

天弘鑫安宝保本混合型证券投资基金2016年半年度报告摘要

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：兴业银行股份有限公司

送出日期：2016年8月29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。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年8月25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2016年1月1日起至2016年6月30日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	天弘鑫安宝保本混合
基金主代码	001486
基金运作方式	契约型开放式，以定期开放的方式运作
基金合同生效日	2015年10月23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	739,354,674.96份
基金合同存续期	不定期

2.2 基金产品说明

投资目标	本基金将综合运用投资组合保险策略，严格控制风险，在为投资人提供投资金额安全保证的基础上力争实现基金资产的稳定增值。
投资策略	在投资策略方面，本基金将主要采用恒定比例组合保本策略（CPPI, ConstantProportion PortfolioInsurance），以数量化的分析模型为基础，通过动态地监控和调整基金在安全资产与风险资产上的投资比例，确保基金投资组合的风险暴露水平不超过基金可承担的损失限额（又称安全垫），以实现确保保本周期到期时本金安全的目标。同时，本基金通过积极稳健的股票投资策略，为基金实现资本增值。具体而言，本基金的投资策略包括大类资产配置策略、安全资产投资策略和风险资产投资策略。
业绩比较基准	本基金的业绩比较基准为：（一年期银行定期存款利率（税后）+0.5%）×2。
风险收益特征	本基金为保本混合型基金产品，属证券投资基金中的低风险品种，其预期风险与预期收益率低于股票型基金、非保本的混合型基金，高于货币市场基金和债券型基金。

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
信息披露负责人	姓名	童建林	张志永
	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

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	报告期（2016年1月1日至2016年6月30日）
本期已实现收益	14,068,922.63
本期利润	13,172,069.87
加权平均基金份额本期利润	0.0178
本期基金份额净值增长率	1.77%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2016年6月30日)
期末可供分配基金份额利润	0.0244
期末基金资产净值	759,067,946.42
期末基金份额净值	1.0267

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、期末可供分配利润为期末资产负债表中未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

4、本基金《基金合同》2015年10月23日起生效。

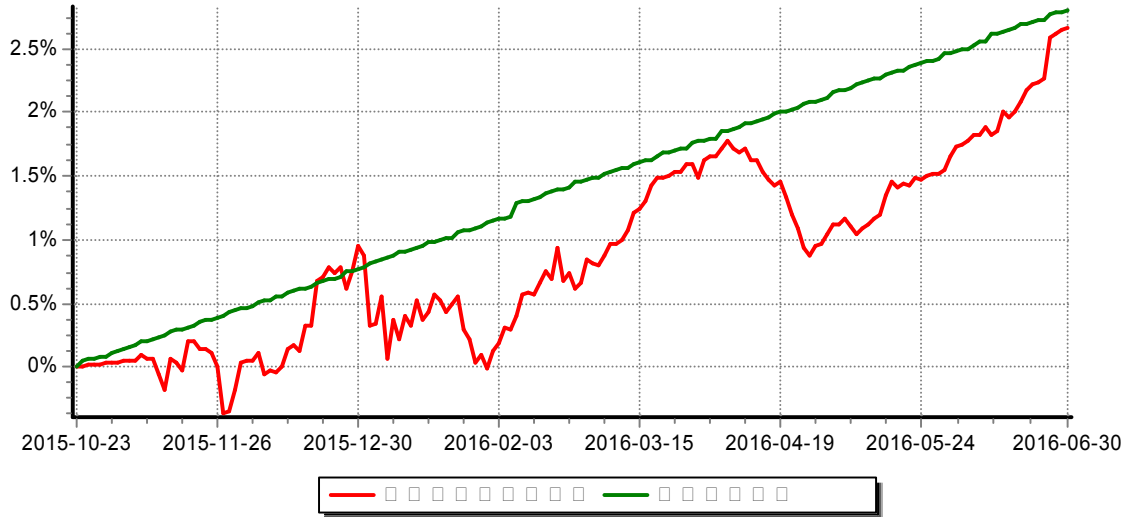
3.2 基金净值表现

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	0.99%	0.08%	0.33%	0.01%	0.66%	0.07%
过去三个月	0.99%	0.08%	0.99%	0.01%	0.00%	0.07%
过去六个月	1.77%	0.12%	2.01%	0.01%	-0.24%	0.11%
自基金合同生效日起至今（2015年10月23日-2016年06月30日）	2.67%	0.12%	2.80%	0.01%	-0.13%	0.11%

注：天弘鑫安宝保本混合基金的业绩比较基准为：（一年期银行定期存款利率（税后）+0.5%）×2。上述“一年期银行定期存款税后收益率”指当期保本周期起始日（若为第一个保本周期，则为基金合同生效日）中国人民银行公布并执行的一年期金融机构人民币存款基准税后利率。

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《基金合同》于2015年10月23日生效，本基金《基金合同》生效起至披露时点不满1年。
- 2、按照本基金《基金合同》的约定，基金管理人应当自基金合同生效之日起6个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。本基金的建仓期为2015年10月23日至2016年4月22日，建仓期结束时，各项资产配置比例均符合基金合同的约定。
- 3、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6月30日，本基金管理人共管理48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、天弘通利债券型证券投资基金、天弘同利分级债券型证券投资基金、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。

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		
陈钢	本基金基金经理；本公司副总经理、	2015年10月	—	14年	男，工商管理硕士。历任华龙证券公司固定收益部高级经理；北京宸星投资管理公司投资经理；兴业证券公司债券总部研究部

	固定收益总监兼固定收益部总经理。				经理；银华基金管理有限公司机构理财部高级经理；中国人寿资产管理有限公司固定收益部高级投资经理等。2011年7月加盟本公司。
钱文成	本基金基金经理。	2015年10月	—	10年	男，理学硕士。2007年5月加盟本公司，历任本公司行业研究员、高级研究员、策略研究员、研究主管助理、研究部副主管、研究副总监、研究总监、股票投资部副总经理、基金经理助理等。

注：1、上述任职日期为基金合同生效日。

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。

4.3.2 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年上半年，经济基本面1季度企稳反弹，2季度整体平稳，经济企稳改善的动力主要来自于稳增长政府基建投资拉动以及房地产投资见底反弹；通胀方面，1季度以蔬菜价格和猪肉价格为代表的食品价格上行，导致市场通胀担忧加剧，但随后蔬菜价格明显回落，证伪滞胀预期。政策面上，基建投资作为托底经济的主要手段，仍然维持较高增速，货币政策则维持稳健，仅于1季度进行一次降准操作，主要通过公开市场操作以及MLF等工具维护资金面稳定。资金面方面，1季度资金面波动率有所回升，频现脉冲式收紧，2季度资金面平稳程度明显改善，与央行对资金面态度转趋积极有关。债券市场行情方面，1季度债券市场走势出现分化，长端利率债以震荡行情为主，而中高等级、中短期限信用债受益于配置需求旺盛，收益率进一步下行，4月份由于中铁物资信用事件冲击，债市出现明显调整，5月份市场震荡上涨，6月份由于经济增长预期下修、英国脱欧引发市场避险情绪以及营改增免税同业往来范围扩大等利好刺激，债券市场再次上涨。

本基金在报告期内，总体以债券仓位为主，以稳健风格进行投资，同时根据对股市判断严格控制权益仓位进行投资，充分把握和参与权益市场的机会，为客户创造了

较高的稳健收益。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2016年6月30日，本基金份额净值为1.0267元，本报告期份额净值增长率1.77%，同期业绩比较基准增长率2.01%。

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2016年下半年，基本面方面，我们认为3季度经济增长将整体平稳，但后续由于房地产投资回落经济下行压力将逐渐加大，通胀水平由于基数影响将呈现前低后高的特点。政策面方面，基建投资将延续前期趋势，维持较高增速以托底经济，货币政策维持稳健，未来虽然仍有降准空间，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锚的作用，资金利率难以出现下行，制约债券市场收益率进一步下行。综合以上因素，债券市场收益率未来将呈现区间波动的态势。

投资策略上，本基金将继续以债券仓位为主，采取短久期和中低杠杆水平运作，同时适当精选个股参与二级市场的机会，继续为客户贡献稳健正收益。

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，对基金管理人在本基金的投资运作、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 托管人对本半年度报告中财务信息等内容真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本半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 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：天弘鑫安宝保本混合型证券投资基金

报告截止日：2016年6月30日

单位：人民币元

资 产	本期末 2016年6月30日	上年度末 2015年12月31日
资 产:		
银行存款	2,273,354.11	3,937,673.39
结算备付金	—	503,491.52
存出保证金	26,005.75	24,700.52
交易性金融资产	663,613,904.18	448,070,856.72
其中：股票投资	23,081,855.48	56,381,549.52
基金投资	—	—
债券投资	640,532,048.70	391,689,307.20
资产支持证券投资	—	—
贵金属投资	—	—
衍生金融资产	—	—
买入返售金融资产	51,272,000.00	289,966,634.95
应收证券清算款	31,160,779.07	—
应收利息	12,176,522.59	4,089,074.77
应收股利	—	—
应收申购款	—	—
递延所得税资产	—	—
其他资产	—	—
资产总计	760,522,565.70	746,592,431.87
负债和所有者权益	本期末 2016年6月30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	—	—
卖出回购金融资产款	—	—
应付证券清算款	734,644.25	—
应付赎回款	—	—
应付管理人报酬	309,140.44	314,896.62

应付托管费	61,828.09	62,979.31
应付销售服务费	123,656.17	125,958.61
应付交易费用	37,336.95	101,220.78
应交税费	—	—
应付利息	—	—
应付利润	—	—
递延所得税负债	—	—
其他负债	188,013.38	91,500.00
负债合计	1,454,619.28	696,555.32
所有者权益：		
实收基金	739,354,674.96	739,354,674.96
未分配利润	19,713,271.46	6,541,201.59
所有者权益合计	759,067,946.42	745,895,876.55
负债和所有者权益总计	760,522,565.70	746,592,431.87

注：1. 报告截止日2016年6月30日，基金份额净值1.0267元，基金份额总额739,354,674.96份。

2. 本基金合同生效日为2015年10月23日，无上一年度可比期间(下同)。

6.2 利润表

会计主体：天弘鑫安宝保本混合型证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年6月30日

单位：人民币元

项 目	本期
	2016年1月1日至2016年6月30日
一、收入	16,552,551.55
1. 利息收入	13,438,381.44
其中：存款利息收入	121,486.07
债券利息收入	13,157,619.17
资产支持证券利息收入	—
买入返售金融资产收入	159,276.20
其他利息收入	—

2. 投资收益（损失以“-”填列）	4,011,022.87
其中：股票投资收益	1,610,592.80
基金投资收益	—
债券投资收益	1,787,688.57
资产支持证券投资收益	—
贵金属投资收益	—
衍生工具收益	—
股利收益	612,741.50
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	-896,852.76
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	—
减：二、费用	3,380,481.68
1. 管理人报酬	1,859,338.62
2. 托管费	371,867.76
3. 销售服务费	743,735.46
4. 交易费用	164,947.88
5. 利息支出	24,533.74
其中：卖出回购金融资产支出	24,533.74
6. 其他费用	216,058.22
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）	13,172,069.87
减：所得税费用	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）	13,172,069.87

6.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：天弘鑫安宝保本混合型证券投资基金

本报告期：2016年1月1日至2016年6月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2016年1月1日至2016年6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)	739,354,674.96	6,541,201.59	745,895,876.55
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	13,172,069.87	13,172,069.87
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)	—	—	—
其中：1. 基金申购款	—	—	—
2. 基金赎回款	—	—	—
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)	739,354,674.96	19,713,271.46	759,067,946.42

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

天弘鑫安宝保本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[2015]1102号《关于核准天弘天弘鑫安宝保本混合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《天弘鑫安宝保本混合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，首次募集期间为自2015年10月15日至2015年10月21日，首次设立募集不包括认购资金利息共募集739,321,900.00元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2015)第988号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《天弘鑫安宝保本混合型证券投资基金基金合同》于2015年10月23日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为739,354,674.96份基金份额，其中利息折份额为32,774.96份，归入基金资产。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《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘鑫安宝保本混合型证券投资基金基金合同》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(包括中小板、创业板及其他经中国证监会核准上市的股票)、债券、货币市场工具、债券回购、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，但须符合中国证监会相关规定。基金的投资组合比例为：：风险资产占基金资产净值的比例不高于40%，其中基金持有的全部权证的市值不超过基金资产净值的3%；安全资产占基金资产净值的比例不低于60%。在开放期，本基金持有现金或投资于到期日在一年以内的政府债券的比例合计不低于基金资产净值的5%，在保本周期内(保本周期到期日除外)，本基金不受该比例的限制。本基金的业绩比较基准：(一年期银行定期存款利率(税后)+0.5%)×2。

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颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《天弘鑫安宝保本混合型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发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2016年1月1日至2016年6月30日止期间的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6月30日的财务状况以及2016年1月1日至2016年6月30日止期间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 会计差错更正的说明

本基金本报告期无重大会计差错的内容和更正金额。

6.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、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补充政策的通知》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
兴业银行股份有限公司(“兴业银行”)	基金托管人

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

本基金本期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

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的管理费	1,859,338.62
其中：支付销售机构的客户维护费	12,771.80

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0.50%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 X 0.50% / 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。

6.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年1月1日至2016年6月30日
当期发生的基金应支付的托管费	371,867.76

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0.10%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 0.10% / 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 2016年1月1日至2016年6月30日	
	当期发生的基金应支付的销售服务费	
天弘基金管理有限公司	729,080.88	
合计	729,080.88	

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

本报告期末与关联方进行过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

本报告期无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

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

本报告期无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

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 2016年1月1日至2016年6月30日	
	期末余额	当期利息收入
兴业银行活期存款	2,273,354.11	114,007.13

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。

6.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期末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

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

6.4.9 期末（2016年6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

金额单位：人民币元

6.4.12.1.1 受限证券类别：股票									
证券代码	证券名称	成功认购日	可流通日	流通受限类型	认购价格	期末估值单价	数量	期末成本总额	期末估值总额
002805	丰元股份	2016-06-29	2016-07-07	新股申购	5.8	5.8	971	5,631.8	5,631.8
300520	科大国创	2016-06-30	2016-07-08	新股申购	10.05	10.05	926	9,306.3	9,306.3
601966	玲珑轮胎	2016-06-24	2016-07-06	新股申购	12.98	12.98	6,246	81,073.08	81,073.08
603016	新宏泰	2016-06-23	2016-07-01	新股申购	8.49	8.49	1,602	13,600.98	13,600.98

6.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

金额单位：人民币元

股票代码	股票名称	停牌日期	停牌原因	期末估值单价	复牌日期	复牌开盘单价	数量	期末成本总额	期末估值总额
601611	中国核建	2016-06-30	股票交易异常波动	20.92	2016-07-01	23.01	20,168	69,982.96	421,914.56

注：本基金截至2016年6月30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。

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2016年6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2016年6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。

§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（元）	占基金总资产的比例（%）
1	权益投资	23,081,855.48	3.03
	其中：股票	23,081,855.48	3.03
2	固定收益投资	640,532,048.70	84.22
	其中：债券	640,532,048.70	84.22
	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	51,272,000.00	6.74
	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	2,273,354.11	0.30
7	其他各项资产	43,363,307.41	5.70
8	合计	760,522,565.70	100.00

7.2 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	—	—
B	采矿业	1,038,400.00	0.14
C	制造业	5,465,922.42	0.72
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	9,866,400.00	1.30
E	建筑业	421,914.56	0.06
F	批发和零售业	—	—
G	交通运输、仓储和邮政业	3,061,600.00	0.40
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	70,492.40	0.01
J	金融业	1,653,000.00	0.22
K	房地产业	972,000.00	0.13

L	租赁和商务服务业	—	—
M	科学研究和技术服务业	20,126.10	—
N	水利、环境和公共设施管理业	512,000.00	0.07
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	—	—
S	综合	—	—
	合计	23,081,855.48	3.04

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

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(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600900	长江电力	550,000	6,869,500.00	0.90
2	000709	河钢股份	1,090,000	3,019,300.00	0.40
3	601006	大秦铁路	320,000	2,060,800.00	0.27
4	000539	粤电力A	400,000	2,008,000.00	0.26
5	000001	平安银行	190,000	1,653,000.00	0.22
6	600028	中国石化	220,000	1,038,400.00	0.14
7	600377	宁沪高速	120,000	1,000,800.00	0.13
8	000726	鲁泰A	90,000	999,900.00	0.13
9	000027	深圳能源	155,000	988,900.00	0.13
10	000402	金融街	100,000	972,000.00	0.13

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半年度报告正文。

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	600900	长江电力	6,719,324.00	0.90

2	002103	广博股份	4,190,475.00	0.56
3	600660	福耀玻璃	3,997,804.92	0.54
4	000709	河钢股份	2,986,300.00	0.40
5	000539	粤电力 A	2,076,000.00	0.28
6	601006	大秦铁路	2,028,800.00	0.27
7	000001	平安银行	1,642,600.00	0.22
8	000726	鲁 泰 A	1,027,650.00	0.14
9	600028	中国石化	1,014,200.00	0.14
10	000027	深圳能源	1,013,700.00	0.14
11	000625	长安汽车	989,859.00	0.13
12	600377	宁沪高速	974,400.00	0.13
13	000402	金 融 街	950,000.00	0.13
14	000069	华侨城 A	514,400.00	0.07
15	603377	东方时尚	113,750.40	0.02
16	601900	南方传媒	112,559.06	0.02
17	002797	第一创业	95,440.80	0.01
18	002791	坚朗五金	85,697.61	0.01
19	601966	玲珑轮胎	81,073.08	0.01
20	603608	天创时尚	78,341.20	0.01

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	本期累计卖出金额	占期初基金资产净值比例(%)
1	000858	五 粮 液	11,013,020.22	1.48
2	600660	福耀玻璃	10,844,981.66	1.45
3	002444	巨星科技	9,230,808.88	1.24
4	300017	网宿科技	8,546,362.80	1.15
5	300178	腾邦国际	6,645,458.10	0.89
6	600681	万鸿集团	5,916,182.26	0.79
7	002103	广博股份	3,736,578.00	0.50

8	002781	奇信股份	1,302,311.00	0.17
9	300496	中科创达	1,276,737.00	0.17
10	300494	N盛天	598,845.80	0.08
11	601900	南方传媒	404,341.62	0.05
12	002787	N华源	379,403.68	0.05
13	603377	东方时尚	359,774.56	0.05
14	002785	万里石	322,440.00	0.04
15	300516	久之洋	262,930.50	0.04
16	002792	通宇通讯	239,917.47	0.03
17	002797	第一创业	217,791.60	0.03
18	002788	鹭燕医药	216,556.56	0.03
19	603528	多伦科技	214,074.48	0.03
20	002791	坚朗五金	211,964.24	0.03

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

单位：人民币元

买入股票的成本（成交）总额	31,778,731.96
卖出股票的收入（成交）总额	64,705,852.67

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	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	314,892,600.00	41.48
5	企业短期融资券	310,905,000.00	40.96

6	中期票据	10,224,000.00	1.35
7	可转债	4,510,448.70	0.59
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	640,532,048.70	84.38

注：可转债项下包含可交换债1,879,274.80元。

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	136016	15赛轮债	600,000	60,306,000.00	7.94
2	011598147	15新希望 SCP002	600,000	60,168,000.00	7.93
3	136003	15如意债	600,000	60,162,000.00	7.93
4	041554051	15沪城建CP002	500,000	50,315,000.00	6.63
5	011699266	16建发集 SCP001	500,000	50,090,000.00	6.60

7.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有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 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。

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	26,005.75
2	应收证券清算款	31,160,779.07
3	应收股利	—
4	应收利息	12,176,522.59
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	43,363,307.41

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

本基金本报告期末前十名股票不存在流通受限情况。

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

持有人户数	户均持有的基	持有人结构
-------	--------	-------

(户)	金份额	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
35,291	20,950.23	30,000,600.00	4.06%	709,354,074.96	95.94%

8.2 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	236,113.57	0.03%

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	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	0~10
本基金基金经理持有本开放式基金	0

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2015年10月23日)基金份额总额	739,354,674.96
本报告期期初基金份额总额	739,354,674.96
本报告期基金总申购份额	—
减：本报告期基金总赎回份额	—
本报告期基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	739,354,674.96

注：本基金保本周期内采取封闭式运作，期间不开放申购、赎回业务。自基金合同生效日（2015年10月23日）至本报告期末，本基金处于封闭期。

§ 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，宁辰先生已离任本公司副总经理职务，敬请投资者关注本公司于2016年4月30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改变。

10.6 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。

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		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占当期股票成交总额比例	佣金	占当期佣金总量的比例	
渤海证券	1	5,586,685.65	5.89%	5,202.91	5.89%	—
光大证券	1	1,147,612.63	1.21%	1,068.76	1.21%	—
民生证券	1	3,092,303.1	3.26%	2,879.92	3.26%	—
招商证券	2	61,322,188.56	64.66%	57,109.31	64.66%	—
中银国际	1	23,682,5	24.97%	22,055.27	24.97%	—

		75.65				
--	--	-------	--	--	--	--

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等；

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：无。

4、本基金报告期内停止租用交易单元：无。

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		债券回购交易		权证交易	
	成交金额	占当期债券成交总额比例	成交金额	占当期债券回购成交总额比例	成交金额	占当期权证成交总额比例
渤海证券	—	—	51,272,000	12.56%	—	—
光大证券	112,205,373	60.99%	130,100,000	31.88%	—	—
民生证券	—	—	—	—	—	—
招商证券	21,072,600	11.45%	40,900,000	10.02%	—	—
中银国际	50,700,448	27.56%	185,800,000	45.53%	—	—

天弘基金管理有限公司

二〇一六年八月二十九日