

天弘普惠养老保本混合型证券投资基金2016年年度报告

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：平安银行股份有限公司

送出日期：2017年03月30日

§ 1 重要提示及目录

1.1 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。

基金托管人平安银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016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。

本基金第一个保本周期到期日为2016年11月28日。本基金出现《基金合同》终止事由，因此本基金第一个保本周期到期，基金管理人依法对基金财产进行清算。

本报告期自2016年1月1日起至2016年12月31日止。

1.2 目录

§1 重要提示及目录	2
1.1 重要提示	2
1.2 目录	3
§2 基金简介	5
2.1 基金基本情况	5
2.2 基金产品说明	5
2.3 基金管理人和基金托管人	6
2.4 信息披露方式	6
2.5 其他相关资料	6
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	7
3.1 主要会计数据和财务指标	7
3.2 基金净值表现	8
§4 管理人报告	11
4.1 基金管理人及基金经理情况	11
4.2 管理人对报告期内本基金运作合规守信情况的说明	13
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明	13
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明	14
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望	15
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况	15
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明	17
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明	17
§5 托管人报告	17
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	18
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	18
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	18
§6 审计报告	18
6.1 审计报告基本信息	18
6.2 审计报告的基本内容	18
§7 年度财务报表	19
7.1 资产负债表	19
7.2 利润表	21
7.3 所有者权益（基金净值）变动表	23
7.4 报表附注	24
§8 投资组合报告	41
8.1 期末基金资产组合情况	41
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细	42
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动	42
8.5 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	44
8.6 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	44
8.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细	44
8.8 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	44
8.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明	44
8.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明	44
8.11 投资组合报告附注	44
§9 基金份额持有人信息	45
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	45
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	46
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	46
§10 开放式基金份额变动	46
§11 重大事件揭示	46

11.1	基金份额持有人大会决议.....	46
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.....	47
11.3	涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	47
11.4	基金投资策略的改变.....	47
11.5	为基金进行审计的会计师事务所情况.....	47
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.....	47
11.7	基金租用证券公司交易单元的有关情况.....	47
11.8	其他重大事件.....	48
§12	影响投资者决策的其他重要信息.....	50
§13	备查文件目录.....	50
13.1	备查文件目录.....	50
13.2	存放地点.....	50
13.3	查阅方式.....	50

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	天弘普惠养老保本混合型证券投资基金	
基金简称	天弘普惠养老保本混合	
基金主代码	001292	
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05月27日	
基金管理人	天弘基金管理有限公司	
基金托管人	平安银行股份有限公司	
报告期末基金份额总额	1,041,159.25份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	天弘普惠养老保本混合A	天弘普惠养老保本混合B
下属分级基金的交易代码	001292	001293
报告期末下属分级基金的份 额总额	一份	1,041,159.25份

2.2 基金产品说明

投资目标	在严格控制风险的前提下，本基金通过股票与债券等资产的合理配置，综合运用投资组合保险策略，力求为基金份额持有人获取超过业绩比较基准的收益。
投资策略	本基金将采用恒定比例组合保本策略（CPPI, Constant Proportion Portfolio Insurance），对资产配置建立和运用数量化的分析模型，动态地监控和调整本基金在安全资产与风险资产上的投资比例，确保投资者的投资本金的安全性。同时，本基金通过积极稳健的选择市场时机和精选个股进行投资，争取为基金资产获取更高的投资回报。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	$(\text{一年期银行定期存款利率（税后）} + 0.50\%) \times 2$
风险收益特征	本基金为保本混合型基金，属于证券投资基金中的中低风险品种，其预期风险和预期收益低于股票型基金

	和非保本的混合型基金，高于货币市场基金和债券型基金。投资者投资于保本基金并不等于将资金作为存款放在银行或存款类金融机构，保本基金在极端情况下仍然存在本金损失的风险。
--	--

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	平安银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	童建林	方琦
	联系电话	022-83310208	0755-22160168
	电子邮箱	service@thfund.com.cn	FANGQI275@pingan.com.cn
客户服务电话		4007109999	95511-3
传真		022-83865569	0755-82080387
注册地址		天津自贸区(中心商务区)响螺湾旷世国际大厦A座1704-241号	广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号
办公地址		天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层	广东省深圳市罗湖区深南东路 5047 号
邮政编码		300203	518001
法定代表人		井贤栋	谢永林

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金年度报告正文的基金管理人互联网网址	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

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特	中国上海市湖滨路202号普华永

	殊普通合伙)	道中心11楼
注册登记机构	天弘基金管理有限公司	天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层
基金保证人	重庆三峡担保集团股份有限公司	重庆市渝北区青枫北路12号3幢

§ 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	天弘普惠养老保本混合A	
	2016年	2015年05月27日-2015年12月31日
本期已实现收益	36,892,396.32	4,668,521.57
本期利润	26,135,674.83	15,425,063.90
加权平均基金份额本期利润	0.0660	0.0351
本期加权平均净值利润率	6.22%	3.50%
本期基金份额净值增长率	5.76%	3.51%
3.1.2 期末数据和指标	2016年末	2015年末
期末可供分配利润	—	4,668,521.57
期末可供分配基金份额利润	—	0.0106
期末基金资产净值	—	454,484,893.43
期末基金份额净值	—	1.0351
3.1.3 累计期末指标	2016年末	2015年末
基金份额累计净值增长率	9.47%	3.51%

3.1.4 期间数据和指标	天弘普惠养老保本混合B	
	2016年	2015年05月27日-2015年12月31日
本期已实现收益	544,052.08	62,131.96
本期利润	387,815.71	218,547.49
加权平均基金份额本期利润	0.0661	0.0342
本期加权平均净值利润率	6.24%	3.41%

本期基金份额净值增长率	5.61%	3.42%
3.1.5 期末数据和指标	2016年末	2015年末
期末可供分配利润	94,994.94	62,131.96
期末可供分配基金份额利润	0.0912	0.0097
期末基金资产净值	1,136,183.39	6,607,847.91
期末基金份额净值	1.0913	1.0342
3.1.6 累计期末指标	2016年末	2015年末
基金份额累计净值增长率	9.22%	3.42%

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05月27日起生效。本基金第一个保本周期到期日为2016年11月28日，由于出现《基金合同》终止事由，因此第一个保本周期到期，基金管理人依法对基金财产进行清算。（下同）

5、净值增长率统计期间截止至2016年11月28日。

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

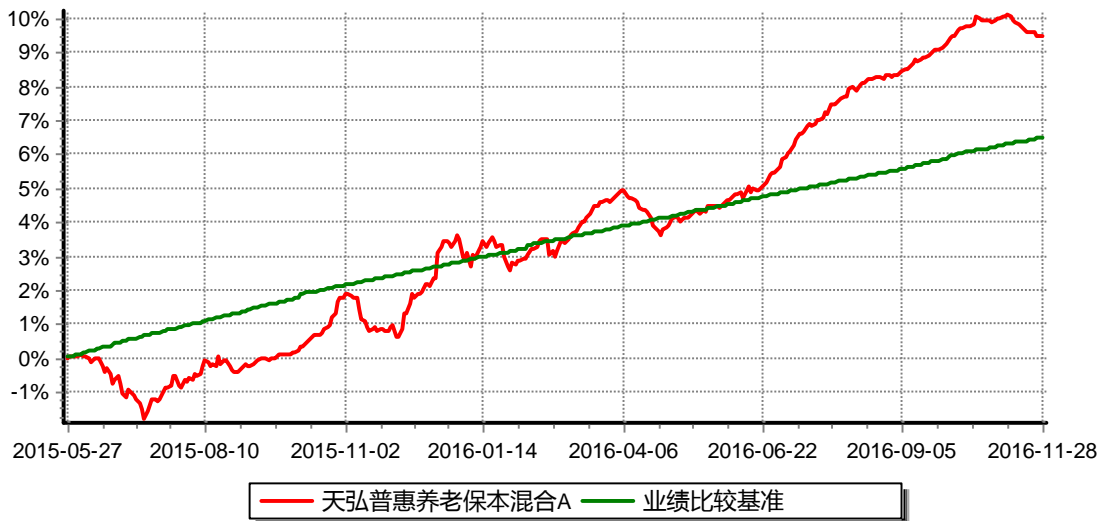
阶段 (天弘普惠养老保本混合A)	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.22%	0.07%	0.62%	0.02%	-0.40%	0.05%
过去六个月	3.72%	0.07%	1.60%	0.01%	2.12%	0.06%
过去一年	5.76%	0.11%	3.60%	0.01%	2.16%	0.10%
自基金合同生效日起至基金最后运作日 (2015年05月27日-2016年11月28日)	9.47%	0.13%	6.51%	0.01%	2.96%	0.12%

阶段	份额净	份额净	业绩比	业绩比	①-③	②-④
----	-----	-----	-----	-----	-----	-----

(天弘普惠养老保本混合B)	值增长率①	值增长率标准差②	较基准收益率③	较基准收益率标准差④		
过去三个月	0.19%	0.07%	0.62%	0.02%	-0.43%	0.05%
过去六个月	3.66%	0.07%	1.60%	0.01%	2.06%	0.06%
过去一年	5.61%	0.11%	3.60%	0.01%	2.01%	0.10%
自基金合同生效日起至基金最后运作日 (2015年05月27日-2016年11月28日)	9.22%	0.13%	6.51%	0.01%	2.71%	0.12%

注：天弘普惠养老保本混合基金业绩比较基准：（一年期银行定期存款利率（税后）+0.50%）×2。

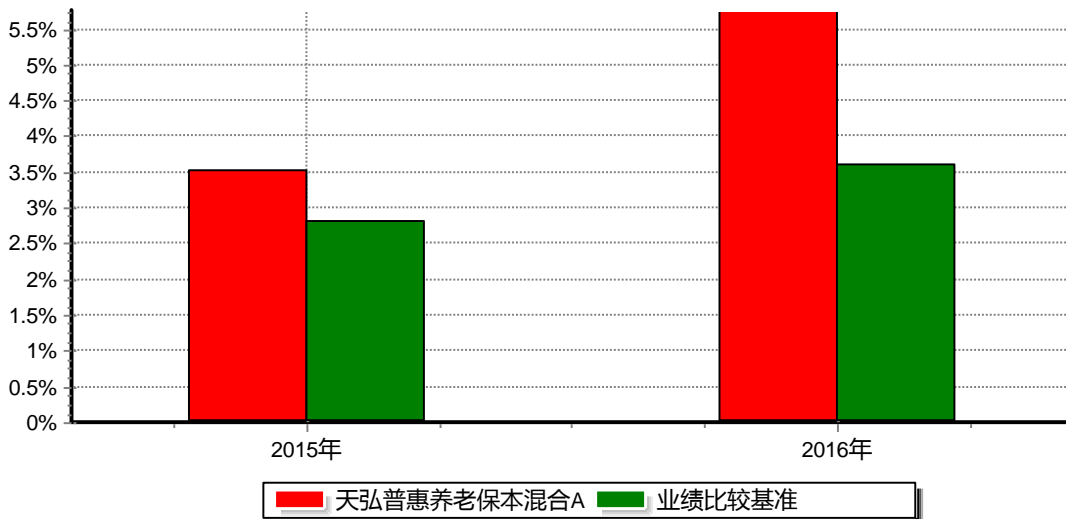
3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

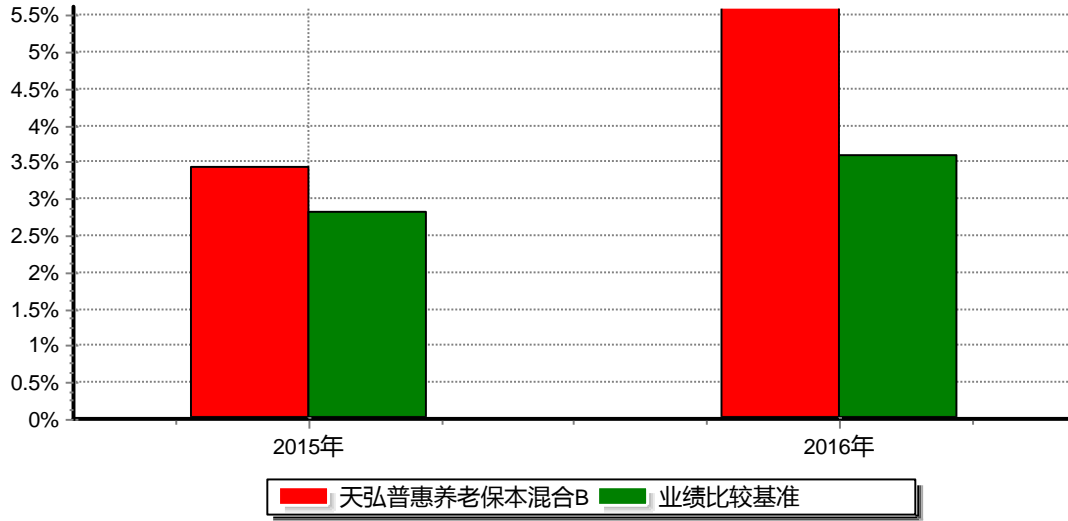




- 注：1、本基金《基金合同》于2015年05月27日生效。
 2、本报告期内，本基金的各项投资比例达到基金合同约定的各项比例要求。
 3、本表统计期间为2015年05月27日至2016年11月28日。（下同）

3.2.3 自基金合同生效以来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2015年5月27日生效。基金合同生效当年2015年的净值增长率按照基金合同生效后当年的实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 过去三年基金的利润分配情况

本基金于2015年5月27日成立。本基金自基金合同生效以来无利润分配情况，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		
陈钢	本基金基金经理	2015年05月	—	14年	男，工商管理硕士。历任华龙证券公司固定收益部

	理；本公司副总经理、固定收益总监兼固定收益部总经理。				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05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。

4.3.3 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说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2016年，经济基本面呈现企稳改善态势，前期货币宽松累积效应显现，名义GDP增速触底回升，通缩改善带动企业收入及利润改善，下游地产汽车也成为需求亮点。通胀方面，CPI整体平稳，但是PPI方面由于基数效应及大宗商品表现强势，同比增速出现快速反弹。政策面方面，货币政策真正转向稳健中性。全年央行仅于2月末降准一次，主要通过OMO和MLF相结合的方式提供基础货币。资金面方面，前三季度资金中枢在波动中维持稳定，但四季度资金利率中枢快速上行，波动明显加大。央行通过拉长提供资金期限以抬升资金成本中枢，同时央行对资金利率波动率容忍程度也明显提高，因此导致四季度资金利率波动率和中枢均较前三季度明显上升。债市方面，前三季度整体震荡中上涨，市场在乐观心态中消灭各种利差，进入四季度，多种因素之下，市场出现快速巨幅调整。

本基金在报告期内，前半段为应对产品第一个运作周期到期，逐步降低仓位，增强组合流动性，此后由于产品决定终止，按照要求进行产品清盘操作。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2016年11月28日，普惠养老保本混合A基金份额净值为1.0947元，普惠养老保本混合B基金份额净值为1.0922元。报告期内份额净值增长率普惠养老保本混合A为5.76%，普惠养老保本混合B为5.61%，同期业绩比较基准增长率为3.60%。

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，基本面大概率呈现前高后低，我们认为未来经济仍然面临下行压力，一方面前期货币宽松效应趋于消散，货币政策边际趋于紧缩将导致未来经济面临下行压力，另一方面，下游需求地产和汽车都面临需求透支的问题，形成对经济周期的下拉压力，未来需要持续观察基本面信号等待下行拐点。资金面方面，脉冲式收紧仍将出现，资金利率中枢趋势性抬升，资金利率波动性加大。政策面方面，货币政策边际趋紧，以配合防范金融风险 and 抑制资产泡沫。

对于债券市场未来的看法，我们认为在基本面向下拐点出现之前，债券市场将维持区间波动的态势，票息收益仍然是债券市场最具有确定性的收益来源。未来收益率有一定的下行空间，但是由于政策边际紧缩以及债市交易结构的不稳定性，未来债市仍将面临一定的波动，整体走势可能是前高后低。

投资策略上，由于产品合同终止，因此未来将持续配合产品终止工作。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

报告期内，本基金管理人的监察稽核工作一切从合规运作、防范和控制风险、保障基金份额持有人利益出发，由独立的监察稽核部门按照规定的权限和程序，认真履行职责，对公司、基金运作及员工行为的合法性、合规性进行定期和不定期监督和检查。发

现问题及时提出建议并督促相关部门改进完善，及时与有关人员沟通，并定期制作监察稽核报告报公司董事会。公司经理层面成立了风险管理委员会，根据公司总体风险控制目标，分配各业务和各环节风险控制目标和要求；落实公司重大风险管理的决定或决议；听取并讨论会议成员的报告；对会议成员提出的或发现的已经存在的风险点，在充分讨论、协调基础上形成具体的风险控制措施；对潜在风险点分析讨论，拟定应对措施；对发生的风险事件和重大差错，分析原因、总结经验教训、风险定级、划分责任，向总经理办公会报告。同时，本基金管理人根据全面性原则、独立性原则、相互制约原则、定性和定量相结合原则、重要性原则建立了一套比较完整的内部控制体系，该内部控制体系由一系列业务管理制度及相应的业务处理、控制程序组成，具体包括控制环境、风险评估、控制活动、信息和沟通、监控等要素。本基金管理人已通过了ISAE3402（《国际鉴证业务准则第3402号》）认证，获得无保留意见的控制设计适当性报告。本报告期，本基金管理人全面开展基金运作监察稽核工作，确保基金投资、营销及后台运作等各环节的合法合规。通过定期检查、不定期抽查等工作方法，完善内部控制，基金运作没有出现违规行为。本报告期内，本基金管理人有关本基金的监察稽核主要工作如下：

1、在研究环节，加强研究业务独立性，注重程序合规和质量控制；在关注研究报告形式与内容的合法性基础上，跟踪检查投资备选库的入选、维护依据；进一步规范新股、新债询价、申购流程；定期检查关联方关系以及关联交易的日常维护；定期评估研究对投资的支持程度，对投资业绩的贡献度；

2、在投资交易环节，对投资运作过程中的风险点进行识别和监控，预防和控制由内部或外部流程、人员和系统失控而造成的损失；根据法律法规要求、基金合同约定、投资决策委员会的决定，适时提出增加或优化交易系统风控指标的建议，通过投资交易系统控制投资风险；跟踪每日的交易行为和交易结果，发现预警信息通过电话、邮件及合规提示及时提醒，保障投资环节的合规运作；监督检查风险管理部参与各投资组合新股申购、一级债申购、银行间交易等场外交易，保证各投资组合场外交易的事中合规控制；

3、投资管理人员管理环节，加强对投资管理人员即时聊天工具、办公电话、移动电话、终端设备网上交易的合规监控，监督投资管理人员直系亲属账户及股票交易申报制度、交易时间移动电话集中保管制度的有效执行，采取各种有效方式杜绝老鼠仓、不公平交易及各种形式的利益输送行为；

4、基金募集与营销环节，对基金宣传推介材料及定投、费率优惠等基金销售业务活动进行事前合规检查，做到事前防范风险，保障基金营销合法合规。在基金利用互联网平台营销方面，对各类新兴业务的活动方案进行事前合规评估，保证业务开展的同时注重事前风险防范；

5、基金运营环节，加强对注册登记、会计核算、基金清算、估值业务的稽核力度，保证基金运营安全、准确；

6、信息披露环节，严格按照信息披露管理办法的规定，认真做好本基金的信息披露工作，保证信息披露的真实、准确、完整、及时。

报告期内，本基金整体运作合法合规，内部控制和风险防范措施逐步完善，保障了基金份额持有人的利益。本基金管理人将继续从合规运作、防范和控制风险、保障基金份额持有人利益出发，提高内部控制和风险管理的科学性和有效性，切实保障基金安全、合规运作。

4.7 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银行和会计师事务所。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。

4.8 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。

4.9 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，平安银行股份有限公司（以下称“本托管人”）在天弘普惠养老保本混合型证券投资基金（以下称“本基金”）的托管过程中，严格遵守《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有关规定，不存在损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了应尽的义务。

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，本托管人根据《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，对本基金的投资运作进行了必要的监督，对基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算以及基金费用开支等方面进行了认真地复核，未发现本基金管理人存在损害基金份额持有人利益的行为。该基金本报告期内未进行利润分配。

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

本报告期内，由天弘基金管理有限公司编制本托管人复核的本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容真实、准确、完整。

§ 6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2016)第1999号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	天弘基金管理有限公司
引言段	我们审计了后附的天弘普惠养老保本混合型证券投资基金(以下简称“天弘普惠养老保本混合基金”)的财务报表，包括2016年11月28日(基金最后运作日)的资产负债表，2016年1月1日至2016年11月28日(基金最后运作日)止期间的利润表、所有者权益(基金净值)变动表和财务报表附注(以下简称“财务报表”)。
管理层对财务报表的责任段	贵公司管理层负责编制财务报表，并负责设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由

	于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	<p>我们的责任是在实施审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。</p> <p>审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。</p> <p>我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。</p>
审计意见段	<p>我们认为，上述天弘普惠养老保本混合基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中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，公允反映了天弘普惠养老保本混合基金2016年11月28日(基金最后运作日)的财务状况以及2016年1月1日至2016年11月28日(基金最后运作日)止期间的经营成果和基金净值变动情况。</p>
注册会计师的姓名	薛竞 周祎
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
会计师事务所的地址	中国上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
审计报告日期	2016-12-23

§ 7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：天弘普惠养老保本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	1,441,517.62	991,404.47
结算备付金		38,640.19	6,058,191.73
存出保证金		—	76,732.01
交易性金融资产	7.4.7.2	—	668,777,471.96
其中：股票投资		—	31,637,541.76
基金投资		—	—
债券投资		—	637,139,930.20
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		—	—
应收利息	7.4.7.5	336.27	12,093,289.07
应收股利		—	—
应收申购款		—	—
递延所得税资产		—	—
其他资产	7.4.7.6	—	—
资产总计		1,480,494.08	687,997,089.24
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		—	225,599,357.00

应付证券清算款		—	611,961.56
应付赎回款		—	—
应付管理人报酬		—	270,954.51
应付托管费		—	38,707.78
应付销售服务费		—	39,539.90
应付交易费用	7.4.7.7	1,425.00	94,386.83
应交税费		—	—
应付利息		—	30,440.32
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	7.4.7.8	342,885.69	219,000.00
负债合计		344,310.69	226,904,347.90
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	1,041,159.25	445,449,129.95
未分配利润	7.4.7.10	95,024.14	15,643,611.39
所有者权益合计		1,136,183.39	461,092,741.34
负债和所有者权益总计		1,480,494.08	687,997,089.24

注：1. 报告截止日2016年12月31日，本基金A类无份额余额，本基金B类基金份额净值1.0913元，B类基金份额1,041,159.25份。

2. 本财务报表的比较期间为2015年5月27日(基金合同生效日)至2015年12月31日。

7.2 利润表

会计主体：天弘普惠养老保本混合型证券投资基金

本报告期：2016年01月01日至2016年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016年01月01日至 2016年12月31日	上年度可比期间 2015年05月27日至 2015年12月31日
一、收入		32,483,671.56	19,615,499.43
1. 利息收入		25,289,301.11	13,546,278.92
其中：存款利息收入	7.4.7.11	126,791.79	1,070,899.05
债券利息收入		25,159,946.89	12,457,796.26

资产支持证券利息收入		—	—
买入返售金融资产收入		2,562.43	17,583.61
其他利息收入		—	—
2. 投资收益（损失以“-”填列）		18,107,328.31	-4,843,737.35
其中：股票投资收益	7.4.7.12	6,550,320.72	-6,928,232.58
基金投资收益		—	—
债券投资收益	7.4.7.13	10,947,825.71	2,081,134.18
资产支持证券投资收益		—	—
贵金属投资收益	7.4.7.14	—	—
衍生工具收益	7.4.7.15	—	—
股利收益	7.4.7.16	609,181.88	3,361.05
3. 公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	-10,912,957.86	10,912,957.86
4. 汇兑收益（损失以“-”号填列）		—	—
5. 其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.18	—	—
减：二、费用		5,960,181.02	3,971,888.04
1. 管理人报酬		3,008,400.69	1,868,545.40
2. 托管费		429,771.52	266,935.09
3. 销售服务费		439,003.76	272,675.68
4. 交易费用	7.4.7.19	155,761.65	149,701.16
5. 利息支出		1,553,157.71	1,183,930.71
其中：卖出回购金融资产支出		1,553,157.71	1,183,930.71
6. 其他费用	7.4.7.20	374,085.69	230,100.00
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		26,523,490.54	15,643,611.39
减：所得税费用		—	—

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		26,523,490.54	15,643,611.39
-------------------	--	---------------	---------------

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：天弘普惠养老保本混合型证券投资基金

本报告期：2016年01月01日至2016年12月31日

单位：人民币元

项目	本期 2016年01月01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）	445,449,129.95	15,643,611.39	461,092,741.34
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	26,523,490.54	26,523,490.54
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）	-444,407,970.70	-42,072,077.79	-486,480,048.49
其中：1. 基金申购款	—	—	—
2. 基金赎回款	-444,407,970.70	-42,072,077.79	-486,480,048.49
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）	1,041,159.25	95,024.14	1,136,183.39
项目	上年度可比期间2015年05月27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）	445,449,129.95	—	445,449,129.95
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	15,643,611.39	15,643,611.39
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）	—	—	—

“-”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）	445,449,129.95	15,643,611.39	461,092,741.34

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

天弘普惠养老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]729号《关于准予天弘普惠养老保本混合型证券投资基金注册的批复》准予注册，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《天弘普惠养老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，存续期限为不定期，首次募集期间为2015年5月19日至2015年5月25日，首次设立募集不包括认购资金利息共募集445,434,592.00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570号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《天弘普惠养老保本混合型证券投资基金基金合同》于2015年5月27日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为445,449,129.95份基金份额，其中认购资金利息折合14,537.95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，基金托管人为平安银行股份有限公司。

根据《天弘普惠养老保本混合型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金根据销售方式及销售服务费率的不同，将基金份额分为A类基金份额和B类基金份额，其中，A类基金份额销售服务费年费率为0.10%，B类基金份额销售服务费年费率为0.25%。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘普惠养老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债券、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)、货币市场工具、权证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，但需符

合中国证监会的相关规定。本基金股票、权证等风险资产占基金资产的比例不高于 30%，其中投资于权证的比例不超过基金资产的 3%；债券、货币市场工具等安全资产占基金资产的比例不低于 70%。在开放期，本基金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%，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： $(\text{一年期银行定期存款利率(税后)} + 0.50\%) \times 2$ 。

根据《天弘普惠养老保本混合型证券投资基金基金合同》以及天弘基金管理有限公司于2016年11月24日发布的《天弘基金管理有限公司关于天弘普惠养老保本混合型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》，本基金第一个保本周期期满后，不再进行第二个保本周期的合作事宜，基金管理人也未能找到其他适合的担保机构，故本基金因未能符合保本基金存续条件，出现基金合同终止事由。本基金第一个保本周期的到期日（即最后开放日）为2016年11月28日且已触发基金合同终止事由，基金管理人已依据相关法律法规和本基金基金合同的规定，组织成立基金财产清算小组履行基金财产清算程序。

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》、《天弘普惠养老保本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。

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 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。本基金从2016年11月29日起进入清算期。

7.4.4.2 记账本位币

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的股票投资和债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1) 收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2) 该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3) 该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的股票投资和债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

- (1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。
- (2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。
- (3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1) 具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2) 交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

股票投资在持有期间应取得的现金股利扣除由上市公司代扣代缴的个人所得税后的净额确认为投资收益。债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其公允价值与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。本基金收益分配方式仅采取现金分红一种收益分配方式，不进行红利再投资。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。

经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金的基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别股票投资和债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

(1) 对于证券交易所上市的股票和债券，若出现重大事项停牌或交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)等情况，本基金根据中国证监会公告[2008]38号《关于进一步规范证券投资基金估值业务的指导意见》，根据具体情况采用《关于发布中基协(AMAC)基金行

业股票估值指数的通知》提供的指数收益法估值技术进行估值。

(2)在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行〈企业会计准则〉估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

(3)对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、可交换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期未发生会计估计变更。

7.4.5.3 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 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2016年12月31日	上年度末 2015年12月31日
活期存款	1,441,517.62	991,404.47
定期存款	—	—
其他存款	—	—
合计	1,441,517.62	991,404.47

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目	本期末2016年12月31日		
	成本	公允价值	公允价值变动
股票	—	—	—
贵金属投资-金交所黄金合约	—	—	—
债券	交易所市场	—	—
	银行间市场	—	—
	合计	—	—
资产支持证券	—	—	—
基金	—	—	—
其他	—	—	—

合计		—	—	—
项目		上年度末2015年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		32,196,038.67	31,637,541.76	-558,496.91
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—
债券	交易所市场	166,308,931.98	168,221,930.20	1,912,998.22
	银行间市场	459,359,543.45	468,918,000.00	9,558,456.55
	合计	625,668,475.43	637,139,930.20	11,471,454.77
资产支持证券		—	—	—
基金		—	—	—
其他		—	—	—
合计		657,864,514.10	668,777,471.96	10,912,957.86

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

本基金本报告期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末2016年12月31日	上年度末2015年12月31日
应收活期存款利息	317.13	519.59
应收定期存款利息	—	—
应收其他存款利息	—	—
应收结算备付金利息	19.14	2,998.82
应收债券利息	—	12,089,732.71
应收买入返售证券利息	—	—
应收申购款利息	—	—
应收黄金合约拆借孳息	—	—
其他	—	37.95

合计	336.27	12,093,289.07
----	--------	---------------

7.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末2016年12月31日	上年度末2015年12月31日
交易所市场应付交易费用	—	76,533.58
银行间市场应付交易费用	1,425.00	17,853.25
合计	1,425.00	94,386.83

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末2016年12月31日	上年度末2015年12月31日
应付券商交易单元保证金	—	—
应付赎回费	—	—
预提费用	342,885.69	219,000.00
合计	342,885.69	219,000.00

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目 (天弘普惠养老保本混合A)	本期2016年01月01日至2016年12月31日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	439,059,829.53	439,059,829.53
本期申购	—	—
本期赎回(以“-”号填列)	-439,059,829.53	-439,059,829.53
本期末	—	—
项目 (天弘普惠养老保本混合B)	基金份额(份)	账面金额
上年度末	6,389,300.42	6,389,300.42
本期申购	—	—

本期赎回（以“-”号填列）	-5,348,141.17	—
本期末	1,041,159.25	1,041,159.25

注：根据《天弘普惠养老保本混合型证券投资基金基金合同》及《天弘基金管理有限公司关于天弘普惠养老保本混合型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》的相关规定，本基金以定期开放的方式运作，即在基金保本周期内采取封闭式运作（保本周期到期日除外），期间不开放申购、赎回。本基金以每十八个月为一个保本周期，即第一个保本周期自基金合同生效日起至十八个月后的对应日止，此后各保本周期自本基金公告的该保本周期起始之日起至十八个月后对应日止；如对应日为非工作日或无该对应日，则顺延至下一个工作日。第一个保本周期自2015年5月27日起至2016年11月28日止，基金份额持有人可在2016年11月28日将第一个保本周期内持有到期的基金份额进行赎回（含转换转出）。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目 (天弘普惠养老保本混合A)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	4,668,521.57	10,756,542.33	15,425,063.90
本期利润	36,892,396.32	-10,756,721.49	26,135,674.83
本期基金份额交易产生的变动数	-41,560,917.89	179.16	-41,560,738.73
其中：基金申购款	—	—	—
基金赎回款	-41,560,917.89	179.16	-41,560,738.73
本期已分配利润	—	—	—
本期末	—	—	—

单位：人民币元

项目 (天弘普惠养老保本混合B)	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	62,131.96	156,415.53	218,547.49
本期利润	544,052.08	-156,236.37	387,815.71
本期基金份额交易产生的变动数	-511,189.10	-149.96	-511,339.06
其中：基金申购款	—	—	—

基金赎回款	-511,189.10	-149.96	-511,339.06
本期已分配利润	—	—	—
本期末	94,994.94	29.20	95,024.14

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年01月01日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年05月27日至2015年 12月31日
活期存款利息收入	93,631.21	201,789.99
定期存款利息收入	—	852,355.56
其他存款利息收入	—	—
结算备付金利息收入	32,526.69	16,351.35
其他	633.89	402.15
合计	126,791.79	1,070,899.05

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2016年01月01日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年05月27日至2015年 12月31日
股票投资收益——买卖股票 差价收入	6,550,320.72	-6,928,232.58
股票投资收益——赎回差价 收入	—	—
股票投资收益——申购差价 收入	—	—
合计	6,550,320.72	-6,928,232.58

7.4.7.12.2 股票投资收益——买卖股票差价收入

单位：人民币元

项目	本期2016年01月01日至 2016年12月31日	上年度可比期间 2015年05月27日至2015年 12月31日
卖出股票成交总额	62,907,865.60	33,293,936.22
减：卖出股票成本总额	56,357,544.88	40,222,168.80
买卖股票差价收入	6,550,320.72	-6,928,232.58

7.4.7.13 债券投资收益

7.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2016年01月01日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年05月27日至2015年 12月31日
债券投资收益——买卖债券 (、债转股及债券到期兑付) 差价收入	10,947,825.71	2,081,134.18
债券投资收益——赎回差价 收入	—	—
债券投资收益——申购差价 收入	—	—
合计	10,947,825.71	2,081,134.18

7.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2016年01月01日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年05月27日至2015年 12月31日
卖出债券(、债转股及债券到 期兑付)成交总额	746,471,147.30	266,946,858.83
减：卖出债券(、债转股及债 券到期兑付)成本总额	717,257,451.39	259,813,933.60
减：应收利息总额	18,265,870.20	5,051,791.05
买卖债券差价收入	10,947,825.71	2,081,134.18

7.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无资产支持证券投资收益。

7.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期及上年度可比期间未取得贵金属投资收益。

7.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内及上年度可比期间无衍生工具投资收益。

7.4.7.16 股利收益

单位：人民币元

项目	本期 2016年01月01日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年05月27日至2015年 12月31日
股票投资产生的股利收益	609,181.88	3,361.05
基金投资产生的股利收益	—	—
合计	609,181.88	3,361.05

7.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2016年01月01日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年05月27日至2015年 12月31日
1. 交易性金融资产	-10,912,957.86	10,912,957.86
——股票投资	558,496.91	-558,496.91
——债券投资	-11,471,454.77	11,471,454.77
——资产支持证券投资	—	—
——基金投资	—	—
——贵金属投资	—	—
——其他	—	—
2. 衍生工具	—	—
——权证投资	—	—

3. 其他	—	—
合计	-10,912,957.86	10,912,957.86

7.4.7.18 其他收入

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他收入。

7.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年01月01日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年05月27日至2015年 12月31日
交易所市场交易费用	150,586.65	142,876.16
银行间市场交易费用	5,175.00	6,825.00
合计	155,761.65	149,701.16

7.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2016年01月01日至2016年 12月31日	上年度可比期间 2015年05月27日至2015年 12月31日
审计费用	50,000.00	60,000.00
信息披露费	290,000.00	150,000.00
其他费用	1,200.00	5,100.00
帐户维护费	32,885.69	15,000.00
合计	374,085.69	230,100.00

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

财政部、国家税务总局于2016年12月21日颁布《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》(财税[2016]140号)，要求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，自2016年5月1日起执行。

根据财政部、国家税务总局于2017年1月6日颁布的《关于资管产品增值税政策有关问题的补充通知》(财税[2017]2号), 2017年7月1日(含)以后, 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, 按照现行规定缴纳增值税。对资管产品在2017年7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。资管产品运营过程中发生增值税应税行为的具体征收管理办法, 由国家税务总局另行制定。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。

根据《天弘基金管理有限公司关于天弘普惠养老保本混合型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》, 本基金基金财产清算后的全部剩余资产扣除基金财产清算费用、交纳所欠税款并清偿基金债务后, 按基金份额持有人持有的基金份额比例进行分配。

7.4.9 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、基金注册登记机构
平安银行股份有限公司(“平安银行”)	基金托管人
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”。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内及上年度可比期间无通过关联方交易单元进行的交易。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年01月01日至2016年12 月31日	上年度可比期间 2015年05月27日至2015年12 月31日
当期发生的基金应支 付的管理费	3,008,400.69	1,868,545.40
其中：支付销售机构的 客户维护费	—	—

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。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年01月01日至2016年12 月31日	上年度可比期间 2015年05月27日至2015年12 月31日
当期发生的基金应支 付的托管费	429,771.52	266,935.09

注：支付基金托管人平安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X0.10%/当年天数。

7.4.10.2.3 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01月01日至2016年12月31日

	天弘普惠养老保本混合A	天弘普惠养老保本混合B	合计
天弘基金管理有限公司	423,616.66	15,387.10	439,003.76
合计	423616.66	15387.1	439003.76
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间2015年05月27日至2015年12月31日		
	天弘普惠养老保本混合A	天弘普惠养老保本混合B	合计
天弘基金管理有限公司	263,108.01	9,567.67	272,675.68
合计	263108.01	9567.67	272675.68

注：基金支付基金销售机构的销售服务费按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管理有限公司，再由天弘基金管理有限公司计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日销售服务费=前一日基金资产净值X销售服务费率/当年天数。其中，A类基金份额销售服务费年费率为0.10%，B类基金份额销售服务费年费率为0.25%。

7.4.10.3 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的银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

本报告期及上年度可比期间无各关联方投资本基金的情况。

7.4.10.5 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01月01日至2016年12月31日		上年度可比期间 2015年05月27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
平安银行活期存款	1,441,517.62	93,631.21	991,404.47	396,192.77

- 注：1. 本基金的银行存款由基金托管人平安银行保管，按银行同业利率计息。
2. 上年度可比期间利息收入含存放于基金托管人平安银行的定期存款利息收入。

7.4.10.6 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的证券。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

本基金本报告期间未进行利润分配。

7.4.12 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本期末无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

本基金本报告期末无从事债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额。

7.4.13 金融工具风险及管理

于2016年12月31日，本基金资产为银行存款、结算备付金及应收利息，因此本基金资产无重大金融风险。

§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	—	—
	其中：股票	—	—
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	1,480,157.81	99.98
7	其他各项资产	336.27	0.02
8	合计	1,480,494.08	100.00

8.2 报告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。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

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	300017	网宿科技	7,175,099.00	1.56
2	600660	福耀玻璃	6,496,390.80	1.41
3	002103	广博股份	3,060,291.65	0.66
4	600900	长江电力	3,051,983.00	0.66
5	300322	硕贝德	2,486,691.00	0.54
6	600919	江苏银行	120,471.78	0.03
7	603608	天创时尚	78,341.20	0.02
8	002788	鹭燕医药	68,314.95	0.01
9	002792	通宇通讯	59,689.88	0.01
10	002797	第一创业	58,094.40	0.01
11	002791	坚朗五金	55,219.20	0.01
12	002790	瑞尔特	50,104.76	0.01
13	601966	玲珑轮胎	49,778.30	0.01

14	603868	飞科电器	48,662.97	0.01
15	300511	雪榕生物	48,307.04	0.01
16	601611	中国核建	43,739.35	0.01
17	002807	江阴银行	41,653.28	0.01
18	300512	中亚股份	39,164.43	0.01
19	601127	小康股份	38,845.66	0.01
20	600936	广西广电	38,414.40	0.01

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	000858	五粮液	11,803,943.47	2.56
2	600660	福耀玻璃	11,377,270.24	2.47
3	300017	网宿科技	8,624,791.62	1.87
4	603001	奥康国际	4,692,733.00	1.02
5	600681	万鸿集团	4,361,719.58	0.95
6	300178	腾邦国际	3,798,453.81	0.82
7	002103	广博股份	3,423,655.93	0.74
8	600900	长江电力	3,267,139.00	0.71
9	300322	硕贝德	2,343,530.00	0.51
10	300493	润欣科技	530,771.04	0.12
11	002780	三夫户外	391,190.20	0.08
12	601127	小康股份	294,518.30	0.06
13	601611	中国核建	290,041.05	0.06
14	300516	久之洋	257,775.00	0.06
15	300518	盛讯达	244,222.00	0.05
16	600919	江苏银行	224,803.80	0.05
17	002788	鹭燕医药	216,556.56	0.05
18	603528	多伦科技	214,074.48	0.05
19	603608	天创时尚	209,031.34	0.05

20	002792	通宇通讯	202,617.74	0.04
----	--------	------	------------	------

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

买入股票成本（成交）总额	22,270,455.45
卖出股票收入（成交）总额	62,907,865.60

注：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。

8.6 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。

8.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

8.8 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。

8.9 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。

8.10 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。

8.11 投资组合报告附注

8.11.1 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。

8.11.2 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。

8.11.3 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	—
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	336.27
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	336.27

8.11.4 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。

8.11.5 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。

8.11.6 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

份额 级别	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
天弘普 惠养老 保本混 合A	—	—	—	—	—	—

天弘普惠养老保本混合B	230	4,526.78	—	—	1,041,159.25	100.00%
合计	230	4,526.78	—	—	1,041,159.25	100.00%

9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

期末基金管理人的从业人员未持有本开放式基金。

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

	天弘普惠养老保本混合A	天弘普惠养老保本混合B
基金合同生效日(2015年05月27日)基金份额总额	439,059,829.53	6,389,300.42
本报告期期初基金份额总额	439,059,829.53	6,389,300.42
本报告期基金总申购份额	—	—
减：本报告期基金总赎回份额	439,059,829.53	5,348,141.17
本报告期基金拆分变动份额	—	—
本报告期期末基金份额总额	—	1,041,159.25

注：本基金第一个保本周期的到期日（即最后开放日）为2016年11月28日，A类基金份额持有人在此日已将第一个保本周期内持有到期的基金份额进行全部赎回（含转换转出）。本基金自2016年11月28日不再开放申购业务（含转换转入）。

§ 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。

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》。

2016年12月，谢永林先生担任平安银行股份有限公司董事、董事长。上述人事变动已按相关规定备案、公告。

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5万元整。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）已为天弘普惠养老保本混合型证券投资基金提供审计服务1年7个月。

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

本报告期内基金管理人、基金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	交易单元数量	股票交易		应支付该券商的佣金		备注
		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	
中信证券	2	85,178,321.05	100.00%	79,325.83	100.00%	

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
中信证券	170,531,74	100.00%	3,326,600,	100.00%	—	—

	2.66		000.00		
--	------	--	--------	--	--

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、本期新租用证券公司交易单元情况：无。

4、本基金报告期内停止租用交易单元：无。

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	天弘基金管理有限公司关于2016年1月4日指数熔断期间调整旗下部分基金开放时间的公告	中国证监会指定媒介	2016-01-04
2	天弘基金管理有限公司关于在指数熔断实施期间调整旗下交易所场内基金开放时间的公告	中国证监会指定媒介	2016-01-06
3	天弘基金管理有限公司关于2016年1月7日指数熔断期间调整旗下部分基金开放时间的公告	中国证监会指定媒介	2016-01-07
4	天弘普惠养老保本混合型证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会指定媒介	2016-01-08
5	天弘普惠养老保本混合型证券投资基金招募说明书（更新）摘要	中国证监会指定媒介	2016-01-08
6	天弘普惠养老保本混合型证券投资基金2015年第4季度报告	中国证监会指定媒介	2016-01-22
7	天弘基金管理有限公司关于提醒客户谨防虚假客服电话诈骗的风险提示公告	中国证监会指定媒介	2016-03-05
8	天弘普惠养老保本混合型证券投资基金2015年年度报告摘要	中国证监会指定媒介	2016-03-30
9	天弘普惠养老保本混合型证券投资基金2015年年度报告	中国证监会指定媒介	2016-03-30

10	天弘基金管理有限公司广州分公司关于营业场所变更的公告	中国证监会指定媒介	2016-04-07
11	天弘普惠养老保本混合型证券投资基金2016年第1季度报告	中国证监会指定媒介	2016-04-21
12	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会指定媒介	2016-04-23
13	天弘基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会指定媒介	2016-04-30
14	天弘基金管理有限公司旗下基金2016年6月30日基金资产净值公告	中国证监会指定媒介	2016-07-01
15	天弘基金管理有限公司公告	中国证监会指定媒介	2016-07-02
16	天弘基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告	中国证监会指定媒介	2016-07-02
17	天弘普惠养老保本混合型证券投资基金招募说明书（更新）摘要	中国证监会指定媒介	2016-07-08
18	天弘普惠养老保本混合型证券投资基金招募说明书（更新）	中国证监会指定媒介	2016-07-08
19	天弘普惠养老保本混合型证券投资基金2016年第2季度报告	中国证监会指定媒介	2016-07-19
20	天弘普惠养老保本混合型证券投资基金2016年半年度报告	中国证监会指定媒介	2016-08-29
21	天弘普惠养老保本混合型证券投资基金2016年半年度报告摘要	中国证监会指定媒介	2016-08-29
22	天弘普惠养老保本混合型证券投资基金2016年第3季度报告	中国证监会指定媒介	2016-10-26
23	天弘基金管理有限公司关于天弘普惠养老保本混合型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告	中国证监会指定媒介	2016-11-24
24	天弘基金管理有限公司旗下基金2016年12月30日基金资产净值公告	中国证监会指定媒介	2016-12-30
25	天弘基金管理有限公司旗下基金	中国证监会指定媒介	2016-12-31

	2016年12月31日基金资产净值公告		
--	---------------------	--	--

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，本基金出现《基金合同》终止事由，基金管理人已依法对基金财产进行清算，清算结果已报中国证监会备案，本基金《基金合同》自2017年1月25日起终止。具体信息请参见基金管理人于2016年11月24日在指定媒介披露的《天弘基金管理有限公司关于天弘普惠养老保本混合型证券投资基金基金合同终止及基金财产清算的公告》，及于2017年1月25日在指定媒介披露的《天弘基金管理有限公司关于〈天弘普惠养老保本混合型证券投资基金基金合同〉终止的公告》。

§ 13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准天弘普惠养老保本混合型证券投资基金募集的文件
- 2、天弘普惠养老保本混合型证券投资基金基金合同
- 3、天弘普惠养老保本混合型证券投资基金托管协议
- 4、天弘普惠养老保本混合型证券投资基金招募说明书
- 5、报告期内在指定报刊上披露的各项公告
- 6、中国证监会规定的其他文件

13.2 存放地点

天津市河西区马场道59号天津国际经济贸易中心A座16层

13.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的办公场所及网站或基金托管人的办公场所免费查阅备查文件，在支付工本费后，可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

公司网站：www.thfund.com.cn

天弘基金管理有限公司
二〇一七年三月三十日