

天弘云端生活优选灵活配置混合型证券投资基金2015年年度报告摘要

2015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：中国农业银行股份有限公司

送出日期：2016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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年3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2015年3月17日起至2015年12月31日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金简称	天弘云端生活优选
基金主代码	001030
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2015年3月17日
基金管理人	天弘基金管理有限公司
基金托管人	中国农业银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	599,604,262.21
基金合同存续期	不定期

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，利用公司大数据研究优势优选与居民生活密切相关的大消费及相关行业的优质企业进行投资，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	本基金采取灵活资产配置、主动投资管理的投资模式。在投资策略上，本基金从两个层次进行，首先是进行大类资产配置，在一定程度上尽可能地降低证券市场的系统性风险，把握市场波动中产生的投资机会；其次是充分发挥公司大数据研究平台的优势，通过建立量化模型优选具有良好投资价值的投资品种，构建投资组合。
业绩比较基准	60%×中证主要消费指数收益率+40%×中证综合债指数收益率
风险收益特征	本基金为混合型基金，属于中等风险、中等收益预期的基金品种，其风险收益预期高于货币市场基金和债券型基金，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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	童建林	林葛
	联系电话	022-83310208	010-66060069
	电子邮箱	service@thfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4007109999	95599
传真		022-83865569	010-68121816

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	2015年3月17日-2015年12月31日
本期已实现收益	72,227,145.19
本期利润	84,382,029.25
加权平均基金份额本期利润	0.0930
本期基金份额净值增长率	-7.84%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末
期末可供分配基金份额利润	-0.0784
期末基金资产净值	552,567,343.99
期末基金份额净值	0.9216

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、本基金合同2015年3月17日起生效，报告期为2015年3月17日至2015年12月31日。

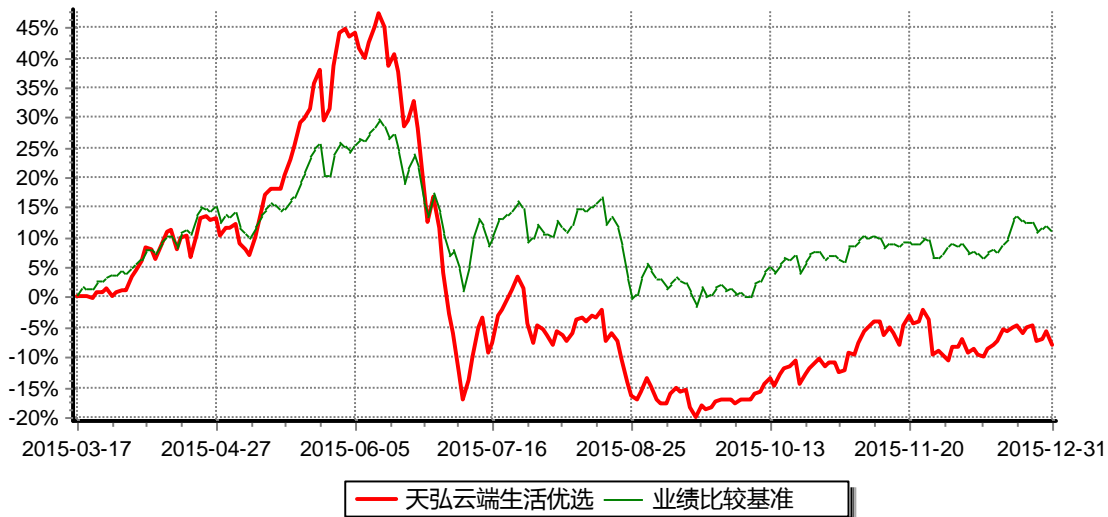
3.2 基金净值表现

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	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	11.17%	1.78%	11.10%	0.99%	0.07%	0.79%
过去六个月	-21.07%	2.42%	-5.15%	1.64%	-15.92%	0.78%
自基金合同生效日起至 至今（2015年03月17 日-2015年12月31日）	-7.84%	2.44%	11.31%	1.61%	-19.15%	0.83%

注：天弘云端生活优选灵活配置混合型证券投资基金的业绩比较基准：60%×中证主要消费指数收益率+40%×中证综合债指数收益率。

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



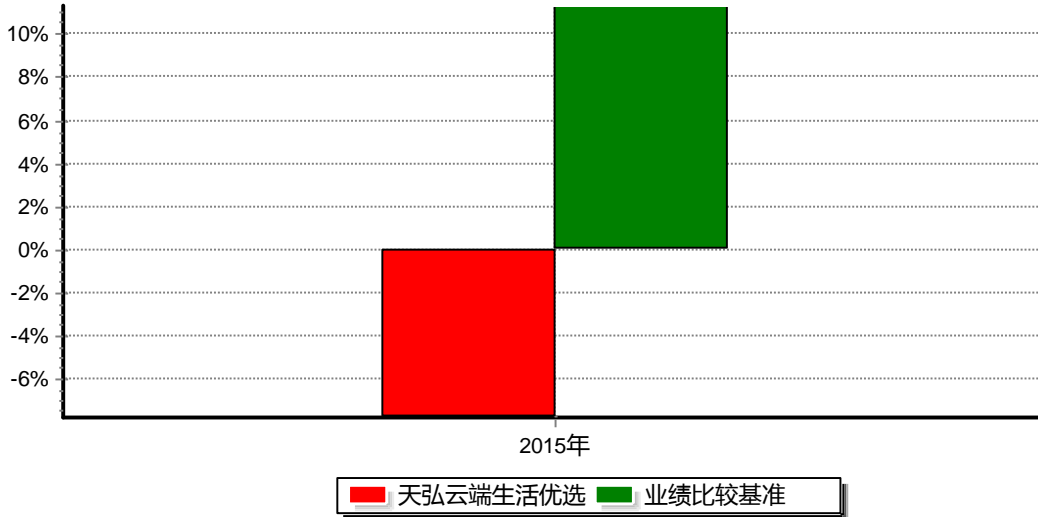
注：1、本基金合同于2015年3月17日生效，本基金合同生效起至披露时点不满1年。

2、按照本基金合同的约定，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3月17日-2015年9月16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。

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3月17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3月17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2015年12月31日，本基金管理人共管理46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、天弘同利分级债券型证券投资基金、天弘季加利理财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、天弘中证银行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、天弘中证休闲娱乐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。

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	2015年3月	—	7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。
李宁	本基金 基金经 理;本公 司股票 研究部 总经理 助理。	2015年3月	—	5年	男, 管理学博士。历任中 信建投证券股份有限公司 行业分析师。2011年8月加 盟本公司, 历任本公司行 业研究员等。

注: 1、上述任职日期为基金合同生效日或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

天弘云端生活优选灵活配置混合型证券投资基金，2015年3月17日成立。基金于4月12日建仓结束，主要配置领域在成长性良好的教育、文化、娱乐健康等新兴消费领域，以及景气度上升的传统消费股。6月份股票市场出现了大幅下跌，基金在持股结构上进行了调整，减持了创业板股票，并增加了白酒、养殖、航空等基本面处于上升趋势且估

值合理的股票的配置，在下跌前期较为抗跌，但是随着市场进入危机状态，股票出现大面积跌停和停牌，市场流动性枯竭，作为一只新发且有一定浮赢的基金，在此时又遭遇了持续的大额赎回，导致降仓避险的目的难以实现，基金净值遭遇了较大损失。三季度市场整体呈现震荡下跌走势，运作较为保守，并配置了一定比例的债券资产，从股票资产的配置上，重点在有业绩、有未来、明显收益政策扶持或者自身内生动力强的领域进行配置，对消费相关的新能源、计算机间板块进行了重点配置，并继续持仓了一些传统消费行业的优选个股。四季度市场以震荡为主，市场信心逐步修复，资金面的净流出出现缓和，基金在四季度增加了股票投资的比例，重点在有业绩、有未来、明显收益政策扶持或者自身内生动力强的领域进行配置，对消费相关的新能源、计算机间板块进行了重点配置，并继续持仓了一些传统消费行业的优选个股。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2015年12月31日，本基金份额净值为0.9216元。本报告期本基金份额净值增长率-7.84%，同期业绩比较基准增长率11.31%。

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，宏观经济面临的不确定性加大，经济仍然处在“增长速度换挡期”、“结构调整阵痛期”、“前期刺激政策消化期”的三期叠加影响之中，预计整体还处在向下寻底以及寻找新的增长点的过程。为了走出当前的经济困局，调结构与稳增长之间会交互作用，但是受到经济环境及外汇环境的局限条件影响，二者之间的空间都不会很大，会呈现一种交互作用的微妙平衡。为了引导流动性支持实体经济，我们预计2016年政府会更多地采用财政政策刺激经济，同时货币政策的宽松程度虽然不及2015年，但仍然会维持整体宽松的格局，在经济阶段性企稳过程中CPI、PPI有望阶段性走高。

当前股票市场已进入熊市周期，未来将是大部分股票不断寻底的过程，防风险成为2016年的主要任务；以创业板为代表的新兴成长股估值整体偏高，外延扩张为主的成长方式不能匹配当前的风险偏好，创业板杀估值的过程仍有可能延续；在信贷扩张的背景下，经济出现类滞涨特征，供需格局改善的价格型品种及部分资源品会有良好表现，是2016年的重点关注领域。诸如食品饮料、医药、品牌服饰等传统消费领域的部分子行业，经过前两年的调整，行业温和复苏，业绩稳定增长，也值得重点关注。

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。

4.7 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

本报告期内，本基金托管人在对天弘云端生活优选灵活配置混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，天弘云端生活优选灵活配置混合型证券投资基金的管理人——天弘基金管理有限公司在天弘云端生活优选灵活配置混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。本报告期

内，天弘云端生活优选灵活配置混合型证券投资基金未进行利润分配。

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

本托管人依法对天弘基金管理有限公司编制和披露的天弘云端生活优选灵活配置混合型证券投资基金2015年年度报告中财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

§ 6 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：天弘云端生活优选灵活配置混合型证券投资基金

报告截止日：2015年12月31日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015年12月31日
资产：		
银行存款	7.4.7.1	28,221,441.32
结算备付金		4,210,133.00
存出保证金		2,080,863.43
交易性金融资产	7.4.7.2	557,615,635.27
其中：股票投资		517,649,356.37
基金投资		—
债券投资		39,966,278.90
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	655,430.90
应收股利		—
应收申购款		23,772.17
递延所得税资产		—
其他资产	7.4.7.6	—
资产总计		592,807,276.09
负债和所有者权益	附注号	本期末 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		27,800,000.00
应付证券清算款		8,465,850.90
应付赎回款		1,047,803.78
应付管理人报酬		717,202.15
应付托管费		119,533.70
应付销售服务费		—
应付交易费用	7.4.7.7	1,760,550.99
应交税费		—
应付利息		2,080.97
应付利润		—
递延所得税负债		—
其他负债	7.4.7.8	326,909.61
负债合计		40,239,932.10
所有者权益:		
实收基金	7.4.7.9	599,604,262.21

未分配利润	7.4.7.10	-47,036,918.22
所有者权益合计		552,567,343.99
负债和所有者权益总计		592,807,276.09

注：1、报告截止日2015年12月31日，基金份额净值0.9216元，基金份额总额 599,604,262.21份。
2、本财务报表的实际编制期间为2015年3月17日(基金合同生效日)至2015年12月31日,无上一年度可比期间(下同)。

7.2 利润表

会计主体：天弘云端生活优选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015年3月17日至2015年12月31日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期 2015年3月17日至2015年12月31日
一、收入		115,530,035.05
1. 利息收入		4,989,053.40
其中：存款利息收入	7.4.7.11	561,917.87
债券利息收入		3,313,164.94
资产支持证券利息收入		—
买入返售金融资产收入		1,113,970.59
其他利息收入		—
2. 投资收益（损失以“-”填列）		77,804,525.91
其中：股票投资收益	7.4.7.12	71,184,927.94
基金投资收益		—
债券投资收益	7.4.7.13	433,555.08
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	6,186,042.89

3. 公允价值变动收益(损失以“-”号填列)	7.4.7.17	12,154,884.06
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	20,581,571.68
减：二、费用		31,148,005.80
1. 管理人报酬		11,214,413.85
2. 托管费		1,869,068.90
3. 销售服务费		—
4. 交易费用	7.4.7.19	17,632,551.21
5. 利息支出		62,233.81
其中：卖出回购金融资产支出		62,233.81
6. 其他费用	7.4.7.20	369,738.03
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		84,382,029.25
减：所得税费用		—
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		84,382,029.25

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：天弘云端生活优选灵活配置混合型证券投资基金

本报告期：2015年3月17日至2015年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2015年3月17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)	1,509,622,448.13	—	1,509,622,448.13
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	84,382,029.25	84,382,029.25

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)	-910,018,185.9 2	-131,418,947.4 7	-1,041,437,133.39
其中：1. 基金申购款	656,053,406.22	191,485,567.18	847,538,973.40
2. 基金赎回款	-1,566,071,592. 14	-322,904,514.6 5	-1,888,976,106.79
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)	599,604,262.21	-47,036,918.22	552,567,343.99

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

天弘云端生活优选灵活配置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]90号《关于核准天弘云端生活优选灵活配置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《天弘云端生活优选灵活配置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,首次募集期间自2015年2月9日至2015年3月13日,首次设立募集不包括认购资金利息共募集

1,509,378,041.33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189号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《天弘云端生活优选灵活配置混合型证券投资基金基金合同》于2015年3月17日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,509,622,448.13份基金份额,其中认购资金利息折合244,406.80份基金份额。本基金的基金管理人为天弘基金管理有限公司,基金托管人为中国农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《天弘云端生活优选灵活配置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)、权证、债券等固定收益类金融工具(包括国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、中期票据、中小企业私募债、可转换债券(含分离交易可转债)、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款等)、股指期货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的相关规定)。基金的投资组合比例为:本基金股票投资比例为基金资产的0%-95%,投资于消费及相关行业的证券资产不低于非现金基金资产的80%;投资于权证的比例不超过基金资产的3%;每个交易日日终在扣除股指期货合约需缴纳的交易保证金后,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:中证主要消费指数收益率×60%+中证综合债指数收益率×40%。

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2016年3月25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》、《天弘云端生活优选灵活配置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。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2015年3月17日(基金合同生效日)至2015年12月31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2015年12月31日的财务状况以及2015年3月17日(基金合同生效日)至2015年12月31日止期间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。本期财务报表的实际编制期间为2015年3月17日(基金合同生效日)至2015年12月31日。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

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、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)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、债券投资和衍生工具(主要为权证投资)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。本基金收益以现金形式分配，但基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资。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为正数，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》提供的指数收益法等估值技术进行估值。

(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、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

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、资产支持证券和私募债券除外)，鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息，本基金本报告期改为采用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》所独立提供的估值结果确定公允价值。

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[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[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》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1)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。基金买卖股票、债券的差价收入不予征收营业税。

(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，股权的股息、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，于2015年9月8日前暂减按25%计入应纳税所得额，自2015年9月8日起，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
中国农业银行股份有限公司(“中国农业银行”)	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、2015年度内，本基金管理人股东“内蒙古君正能源化工股份有限公司”的名称变更为“内蒙古君正能源化工集团股份有限公司”。

3、根据本基金管理人于2015年2月26日披露的关于完成增资扩股相关工商变更登记的公告，浙江蚂蚁小微金融服务集团有限公司、新疆天瑞博丰股权投资合伙企业（有限合伙）、新疆天惠新盟股权投资合伙企业（有限合伙）、新疆天阜恒基股权投资合伙企业（有限合伙）、新疆天聚宸兴股权投资合伙企业（有限合伙）为本基金管理人新增股东。

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

本基金本报告期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 2015年3月17日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	11,214,413.85
其中：支付销售机构的客户维护费	5,292,380.20

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 X 1.50% / 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 2015年3月17日至2015年12月31日
----	------------------------------

当期发生的基金应支付的托管费	1,869,068.90
----------------	--------------

注：支付基金托管人海通证券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 X 0.25% / 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

本基金本报告期末与关联方进行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 2015年3月17日至2015年12月31日
基金合同生效日（2015年3月17日）持有的基金份额	—
期初持有的基金份额	—
基金合同生效日起至报告期末基金总申购份额	16,633,399.87
基金合同生效日起至报告期末基金拆分变动份额	—
减：基金合同生效日起至报告期末基金总赎回份额	—
期末持有的基金份额	16,633,399.87
期末持有的基金份额占基金总份额比例	2.77%

注：基金管理人天弘基金管理有限公司在本年度申购本基金的交易委托直销柜台办理，适用费率为每笔1000元。

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

本基金本报告期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 2015年3月17日至2015年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国农业银行	28,221,441.32	350,271.69

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，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

本基金本报告期无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.9 利润分配情况

7.4.9.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金本报告期未进行利润分配。

7.4.10 期末（2015年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.10.1 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。

7.4.10.2 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（单位：股）	期末成本总额	期末估值总额
600153	建发股份	2015-06-29	重大资产重组	14.69	-	-	613,890	13,206,842.36	9,018,044.10
300351	永贵电器	2015-10-19	重大资产重组	31.30	2016-02-18	29.80	199,300	5,594,234.00	6,238,090.00
300036	超图软件	2015-10-30	重大资产重组	43.18	2016-01-15	35.11	143,900	5,623,566.08	6,213,602.00
002612	朗姿股份	2015-12-23	拟披露重大事项	75.46	-	-	75,600	5,646,912.60	5,704,776.00

注：本基金截至2015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。

7.4.10.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.10.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2015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。

7.4.10.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2015年12月31日止，本基金从事交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额27,800,000.00，于2016年1月6日到期。

§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	517,649,356.37	87.32
	其中：股票	517,649,356.37	87.32
2	固定收益投资	39,966,278.90	6.74
	其中：债券	39,966,278.90	6.74
	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	32,431,574.32	5.47
7	其他各项资产	2,760,066.50	0.47
8	合计	592,807,276.09	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	57,389,063.27	10.39
B	采矿业	—	—
C	制造业	345,128,104.70	62.46
D	电力、热力、燃气及水生产和供应业	—	—
E	建筑业	—	—
F	批发和零售业	30,123,900.10	5.45
G	交通运输、仓储和邮政业	7,586,131.98	1.37
H	住宿和餐饮业	—	—
I	信息传输、软件和信息技术服务业	22,973,666.75	4.16
J	金融业	—	—
K	房地产业	17,896,017.71	3.24
L	租赁和商务服务业	11,898,582.60	2.15
M	科学研究和技术服务业	—	—
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	24,653,889.26	4.46
S	综合	—	—
	合计	517,649,356.37	93.68

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	002429	兆驰股份	1,962,539	24,904,619.91	4.51
2	300103	达刚路机	794,500	21,125,755.00	3.82
3	002321	华英农业	1,579,052	20,859,276.92	3.77
4	300367	东方网力	270,554	18,857,613.80	3.41

5	600433	冠豪高新	1,630,706	18,687,890.76	3.38
6	600963	岳阳林纸	2,172,917	17,883,106.91	3.24
7	600735	新华锦	714,400	17,159,888.00	3.11
8	000049	德赛电池	296,700	16,846,626.00	3.05
9	002665	首航节能	532,900	16,253,450.00	2.94
10	300097	智云股份	346,132	16,077,831.40	2.91

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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600559	老白干酒	83,755,873.95	15.16
2	002714	牧原股份	74,216,324.81	13.43
3	000596	古井贡酒	71,885,041.67	13.01
4	002646	青青稞酒	67,692,696.62	12.25
5	300178	腾邦国际	58,887,574.60	10.66
6	601688	华泰证券	57,693,033.19	10.44
7	002299	圣农发展	57,251,669.26	10.36
8	000971	高升控股	54,981,677.56	9.95
9	600029	南方航空	54,130,238.46	9.80
10	002321	华英农业	52,873,648.22	9.57
11	300152	科融环境	52,149,452.15	9.44
12	600115	东方航空	51,952,554.90	9.40
13	600750	江中药业	50,776,304.53	9.19
14	000712	锦龙股份	49,675,036.27	8.99
15	002304	洋河股份	49,155,899.15	8.90
16	000998	隆平高科	48,156,837.99	8.72
17	601166	兴业银行	47,990,882.87	8.69
18	600030	中信证券	47,863,979.99	8.66

19	002719	麦趣尔	45,798,470.15	8.29
20	002477	雏鹰农牧	44,527,270.52	8.06
21	600850	华东电脑	42,466,444.40	7.69
22	600109	国金证券	42,059,786.88	7.61
23	002746	仙坛股份	41,730,085.00	7.55
24	000858	五 粮 液	41,408,027.42	7.49
25	600038	中直股份	40,828,802.01	7.39
26	000001	平安银行	40,667,627.31	7.36
27	000802	北京文化	40,648,446.26	7.36
28	600990	四创电子	40,534,596.32	7.34
29	000869	张 裕 A	40,306,176.51	7.29
30	002429	兆驰股份	39,019,779.31	7.06
31	002160	常铝股份	38,660,017.76	7.00
32	600765	中航重机	36,746,667.35	6.65
33	000568	泸州老窖	36,546,480.60	6.61
34	601318	中国平安	36,538,028.82	6.61
35	002407	多氟多	36,306,469.00	6.57
36	600965	福成五丰	35,227,846.87	6.38
37	002736	国信证券	34,419,078.51	6.23
38	600872	中炬高新	34,296,678.43	6.21
39	300072	三聚环保	33,894,780.00	6.13
40	002100	天康生物	33,586,656.98	6.08
41	300422	博世科	33,453,354.75	6.05
42	002234	民和股份	33,350,715.92	6.04
43	600332	白云山	33,318,081.77	6.03
44	600415	小商品城	32,154,369.46	5.82
45	002020	京新药业	31,891,344.35	5.77
46	000861	海印股份	31,611,935.44	5.72
47	603555	贵人鸟	31,069,815.14	5.62
48	600837	海通证券	30,932,635.84	5.60

49	000722	湖南发展	30,901,736.08	5.59
50	600737	中粮屯河	30,722,423.13	5.56
51	002466	天齐锂业	30,356,058.10	5.49
52	600893	中航动力	30,150,975.04	5.46
53	002268	卫士通	30,103,379.43	5.45
54	600571	信雅达	30,075,440.43	5.44
55	300342	天银机电	29,655,151.76	5.37
56	002604	龙力生物	29,420,886.49	5.32
57	300304	云意电气	29,323,524.24	5.31
58	600576	万家文化	29,251,893.90	5.29
59	300384	三联虹普	29,225,637.82	5.29
60	601607	上海医药	29,193,655.90	5.28
61	002157	正邦科技	28,988,835.27	5.25
62	002154	报喜鸟	28,906,485.91	5.23
63	601009	南京银行	27,987,133.25	5.06
64	000089	深圳机场	27,829,282.54	5.04
65	300159	新研股份	27,778,221.63	5.03
66	002033	丽江旅游	27,581,660.79	4.99
67	300255	常山药业	27,485,959.78	4.97
68	600702	沱牌舍得	27,325,999.01	4.95
69	002312	三泰控股	26,903,016.42	4.87
70	600418	江淮汽车	26,749,566.56	4.84
71	600391	成发科技	26,623,040.46	4.82
72	600883	博闻科技	26,140,303.69	4.73
73	600749	西藏旅游	25,972,814.29	4.70
74	300399	京天利	25,615,713.40	4.64
75	600703	三安光电	25,457,393.00	4.61
76	000421	南京中北	25,190,869.22	4.56
77	002385	大北农	25,170,970.90	4.56
78	002373	千方科技	25,011,774.86	4.53

79	002011	盾安环境	24,884,424.45	4.50
80	600093	禾嘉股份	24,555,360.48	4.44
81	300090	盛运环保	24,536,082.30	4.44
82	600313	农发种业	24,464,198.00	4.43
83	002103	广博股份	24,441,574.37	4.42
84	300199	翰宇药业	23,975,194.97	4.34
85	600519	贵州茅台	23,963,219.00	4.34
86	300104	乐视网	23,412,512.00	4.24
87	000929	兰州黄河	23,398,374.83	4.23
88	600687	刚泰控股	23,363,047.83	4.23
89	600000	浦发银行	23,359,224.00	4.23
90	600433	冠豪高新	23,220,246.00	4.20
91	000503	海虹控股	23,088,171.30	4.18
92	600963	岳阳林纸	22,945,717.95	4.15
93	300377	赢时胜	22,856,288.60	4.14
94	002675	东诚药业	22,607,907.94	4.09
95	600501	航天晨光	22,427,881.41	4.06
96	000948	南天信息	22,315,767.86	4.04
97	601398	工商银行	22,042,015.35	3.99
98	300350	华鹏飞	22,024,516.00	3.99
99	002422	科伦药业	21,282,801.14	3.85
100	603198	迎驾贡酒	21,054,853.60	3.81
101	002340	格林美	20,993,206.38	3.80
102	600855	航天长峰	20,786,213.79	3.76
103	300146	汤臣倍健	20,736,630.00	3.75
104	300059	东方财富	20,619,360.00	3.73
105	002631	德尔未来	20,260,049.12	3.67
106	300017	网宿科技	20,212,043.00	3.66
107	600036	招商银行	20,118,892.74	3.64
108	002053	云南盐化	20,067,696.00	3.63

109	002354	天神娱乐	20,055,489.00	3.63
110	002143	印纪传媒	20,035,049.20	3.63
111	600015	华夏银行	19,816,895.39	3.59
112	002059	云南旅游	19,807,446.35	3.58
113	002301	齐心集团	19,665,040.50	3.56
114	600667	太极实业	19,581,568.71	3.54
115	002074	国轩高科	19,525,058.00	3.53
116	002345	潮宏基	19,283,641.00	3.49
117	000930	中粮生化	19,247,138.50	3.48
118	300310	宜通世纪	18,986,828.50	3.44
119	600779	*ST水井	18,965,666.10	3.43
120	300367	东方网力	18,754,799.04	3.39
121	002614	蒙发利	18,505,593.09	3.35
122	002339	积成电子	18,378,420.91	3.33
123	002568	百润股份	18,293,604.95	3.31
124	600168	武汉控股	17,989,711.19	3.26
125	000501	鄂武商 A	17,987,743.87	3.26
126	000035	中国天楹	17,975,088.79	3.25
127	000028	国药一致	17,908,315.86	3.24
128	603008	喜临门	17,835,769.99	3.23
129	603718	海利生物	17,709,688.00	3.20
130	600570	恒生电子	17,592,858.00	3.18
131	002657	中科金财	17,493,654.00	3.17
132	002072	凯瑞德	17,336,488.18	3.14
133	600728	佳都科技	17,281,019.00	3.13
134	600138	中青旅	17,261,084.98	3.12
135	300250	初灵信息	17,166,009.50	3.11
136	002665	首航节能	16,955,137.30	3.07
137	000049	德赛电池	16,927,936.00	3.06
138	000709	河北钢铁	16,889,323.00	3.06

139	600005	武钢股份	16,888,035.50	3.06
140	600058	五矿发展	16,834,815.00	3.05
141	000669	金鸿能源	16,523,821.74	2.99
142	000829	天音控股	16,499,928.72	2.99
143	600690	青岛海尔	16,495,724.13	2.99
144	300103	达刚路机	16,494,702.83	2.99
145	300352	北信源	16,280,805.86	2.95
146	600640	号百控股	16,142,391.28	2.92
147	600195	中牧股份	16,041,602.72	2.90
148	300339	润和软件	16,023,947.00	2.90
149	002673	西部证券	15,967,090.00	2.89
150	000100	TCL 集团	15,944,199.28	2.89
151	002191	劲嘉股份	15,751,689.22	2.85
152	300097	智云股份	15,740,811.56	2.85
153	600635	大众公用	15,715,843.00	2.84
154	002303	美盈森	15,591,168.99	2.82
155	600735	新华锦	15,427,149.12	2.79
156	600234	山水文化	15,238,120.67	2.76
157	002539	新都化工	15,120,414.50	2.74
158	300165	天瑞仪器	15,089,011.83	2.73
159	300392	腾信股份	14,935,355.00	2.70
160	002538	司尔特	14,846,336.32	2.69
161	002335	科华恒盛	14,804,654.60	2.68
162	002612	朗姿股份	14,751,166.10	2.67
163	300070	碧水源	14,666,940.32	2.65
164	000911	南宁糖业	14,554,450.46	2.63
165	002275	桂林三金	14,316,942.90	2.59
166	002287	奇正藏药	14,239,011.00	2.58
167	600647	同达创业	14,064,230.05	2.55
168	600655	豫园商城	14,053,073.10	2.54

169	600857	宁波中百	14,034,829.20	2.54
170	600222	太龙药业	13,974,163.46	2.53
171	000488	晨鸣纸业	13,837,908.90	2.50
172	603588	高能环境	13,836,123.28	2.50
173	300021	大禹节水	13,749,572.00	2.49
174	000428	华天酒店	13,542,087.10	2.45
175	000828	东莞控股	13,397,920.39	2.42
176	000651	格力电器	13,359,160.34	2.42
177	002601	佰利联	13,334,653.00	2.41
178	600422	昆药集团	13,295,391.99	2.41
179	000601	韶能股份	13,227,674.30	2.39
180	600153	建发股份	13,206,842.36	2.39
181	603001	奥康国际	13,196,620.66	2.39
182	002511	中顺洁柔	13,171,422.58	2.38
183	600054	黄山旅游	13,021,807.13	2.36
184	300012	华测检测	12,886,017.00	2.33
185	600617	国新能源	12,717,367.37	2.30
186	603118	共进股份	12,640,298.80	2.29
187	601857	中国石油	12,593,062.00	2.28
188	000799	*ST酒鬼	12,495,879.37	2.26
189	300269	联建光电	12,450,456.75	2.25
190	600547	山东黄金	12,403,504.04	2.24
191	300457	赢合科技	12,143,196.50	2.20
192	000430	张家界	12,076,454.17	2.19
193	600097	开创国际	11,943,595.59	2.16
194	601111	中国国航	11,919,324.60	2.16
195	600706	曲江文旅	11,819,791.47	2.14
196	300114	中航电测	11,765,625.08	2.13
197	000524	岭南控股	11,755,923.55	2.13
198	600360	华微电子	11,742,263.00	2.13

199	000810	创维数字	11,724,532.67	2.12
200	002251	步步高	11,675,016.00	2.11
201	600108	亚盛集团	11,674,984.50	2.11
202	300160	秀强股份	11,590,171.20	2.10
203	000888	峨眉山 A	11,560,471.82	2.09
204	002273	水晶光电	11,524,568.02	2.09
205	600336	澳柯玛	11,492,066.06	2.08
206	000910	大亚科技	11,452,255.21	2.07
207	000158	常山股份	11,451,026.00	2.07
208	002117	东港股份	11,440,826.00	2.07
209	300251	光线传媒	11,372,582.16	2.06
210	000860	顺鑫农业	11,360,394.60	2.06
211	300078	思创医惠	11,347,774.40	2.05
212	601901	方正证券	11,305,565.69	2.05
213	000516	国际医学	11,304,089.71	2.05
214	002024	苏宁云商	11,250,522.00	2.04
215	603019	中科曙光	11,212,382.50	2.03
216	600305	恒顺醋业	11,176,523.74	2.02
217	600622	嘉宝集团	11,169,529.80	2.02
218	002534	杭锅股份	11,165,771.80	2.02
219	600662	强生控股	11,155,727.68	2.02
220	600639	浦东金桥	11,144,493.92	2.02
221	600697	欧亚集团	11,122,954.20	2.01
222	600526	菲达环保	11,120,909.24	2.01
223	600856	中天能源	11,086,510.53	2.01
224	000610	西安旅游	11,084,686.14	2.01
225	000411	英特集团	11,075,621.00	2.00
226	300048	合康变频	11,061,687.50	2.00

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末基金资产净值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	占期末基金资产净值比例(%)
1	600559	老白干酒	77,849,023.78	14.09
2	300152	科融环境	67,231,231.65	12.17
3	002714	牧原股份	66,879,801.38	12.10
4	000596	古井贡酒	66,339,696.26	12.01
5	601688	华泰证券	61,210,440.50	11.08
6	000712	锦龙股份	58,230,043.71	10.54
7	002646	青青稞酒	54,988,515.37	9.95
8	600750	江中药业	51,938,178.66	9.40
9	000971	高升控股	51,772,866.84	9.37
10	600030	中信证券	49,425,200.53	8.94
11	002299	圣农发展	48,802,817.37	8.83
12	600029	南方航空	48,160,533.39	8.72
13	000001	平安银行	47,351,923.50	8.57
14	002100	天康生物	46,644,093.71	8.44
15	603555	贵人鸟	46,556,225.31	8.43
16	002719	麦趣尔	45,956,189.03	8.32
17	002304	洋河股份	45,811,471.55	8.29
18	601166	兴业银行	45,456,400.20	8.23
19	600115	东方航空	41,193,143.27	7.45
20	600109	国金证券	40,894,437.06	7.40
21	002746	仙坛股份	39,731,518.72	7.19
22	002466	天齐锂业	39,470,054.04	7.14
23	000869	张裕A	38,844,840.49	7.03
24	300350	华鹏飞	38,632,023.08	6.99
25	002154	报喜鸟	38,594,826.19	6.98
26	600850	华东电脑	37,820,160.70	6.84

27	600765	中航重机	37,366,750.07	6.76
28	600038	中直股份	37,286,707.73	6.75
29	000858	五粮液	37,088,452.06	6.71
30	600837	海通证券	36,923,062.18	6.68
31	002020	京新药业	36,904,767.35	6.68
32	300199	翰宇药业	36,778,604.45	6.66
33	000568	泸州老窖	36,557,218.78	6.62
34	600990	四创电子	36,166,702.79	6.55
35	300178	腾邦国际	36,067,008.33	6.53
36	600415	小商品城	35,300,560.70	6.39
37	002477	雏鹰农牧	35,218,382.72	6.37
38	300399	京天利	35,016,487.31	6.34
39	000802	北京文化	34,732,142.59	6.29
40	601318	中国平安	33,981,672.00	6.15
41	600737	中粮屯河	33,840,431.04	6.12
42	600332	白云山	33,424,363.85	6.05
43	300255	常山药业	33,338,141.27	6.03
44	002157	正邦科技	33,105,083.09	5.99
45	300342	天银机电	32,575,407.12	5.90
46	002033	丽江旅游	32,572,076.22	5.89
47	601607	上海医药	32,246,666.95	5.84
48	000948	南天信息	32,208,221.77	5.83
49	002736	国信证券	32,187,034.00	5.82
50	002103	广博股份	32,146,208.22	5.82
51	600872	中炬高新	32,136,454.30	5.82
52	000861	海印股份	31,967,345.82	5.79
53	000998	隆平高科	31,125,805.80	5.63
54	002614	蒙发利	30,483,934.90	5.52
55	600893	中航动力	30,343,288.00	5.49
56	601009	南京银行	29,872,700.07	5.41

57	300384	三联虹普	29,453,101.78	5.33
58	002143	印纪传媒	29,087,381.19	5.26
59	600313	农发种业	28,792,300.34	5.21
60	002011	盾安环境	28,749,088.70	5.20
61	002160	常铝股份	28,713,621.39	5.20
62	002321	华英农业	28,697,062.14	5.19
63	000421	南京中北	28,655,115.99	5.19
64	002312	三泰控股	28,536,554.11	5.16
65	600855	航天长峰	28,433,483.31	5.15
66	300165	天瑞仪器	28,318,365.68	5.12
67	600749	西藏旅游	28,211,390.50	5.11
68	002407	多氟多	28,011,852.11	5.07
69	600418	江淮汽车	27,993,054.76	5.07
70	600965	福成五丰	27,942,167.48	5.06
71	002604	龙力生物	27,926,441.98	5.05
72	600571	信雅达	27,681,162.06	5.01
73	300352	北信源	27,209,214.26	4.92
74	600576	万家文化	26,947,386.96	4.88
75	300422	博世科	26,880,218.14	4.86
76	300159	新研股份	26,750,764.86	4.84
77	002268	卫士通	26,513,298.38	4.80
78	600391	成发科技	26,007,447.08	4.71
79	300072	三聚环保	25,051,912.92	4.53
80	002059	云南旅游	24,932,927.72	4.51
81	000722	湖南发展	24,675,323.26	4.47
82	600519	贵州茅台	24,516,002.99	4.44
83	600000	浦发银行	24,408,747.02	4.42
84	300090	盛运环保	24,388,092.12	4.41
85	600687	刚泰控股	24,272,655.18	4.39
86	002373	千方科技	24,193,411.37	4.38

87	000501	鄂武商 A	24,086,542.57	4.36
88	601398	工商银行	23,860,126.78	4.32
89	002675	东诚药业	23,599,408.94	4.27
90	600501	航天晨光	22,844,622.84	4.13
91	002340	格林美	22,556,424.36	4.08
92	002385	大北农	22,456,778.04	4.06
93	002422	科伦药业	22,265,693.89	4.03
94	300146	汤臣倍健	22,151,104.29	4.01
95	002345	潮宏基	22,122,930.84	4.00
96	600728	佳都科技	22,031,028.06	3.99
97	600015	华夏银行	21,866,596.67	3.96
98	000930	中粮生化	21,823,298.80	3.95
99	002234	民和股份	21,714,097.83	3.93
100	002354	天神娱乐	21,332,504.06	3.86
101	600703	三安光电	21,257,727.64	3.85
102	002074	国轩高科	21,212,865.58	3.84
103	300377	赢时胜	21,116,364.58	3.82
104	000503	海虹控股	20,840,856.92	3.77
105	002072	凯瑞德	20,259,503.61	3.67
106	002053	云南盐化	20,219,012.29	3.66
107	300017	网宿科技	20,149,664.66	3.65
108	300059	东方财富	20,075,673.92	3.63
109	600036	招商银行	19,953,836.02	3.61
110	600690	青岛海尔	19,833,179.62	3.59
111	600222	太龙药业	19,709,843.78	3.57
112	002631	德尔未来	19,357,472.52	3.50
113	300310	宜通世纪	19,295,403.42	3.49
114	300104	乐视网	19,276,831.22	3.49
115	603118	共进股份	19,001,347.42	3.44
116	600883	博闻科技	18,997,369.52	3.44

117	600422	昆药集团	18,988,539.25	3.44
118	600195	中牧股份	18,985,898.22	3.44
119	600093	禾嘉股份	18,940,641.00	3.43
120	600702	沱牌舍得	18,768,411.43	3.40
121	002301	齐心集团	18,622,168.57	3.37
122	000829	天音控股	18,498,270.50	3.35
123	603198	迎驾贡酒	18,452,379.00	3.34
124	603008	喜临门	18,299,327.36	3.31
125	600706	曲江文旅	18,278,543.54	3.31
126	002098	浔兴股份	18,006,479.55	3.26
127	002339	积成电子	17,946,216.48	3.25
128	600138	中青旅	17,832,201.00	3.23
129	000929	兰州黄河	17,768,276.38	3.22
130	600168	武汉控股	17,477,033.50	3.16
131	002568	百润股份	17,406,351.53	3.15
132	000669	金鸿能源	17,136,302.00	3.10
133	603588	高能环境	17,134,221.34	3.10
134	002273	水晶光电	17,048,271.59	3.09
135	002657	中科金财	16,992,364.80	3.08
136	000428	华天酒店	16,981,291.59	3.07
137	300392	腾信股份	16,902,999.17	3.06
138	002612	朗姿股份	16,569,188.00	3.00
139	603718	海利生物	16,465,979.67	2.98
140	600058	五矿发展	16,452,589.85	2.98
141	000028	国药一致	16,441,405.50	2.98
142	000035	中国天楹	16,317,361.46	2.95
143	600856	中天能源	16,244,535.20	2.94
144	000089	深圳机场	16,108,944.40	2.92
145	002539	新都化工	15,818,584.37	2.86
146	000100	TCL 集团	15,715,417.00	2.84

147	002251	步步高	15,700,097.50	2.84
148	000651	格力电器	15,648,639.98	2.83
149	600635	大众公用	15,533,132.83	2.81
150	600336	澳柯玛	15,498,791.74	2.80
151	300339	润和软件	15,412,022.86	2.79
152	000601	韶能股份	15,318,958.62	2.77
153	000709	河北钢铁	14,944,326.00	2.70
154	300070	碧水源	14,856,383.02	2.69
155	600570	恒生电子	14,707,219.09	2.66
156	300250	初灵信息	14,632,006.00	2.65
157	600697	欧亚集团	14,609,472.28	2.64
158	002303	美盈森	14,495,236.70	2.62
159	002538	司尔特	14,491,034.95	2.62
160	002335	科华恒盛	14,338,595.50	2.59
161	002191	劲嘉股份	14,248,705.07	2.58
162	000911	南宁糖业	14,242,649.46	2.58
163	300021	大禹节水	14,101,503.00	2.55
164	600655	豫园商城	14,051,891.18	2.54
165	600005	武钢股份	14,021,178.00	2.54
166	600647	同达创业	13,734,259.00	2.49
167	603001	奥康国际	13,685,320.06	2.48
168	601857	中国石油	13,546,995.00	2.45
169	600857	宁波中百	13,418,627.70	2.43
170	300457	赢合科技	13,239,818.80	2.40
171	600305	恒顺醋业	13,122,860.02	2.37
172	002275	桂林三金	13,056,607.24	2.36
173	002673	西部证券	12,912,231.00	2.34
174	600779	*ST水井	12,637,460.75	2.29
175	600617	国新能源	12,609,618.52	2.28
176	000516	国际医学	12,603,100.60	2.28

177	002601	佰利联	12,549,740.92	2.27
178	600097	开创国际	12,468,439.84	2.26
179	300114	中航电测	12,342,274.89	2.23
180	000799	*ST酒鬼	12,326,766.81	2.23
181	002287	奇正藏药	12,299,317.13	2.23
182	002511	中顺洁柔	12,131,323.46	2.20
183	300012	华测检测	12,013,339.60	2.17
184	000430	张家界	12,000,166.32	2.17
185	600360	华微电子	11,921,981.26	2.16
186	002616	长青集团	11,799,272.99	2.14
187	002429	兆驰股份	11,706,788.74	2.12
188	601901	方正证券	11,694,310.25	2.12
189	002267	陕天然气	11,592,656.30	2.10
190	300160	秀强股份	11,578,166.86	2.10
191	601111	中国国航	11,423,916.00	2.07
192	000810	创维数字	11,248,244.45	2.04
193	300005	探路者	11,166,396.00	2.02

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	6,084,189,392.04
卖出股票的收入（成交）总额	5,649,666,466.74

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

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	29,777,000.00	5.39
2	央行票据	—	—

3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	9,818,058.90	1.78
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债	371,220.00	0.07
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	39,966,278.90	7.23

注：可转债项下包含可交换债371,220.00元。

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

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	019520	15国债20	200,000	19,998,000.00	3.62
2	020076	15贴债02	100,000	9,779,000.00	1.77
3	1180040	11绥化城投债	50,000	5,324,500.00	0.96
4	122539	PR阜城投	53,770	4,493,558.90	0.81
5	132003	15清控EB	2,690	371,220.00	0.07

8.7 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。

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	2,080,863.43
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	655,430.90
5	应收申购款	23,772.17
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	2,760,066.50

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
30,937	19,381.46	18,359,238.92	3.06%	581,245,023.29	96.94%

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	983,738.02	0.16%

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

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	10~50
本基金基金经理持有本开放式基金	10~50

§ 10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2015年3月17日)基金份额总额	1,509,622,448.13
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	656,053,406.22
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	-1,566,071,592.14
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	599,604,262.21

注：1、本基金合同于2015年3月17日生效；

2、总申购份额转换转入份额；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，本基金的基金管理人、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10万元整。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)已为天弘云端生活优选灵活配置混合型证券投资基金提供审计服务10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	
长江证券	1	829,453,102.73	7.07%	772,470.46	7.19%	
东兴证券	1	263,950,671.54	2.25%	245,818.83	2.29%	

方正证券	1	328,381,066 .40	2.80%	305,821.97	2.85%	
国信证券	2	96,302,858. 72	0.82%	89,686.86	0.83%	
申万宏源	2	655,105,496 .08	5.58%	610,099.67	5.68%	
兴业证券	1	179,886,899 .60	1.53%	167,529.64	1.56%	
中金公司	2	2,724,886,0 34.63	23.22%	2,484,591.3 7	23.13%	
中信建投	2	1,845,871,8 16.67	15.73%	1,687,597.8 1	15.71%	
中信证券	2	4,810,017,9 12.41	40.99%	4,379,043.8 1	40.76%	

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
长江证券	—	—	—	—	—	—
东兴证券	—	—	1,092,70 0,000.00	6.29%	—	—
方正证券	—	—	—	—	—	—
国信证券	—	—	27,800,0 00.00	0.16%	—	—
申万宏源	—	—	2,524,80 0,000.00	14.54%	—	—
兴业证券	5,654,51 9.49	22.12%	220,300, 000.00	1.27%	—	—
中金公司	10,129,6 04.11	39.62%	3,991,50 0,000.00	22.99%	—	—
中信建投	—	—	3,399,10 0,000.00	19.57%	—	—

中信证券	9,782,300.00	38.26%	6,108,400,000.00	35.18%	—	—
------	--------------	--------	------------------	--------	---	---

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17个

序号	证券公司名称	所属市场	数量
1	中信建投证券	上海	1
2	中信建投证券	深圳	1
3	中金公司	上海	1
4	中金公司	深圳	1
5	兴业证券	上海	1
6	兴业证券	深圳	1
7	长江证券	深圳	1
8	申万宏源	上海	1
9	申万宏源	深圳	1
10	东兴证券	上海	1
11	方正证券	深圳	1
12	招商证券	上海	1
13	招商证券	深圳	1
14	民族证券	上海	1
15	民族证券	深圳	1
16	国信证券	上海	1
17	国信证券	深圳	1

4、本基金报告期内停止租用交易单元：无。

§ 12 影响投资者决策的其他重要信息

1、2015年度内，天弘基金管理有限公司（以下简称“公司”）注册资本由1.8亿元人民币增加至5.143亿元人民币，浙江蚂蚁小微金融服务集团有限公司持有公司51%的股权。

2、2015年度内，公司股东会选举井贤栋先生、卢信群先生、袁雷鸣先生、屠剑威先生、付岩先生、郭树强先生、魏新顺先生、张军先生和贺强先生担任新一届董事会董事，其中井贤栋先生、袁雷鸣先生、屠剑威先生、张军先生和贺强先生为新任董事；公司董事会选举井贤栋先生为新一届董事会董事长（公司法定代表人）。

3、2015年度内，公司住所由“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”变更为“天津自贸区（中心商务区）响螺湾旷世国际大厦A座1704-241号”，上述住所变更已办理完毕工商变更登记。

天弘基金管理有限公司
二〇一六年三月三十日