股份	38,866,267.79	21.49
34	000680	山推股份	38,395,547.61	21.23
35	600031	三一重工	38,244,230.81	21.15
36	300182	捷成股份	37,763,793.58	20.88

37	600984	*ST建机	36,782,863.76	20.34
38	002299	圣农发展	36,418,453.55	20.14
39	000550	江铃汽车	36,268,963.71	20.05
40	600873	梅花生物	35,749,698.00	19.77
41	002535	林州重机	35,513,060.49	19.64
42	000157	中联重科	35,294,442.99	19.52
43	000860	顺鑫农业	35,119,528.91	19.42
44	002321	华英农业	35,096,358.00	19.41
45	601601	中国太保	31,851,497.72	17.61
46	600074	保千里	30,058,712.03	16.62
47	300227	光韵达	29,562,418.27	16.35
48	000425	徐工机械	28,656,659.00	15.85
49	000951	中国重汽	26,856,433.13	14.85
50	000669	金鸿能源	26,733,822.02	14.78
51	000815	美利云	26,650,826.31	14.74
52	600805	悦达投资	26,471,753.54	14.64
53	600340	华夏幸福	25,984,293.95	14.37
54	300012	华测检测	25,509,936.10	14.11
55	600751	天海投资	25,201,781.00	13.94
56	600815	厦工股份	24,587,953.29	13.60
57	600297	广汇汽车	24,484,434.00	13.54
58	002304	洋河股份	24,342,085.72	13.46
59	600169	太原重工	24,072,499.00	13.31
60	600515	海岛建设	23,362,902.08	12.92
61	000001	平安银行	23,253,664.36	12.86
62	000869	张裕A	23,218,901.51	12.84
63	000727	华东科技	22,889,438.98	12.66
64	300498	温氏股份	22,771,244.78	12.59
65	600266	北京城建	22,307,169.34	12.33
66	002419	天虹商场	22,099,334.53	12.22

67	600307	酒钢宏兴	22,047,184.82	12.19
68	000596	古井贡酒	21,756,808.00	12.03
69	600376	首开股份	21,693,582.29	12.00
70	000401	冀东水泥	21,563,413.22	11.92
71	002646	青青稞酒	21,002,764.13	11.61
72	600398	海澜之家	20,801,101.11	11.50
73	002481	双塔食品	20,770,154.86	11.48
74	600478	科力远	20,738,863.76	11.47
75	600919	江苏银行	20,718,565.00	11.46
76	000858	五 粮 液	19,877,809.43	10.99
77	600617	国新能源	19,799,764.65	10.95
78	002142	宁波银行	19,658,760.84	10.87
79	600885	宏发股份	18,799,787.05	10.40
80	600585	海螺水泥	18,790,176.00	10.39
81	603369	今世缘	18,329,969.63	10.14
82	601933	永辉超市	18,262,866.00	10.10
83	002024	苏宁云商	18,176,556.06	10.05
84	601965	中国汽研	17,860,802.67	9.88
85	000039	中集集团	17,463,795.00	9.66
86	002538	司尔特	17,416,095.00	9.63
87	600519	贵州茅台	17,125,675.95	9.47
88	601818	光大银行	17,063,444.00	9.44
89	000800	一汽轿车	16,842,688.02	9.31
90	600998	九州通	16,517,163.77	9.13
91	601318	中国平安	16,191,426.00	8.95
92	601002	晋亿实业	16,060,267.42	8.88
93	002267	陕天然气	15,658,037.68	8.66
94	601989	中国重工	15,466,894.81	8.55
95	600115	东方航空	15,291,033.00	8.46
96	600433	冠豪高新	15,280,868.30	8.45

97	002746	仙坛股份	15,230,934.20	8.42
98	600026	中海发展	14,883,121.00	8.23
99	601069	西部黄金	14,719,750.04	8.14
100	000793	华闻传媒	14,311,233.00	7.91
101	600559	老白干酒	14,236,905.00	7.87
102	600036	招商银行	14,059,402.80	7.77
103	601988	中国银行	14,030,530.00	7.76
104	601169	北京银行	13,748,053.00	7.60
105	300479	神思电子	13,563,260.52	7.50
106	300017	网宿科技	13,543,816.21	7.49
107	002559	亚威股份	13,483,342.88	7.46
108	601998	中信银行	13,346,054.00	7.38
109	600015	华夏银行	13,149,873.70	7.27
110	600062	华润双鹤	12,917,826.93	7.14
111	600975	新五丰	12,608,844.49	6.97
112	600963	岳阳林纸	12,443,029.40	6.88
113	600000	浦发银行	12,203,512.19	6.75
114	000568	泸州老窖	11,977,707.28	6.62
115	600655	豫园商城	11,834,313.78	6.54
116	600325	华发股份	11,826,457.05	6.54
117	600009	上海机场	11,722,650.54	6.48
118	002146	荣盛发展	11,460,169.00	6.34
119	002327	富安娜	11,209,343.09	6.20
120	000831	*ST五稀	11,147,264.53	6.16
121	601009	南京银行	11,062,922.70	6.12
122	000848	承德露露	11,058,827.66	6.11
123	601198	东兴证券	10,999,439.90	6.08
124	000046	泛海控股	10,828,070.02	5.99
125	300365	恒华科技	10,807,800.00	5.98
126	000983	西山煤电	10,656,247.92	5.89

127	601111	中国国航	10,363,771.14	5.73
128	000026	飞亚达 A	10,331,024.00	5.71
129	600197	伊力特	10,304,809.80	5.70
130	000606	神州易桥	10,117,035.00	5.59
131	000980	金马股份	10,042,398.00	5.55
132	002294	信立泰	10,030,052.68	5.55
133	002727	一心堂	9,896,164.66	5.47
134	600029	南方航空	9,853,901.00	5.45
135	603686	龙马环卫	9,664,914.00	5.34
136	600584	长电科技	9,544,526.94	5.28
137	000886	海南高速	9,299,200.50	5.14
138	000065	北方国际	9,103,116.00	5.03
139	600477	杭萧钢构	9,025,021.36	4.99
140	600489	中金黄金	8,999,539.36	4.98
141	601088	中国神华	8,995,599.56	4.97
142	600779	*ST水井	8,989,748.47	4.97
143	601939	建设银行	8,903,542.88	4.92
144	600338	西藏珠峰	8,812,887.78	4.87
145	600881	亚泰集团	8,765,913.75	4.85
146	600295	鄂尔多斯	8,680,891.21	4.80
147	002234	民和股份	8,669,852.71	4.79
148	000937	冀中能源	8,632,605.28	4.77
149	601233	桐昆股份	8,521,734.48	4.71
150	000823	超声电子	8,515,225.00	4.71
151	601888	中国国旅	8,507,332.94	4.70
152	000572	海马汽车	8,411,264.00	4.65
153	002751	易尚展示	8,395,089.57	4.64
154	600405	动力源	8,372,910.50	4.63
155	601985	中国核电	8,333,365.00	4.61
156	002298	中电鑫龙	8,310,581.20	4.60

157	601608	中信重工	8,212,895.53	4.54
158	002371	北方华创	8,128,680.00	4.49
159	600518	康美药业	8,077,609.55	4.47
160	601021	春秋航空	8,077,569.56	4.47
161	601238	广汽集团	8,045,993.44	4.45
162	600495	晋西车轴	7,988,939.00	4.42
163	601106	中国一重	7,926,679.85	4.38
164	002568	百润股份	7,915,229.58	4.38
165	002236	大华股份	7,664,428.13	4.24
166	600221	海南航空	7,641,954.50	4.23
167	600136	当代明诚	7,594,234.10	4.20
168	300036	超图软件	7,558,555.21	4.18
169	002292	奥飞娱乐	7,463,496.59	4.13
170	002434	万里扬	7,366,027.96	4.07
171	601168	西部矿业	7,355,849.16	4.07
172	002456	欧菲光	7,331,798.50	4.05
173	600547	山东黄金	7,320,033.64	4.05
174	002097	山河智能	7,318,758.98	4.05
175	600320	振华重工	7,311,342.63	4.04
176	002103	广博股份	6,867,778.00	3.80
177	000952	广济药业	6,821,157.31	3.77
178	002078	太阳纸业	6,767,442.00	3.74
179	002320	海峡股份	6,759,551.46	3.74
180	002180	艾派克	6,693,176.20	3.70
181	600118	中国卫星	6,588,612.12	3.64
182	601678	滨化股份	6,526,185.00	3.61
183	603885	吉祥航空	6,522,093.00	3.61
184	600558	大西洋	6,499,409.44	3.59
185	300103	达刚路机	6,472,027.84	3.58
186	002665	首航节能	6,324,646.50	3.50

187	002427	尤夫股份	6,090,614.00	3.37
188	002458	益生股份	6,023,934.24	3.33
189	600109	国金证券	5,844,770.00	3.23
190	601688	华泰证券	5,842,652.00	3.23
191	600348	阳泉煤业	5,786,975.00	3.20
192	601139	深圳燃气	5,771,630.35	3.19
193	603589	口子窖	5,760,220.00	3.19
194	300098	高新兴	5,569,551.00	3.08
195	002191	劲嘉股份	5,444,295.07	3.01
196	600395	盘江股份	5,403,118.29	2.99
197	601668	中国建筑	5,376,865.00	2.97
198	600809	山西汾酒	5,243,087.37	2.90
199	002429	兆驰股份	5,150,683.00	2.85
200	002032	苏泊尔	5,082,761.00	2.81
201	002344	海宁皮城	5,068,736.41	2.80
202	601117	中国化学	4,895,581.00	2.71
203	002051	中工国际	4,854,105.00	2.68
204	600692	亚通股份	4,750,539.00	2.63
205	600343	航天动力	4,749,485.98	2.63
206	600879	航天电子	4,733,105.30	2.62
207	300236	上海新阳	4,727,622.00	2.61
208	300197	铁汉生态	4,532,989.96	2.51
209	002002	鸿达兴业	4,527,662.00	2.50
210	603001	奥康国际	4,478,620.36	2.48
211	600594	益佰制药	4,460,952.28	2.47
212	600276	恒瑞医药	4,409,110.66	2.44
213	000666	经纬纺机	4,275,846.18	2.36
214	600239	云南城投	4,234,613.00	2.34
215	600322	天房发展	4,188,888.00	2.32
216	000927	一汽夏利	3,982,652.00	2.20

217	002648	卫星石化	3,942,408.51	2.18
218	002153	石基信息	3,921,684.00	2.17
219	300273	和佳股份	3,912,012.00	2.16
220	300159	新研股份	3,909,281.00	2.16
221	600595	中孚实业	3,866,397.03	2.14
222	600207	安彩高科	3,859,657.00	2.13
223	300449	汉邦高科	3,845,712.81	2.13
224	000752	西藏发展	3,843,471.93	2.13
225	600681	万鸿集团	3,826,799.06	2.12
226	300319	麦捷科技	3,826,573.00	2.12
227	002025	航天电器	3,798,280.00	2.10
228	600111	北方稀土	3,783,375.00	2.09
229	002508	老板电器	3,732,548.00	2.06
230	600084	中葡股份	3,728,788.51	2.06
231	000030	富奥股份	3,678,014.96	2.03
232	000876	新希望	3,669,151.00	2.03

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。

8.4.2 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	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	600166	福田汽车	82,009,484.62	45.35
2	000338	潍柴动力	71,918,236.17	39.77
3	600499	科达洁能	63,722,050.42	35.23
4	601336	新华保险	60,852,604.56	33.65
5	002714	牧原股份	60,572,241.37	33.49
6	002157	正邦科技	60,296,783.58	33.34
7	002501	利源精制	58,234,094.00	32.20
8	600582	天地科技	57,066,783.80	31.55
9	600178	东安动力	56,771,493.34	31.39

10	300124	汇川技术	55,935,679.69	30.93
11	600418	江淮汽车	53,050,505.86	29.33
12	600309	万华化学	52,960,379.35	29.28
13	600741	华域汽车	51,457,054.43	28.45
14	601717	郑煤机	51,407,104.87	28.42
15	000625	长安汽车	49,995,318.70	27.64
16	601633	长城汽车	48,526,421.35	26.83
17	600660	福耀玻璃	46,376,351.67	25.64
18	002202	金风科技	45,469,408.02	25.14
19	002477	雏鹰农牧	45,414,128.56	25.11
20	000528	柳 工	45,073,531.54	24.92
21	601628	中国人寿	42,986,262.02	23.77
22	600104	上汽集团	41,796,453.12	23.11
23	002124	天邦股份	41,522,684.46	22.96
24	600702	沱牌舍得	41,451,525.39	22.92
25	002299	圣农发展	41,421,728.61	22.90
26	000860	顺鑫农业	40,468,115.38	22.38
27	600016	民生银行	39,801,816.65	22.01
28	600031	三一重工	39,489,158.99	21.84
29	300182	捷成股份	37,264,271.51	20.60
30	000680	山推股份	37,161,275.85	20.55
31	000581	威孚高科	36,967,281.30	20.44
32	002321	华英农业	35,515,109.98	19.64
33	000157	中联重科	35,439,368.77	19.60
34	002241	歌尔股份	34,859,765.45	19.28
35	600873	梅花生物	34,649,503.99	19.16
36	002304	洋河股份	31,653,034.61	17.50
37	601601	中国太保	30,508,011.74	16.87
38	000669	金鸿能源	30,027,177.20	16.60
39	600074	保千里	29,932,843.03	16.55

40	600751	天海投资	29,872,462.06	16.52
41	000596	古井贡酒	29,401,106.99	16.26
42	000951	中国重汽	28,293,915.59	15.64
43	300227	光韵达	28,089,347.35	15.53
44	000425	徐工机械	27,523,193.52	15.22
45	600805	悦达投资	27,016,160.09	14.94
46	600340	华夏幸福	25,517,896.60	14.11
47	300498	温氏股份	25,031,884.19	13.84
48	300012	华测检测	24,620,682.66	13.61
49	000815	美利云	24,489,823.45	13.54
50	600376	首开股份	24,135,614.10	13.35
51	600297	广汇汽车	23,674,116.13	13.09
52	600169	太原重工	23,533,142.55	13.01
53	600815	厦工股份	23,391,225.09	12.93
54	000001	平安银行	23,339,535.15	12.91
55	600515	海岛建设	23,214,032.99	12.84
56	000869	张裕A	23,136,645.72	12.79
57	002419	天虹商场	22,900,991.41	12.66
58	002646	青青稞酒	22,736,260.55	12.57
59	600266	北京城建	22,461,884.47	12.42
60	600093	禾嘉股份	22,215,713.52	12.28
61	600307	酒钢宏兴	21,948,761.07	12.14
62	002481	双塔食品	21,588,931.37	11.94
63	000401	冀东水泥	21,456,784.49	11.86
64	000858	五粮液	21,292,435.60	11.77
65	600478	科力远	20,764,700.31	11.48
66	600398	海澜之家	20,763,456.43	11.48
67	600433	冠豪高新	20,528,237.36	11.35
68	600519	贵州茅台	20,415,317.75	11.29
69	603369	今世缘	20,196,716.46	11.17

70	000727	华东科技	20,040,950.72	11.08
71	600919	江苏银行	19,912,388.44	11.01
72	002142	宁波银行	19,834,030.70	10.97
73	601965	中国汽研	19,178,277.79	10.60
74	600585	海螺水泥	17,808,260.69	9.85
75	002538	司尔特	17,782,213.87	9.83
76	002024	苏宁云商	17,681,263.83	9.78
77	601988	中国银行	17,409,931.61	9.63
78	601933	永辉超市	17,369,886.24	9.60
79	603338	浙江鼎力	17,067,391.79	9.44
80	600998	九州通	16,950,429.13	9.37
81	000039	中集集团	16,911,040.93	9.35
82	601818	光大银行	16,841,533.00	9.31
83	601318	中国平安	16,504,553.60	9.13
84	002267	陕天然气	16,147,968.19	8.93
85	000800	一汽轿车	15,760,128.40	8.71
86	601002	晋亿实业	15,719,464.99	8.69
87	002746	仙坛股份	15,646,135.32	8.65
88	601989	中国重工	15,518,752.51	8.58
89	600115	东方航空	15,483,215.60	8.56
90	601069	西部黄金	15,365,520.20	8.50
91	600036	招商银行	15,052,457.69	8.32
92	600026	中海发展	14,938,059.99	8.26
93	600975	新五丰	14,557,621.95	8.05
94	600963	岳阳林纸	14,531,494.11	8.04
95	600559	老白干酒	14,496,240.31	8.02
96	601169	北京银行	14,391,916.01	7.96
97	000793	华闻传媒	14,310,591.04	7.91
98	600015	华夏银行	13,357,097.92	7.39
99	601998	中信银行	13,229,820.13	7.32

100	000568	泸州老窖	13,185,114.68	7.29
101	002294	信立泰	13,163,129.76	7.28
102	300479	神思电子	12,993,743.45	7.18
103	300017	网宿科技	12,919,852.02	7.14
104	600584	长电科技	12,777,940.29	7.07
105	600000	浦发银行	12,696,600.98	7.02
106	600325	华发股份	12,612,052.90	6.97
107	600489	中金黄金	12,525,436.93	6.93
108	600062	华润双鹤	12,462,564.04	6.89
109	002559	亚威股份	12,326,357.54	6.82
110	000848	承德露露	12,000,559.26	6.64
111	601009	南京银行	11,992,778.83	6.63
112	600655	豫园商城	11,748,268.69	6.50
113	000046	泛海控股	11,631,289.03	6.43
114	600009	上海机场	11,313,879.13	6.26
115	002327	富安娜	11,311,803.71	6.25
116	002146	荣盛发展	11,258,018.80	6.22
117	000550	江铃汽车	11,017,437.96	6.09
118	601198	东兴证券	10,934,293.18	6.05
119	002535	林州重机	10,913,089.95	6.03
120	603686	龙马环卫	10,836,261.00	5.99
121	000831	*ST五稀	10,727,080.88	5.93
122	600617	国新能源	10,720,576.61	5.93
123	601111	中国国航	10,423,055.16	5.76
124	600029	南方航空	10,414,423.53	5.76
125	600197	伊力特	10,301,477.60	5.70
126	002665	首航节能	10,295,037.88	5.69
127	000886	海南高速	10,266,915.28	5.68
128	000983	西山煤电	10,262,195.58	5.67
129	002727	一心堂	10,116,396.99	5.59

130	000026	飞亚达 A	10,106,597.53	5.59
131	601888	中国国旅	10,057,575.70	5.56
132	600779	*ST水井	9,920,652.45	5.49
133	000980	金马股份	9,909,408.90	5.48
134	000606	神州易桥	9,835,341.05	5.44
135	002234	民和股份	9,591,743.30	5.30
136	300100	双林股份	9,538,179.34	5.27
137	601608	中信重工	9,389,473.79	5.19
138	601939	建设银行	9,244,659.32	5.11
139	000065	北方国际	9,180,028.02	5.08
140	600547	山东黄金	9,055,038.90	5.01
141	600477	杭萧钢构	8,997,666.79	4.98
142	600295	鄂尔多斯	8,995,719.96	4.97
143	600984	*ST建机	8,993,968.18	4.97
144	601088	中国神华	8,952,673.56	4.95
145	600338	西藏珠峰	8,733,808.33	4.83
146	600881	亚泰集团	8,639,933.71	4.78
147	000823	超声电子	8,536,403.00	4.72
148	002298	中电鑫龙	8,502,078.68	4.70
149	000937	冀中能源	8,298,102.11	4.59
150	601985	中国核电	8,262,443.00	4.57
151	601238	广汽集团	8,215,425.00	4.54
152	601233	桐昆股份	8,187,396.92	4.53
153	000572	海马汽车	8,177,315.67	4.52
154	600405	动力源	8,126,918.44	4.49
155	601106	中国一重	8,105,337.00	4.48
156	300098	高新兴	8,054,565.26	4.45
157	002751	易尚展示	8,025,945.44	4.44
158	600221	海南航空	7,997,310.00	4.42
159	601021	春秋航空	7,983,633.46	4.41

160	600136	当代明诚	7,894,686.12	4.37
161	600495	晋西车轴	7,787,022.13	4.31
162	600558	大西洋	7,608,427.20	4.21
163	002236	大华股份	7,587,850.41	4.20
164	600809	山西汾酒	7,535,067.20	4.17
165	002434	万里扬	7,527,482.19	4.16
166	002078	太阳纸业	7,500,733.50	4.15
167	601168	西部矿业	7,439,153.60	4.11
168	600518	康美药业	7,380,254.17	4.08
169	002292	奥飞娱乐	7,319,142.33	4.05
170	600320	振华重工	7,287,874.26	4.03
171	002371	北方华创	7,251,877.41	4.01
172	300036	超图软件	7,245,789.22	4.01
173	002097	山河智能	7,211,510.81	3.99
174	002568	百润股份	7,158,150.51	3.96
175	002456	欧菲光	7,108,420.59	3.93
176	002180	艾派克	7,084,655.89	3.92
177	600118	中国卫星	6,808,634.87	3.76
178	002320	海峡股份	6,745,877.06	3.73
179	000952	广济药业	6,686,999.48	3.70
180	601678	滨化股份	6,625,623.04	3.66
181	002103	广博股份	6,519,713.40	3.60
182	603885	吉祥航空	6,345,072.54	3.51
183	300257	开山股份	6,331,804.30	3.50
184	002458	益生股份	6,259,389.84	3.46
185	601688	华泰证券	6,187,693.88	3.42
186	300103	达刚路机	6,031,376.28	3.33
187	600109	国金证券	6,016,970.27	3.33
188	600395	盘江股份	5,948,264.66	3.29
189	002573	清新环境	5,945,231.42	3.29

190	603589	口子窖	5,827,279.91	3.22
191	002427	尤夫股份	5,767,380.63	3.19
192	601139	深圳燃气	5,622,867.05	3.11
193	601668	中国建筑	5,592,335.00	3.09
194	600348	阳泉煤业	5,566,723.84	3.08
195	000418	小天鹅 A	5,371,650.31	2.97
196	002051	中工国际	5,081,567.48	2.81
197	002032	苏泊尔	5,081,005.58	2.81
198	600343	航天动力	5,052,740.49	2.79
199	600692	亚通股份	4,978,462.60	2.75
200	600207	安彩高科	4,919,468.14	2.72
201	300236	上海新阳	4,906,047.94	2.71
202	600879	航天电子	4,901,053.45	2.71
203	000333	美的集团	4,843,638.62	2.68
204	601117	中国化学	4,825,770.10	2.67
205	002191	劲嘉股份	4,825,409.77	2.67
206	600276	恒瑞医药	4,808,750.98	2.66
207	600594	益佰制药	4,437,690.00	2.45
208	603001	奥康国际	4,411,983.16	2.44
209	600322	天房发展	4,379,824.30	2.42
210	002002	鸿达兴业	4,371,153.20	2.42
211	000666	经纬纺机	4,361,297.85	2.41
212	300197	铁汉生态	4,343,534.12	2.40
213	002429	兆驰股份	4,335,076.60	2.40
214	002480	新筑股份	4,235,806.88	2.34
215	300449	汉邦高科	4,214,356.00	2.33
216	300159	新研股份	4,145,421.80	2.29
217	600084	中葡股份	4,126,194.21	2.28
218	002344	海宁皮城	4,107,069.62	2.27
219	600239	云南城投	4,091,568.46	2.26

220	300273	和佳股份	4,085,016.05	2.26
221	002025	航天电器	4,079,798.70	2.26
222	000799	酒鬼酒	4,072,872.50	2.25
223	002153	石基信息	3,976,297.08	2.20
224	002508	老板电器	3,951,527.63	2.18
225	300319	麦捷科技	3,927,022.00	2.17
226	000938	紫光股份	3,924,404.16	2.17
227	600369	西南证券	3,918,334.54	2.17
228	600111	北方稀土	3,893,800.20	2.15
229	600595	中孚实业	3,846,679.22	2.13
230	000752	西藏发展	3,825,238.31	2.12
231	000927	一汽夏利	3,772,196.86	2.09
232	000558	莱茵体育	3,750,908.95	2.07
233	002156	通富微电	3,745,615.91	2.07
234	000876	新 希 望	3,719,852.79	2.06

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。

8.4.3 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

买入股票的成本（成交）总额	4,822,694,730.34
卖出股票的收入（成交）总额	4,223,976,303.56

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。

8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

8.6 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

本基金本报告期末未持有债券。

8.7 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。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 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。

8.11 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。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1

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。

8.12.2

基金投资的前十名股票，均为基金合同规定备选股票库之内的股票。

8.12.3 期末其他各项资产构成

金额单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	1,029,334.80
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	62,997.63
5	应收申购款	4,055,853.76
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	5,148,186.19

8.12.4 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。

8.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限情况。

8.12.6 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。

§ 9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

持有人户数 (户)	户均持有的基 金份额	持有人结构			
		机构投资者		个人投资者	
		持有 份额	占总份 额比例	持有 份额	占总份 额比例
575,238	823.18	150,114,665.95	31.70%	323,411,379.49	68.30%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	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基金	572,543.93	0.12%

9.3 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

本基金本报告期末未有本公司高级管理人员、基金投资和研究部门负责人及基金经理持有本开放式基金份额的情况。

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2008年12月2日)基金份额总额	291,108,692.74
本报告期期初基金份额总额	115,596,935.37
本报告期基金总申购份额	654,163,494.54

减：本报告期基金总赎回份额	296,234,384.47
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	473,526,045.44

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。

§ 11 重大事件揭示

11.1 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决议。

11.2 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，宁辰、张磊先生已离任本公司副总经理职务，具体信息请参见基金管理人于2016年4月30日和2016年7月2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。

11.3 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。

11.4 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。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内应向普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）支付服务费6万元。截至本报告期末，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）已为本基金提供审计服务8年。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

11.7.1 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	股票交易	应支付该券商的佣金	备注
------	-----	------	-----------	----

	元 数量	成交金额	占股票 成交总额比 例	佣金	占当期佣金 总量的比例	
渤海证券	1	749,027,040 .44	8.28%	697,570.65	8.55%	
光大证券	2	1,753,418,2 54.64	19.38%	1,632,967.0 2	20.02%	
国泰君安	2	1,331,793,5 70.42	14.72%	973,942.05	11.94%	
民生证券	1	1,611,643,4 59.01	17.82%	1,500,926.0 2	18.40%	
平安证券	1	164,489,979 .63	1.82%	153,190.20	1.88%	
招商证券	2	3,105,714,4 04.43	34.33%	2,892,354.1 4	35.45%	
中银国际	1	329,888,138 .83	3.65%	307,224.07	3.77%	

11.7.2 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		债券回购交易		权证交易	
	成交金 额	占债券 成交总额比 例	成交金 额	占债券回购 成交总额比 例	成交金 额	占权证 成交总额比 例
渤海证券	—	—	—	—	—	—
光大证券	—	—	—	—	—	—
国泰君安	—	—	—	—	—	—
民生证券	—	—	—	—	—	—
平安证券	—	—	—	—	—	—
招商证券	—	—	40,000,0 00.00	100.00%	—	—
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情况稳定；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5个，其中包括：光大证券深圳交易单元1个、天风证券上海交易单元1个、天风证券深圳交易单元1个、国泰君安证券上海交易单元1个、国泰君安证券深圳交易单元1个；

4、本基金报告期内停止租用交易单元：无。

天弘基金管理有限公司
二〇一七年三月三十日