

**天弘同利债券型证券投资基金（LOF）
（原天弘同利分级债券型证券投资基金转型）**

2016年年度报告摘要

2016年12月31日

基金管理人：天弘基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

送出日期：2017年03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。

基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2017年3月24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。

根据《天弘同利分级债券型证券投资基金基金合同》（以下简称“基金合同”）的约定，《基金合同》生效后3年期届满，无需召开基金份额持有人大会，自动转换为上市开放式基金，2016年9月20日天弘同利分级债券型证券投资基金正式更名为“天弘同利债券型证券投资基金（LOF）”。

原天弘同利分级债券型证券投资基金本报告期自2016年1月1日至2016年9月19日止，天弘同利债券型证券投资基金（LOF）本报告期自2016年9月20日至2016年12月31日止。

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

2.1.1 天弘同利债券型证券投资基金（LOF）（转型后）	
基金简称	天弘同利债券（LOF）
场内简称	天弘同利
基金主代码	164210
基金运作方式	契约型开放式
基金转型日	2016年09月19日
基金管理人	天弘基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	628,587,110.53份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2016年09月30日
2.1.2 天弘同利分级债券型证券投资基金（转型前）	
基金简称	天弘同利分级债券
场内简称	天弘同利
基金主代码	164210
基金运作方式	契约型证券投资基金，本基金《基金合同》生效之日起3年内，同利A自《基金合同》生效之日起每满一年开放一次，同利B封闭运作并上市交易；本基金《基金合同》生效后3年期届满，本基金转换为上市开放式基金（LOF）。
基金合同生效日	2013年09月17日
基金管理人	天弘基金管理有限公司
基金托管人	中国工商银行股份有限公司
报告期末基金份额总额	403,572,740.97份
基金合同存续期	不定期
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所
上市日期	2013年10月30日

下属分级基金的基金简称	同利A	同利B
下属分级基金场内简称	-	同利B
下属分级基金的交易代码	164211	150147
报告期末下属分级基金的份额总额	22,709,648.03份	380,863,092.94份

注：《基金合同》生效之日起3年内，在深圳证券交易所上市交易并封闭运作的基金份额简称为同利B。

2.2 基金产品说明

2.2.1 天弘同利债券型证券投资基金（LOF）（转型后）	
投资目标	本基金在有效控制风险的基础上，力求获得稳健的投资收益。
投资策略	本基金通过对宏观经济、利率走势、资金供求、信用风险状况、证券市场走势等方面的分析和预测，采取自上而下和自下而上相结合的投资策略，构建和调整固定收益证券投资组合，力求获得稳健的投资收益。
业绩比较基准	中债综合指数
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中较低风险的基金品种，其风险收益预期高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。
2.2.2 天弘同利分级债券型证券投资基金（转型前）	
投资目标	本基金在有效控制风险的基础上，力求获得稳健的投资收益。
投资策略	本基金通过对宏观经济、利率走势、资金供求、信用风险状况、证券市场走势等方面的分析和预测，采取自上而下和自下而上相结合的投资策略，构建和调整固定收益证券投资组合，力求获得稳健的投资收益。
业绩比较基准	中债综合指数
风险收益特征	本基金为债券型基金，属于证券投资基金中较低风险的基金品种，其风险收益预期高于货币市场基金，低于混合型基金和股票型基金。本基金在分级基金运作期内，本基金经过基金份额分级后，同利A为低风险、收益相对稳定的基金份额；同利B为较高风险、较高

	收益的基金份额。	
下属分级基金的风险收益特征	低风险、收益相对稳定	较高风险、较高收益

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（转型后）	天弘基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
名称（转型前）	天弘基金管理有限公司	中国工商银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	童建林
	联系电话	022-83310208
	电子邮箱	service@thfund.com.cn
客户服务电话	4007109999	95588
传真	022-83865569	010-66105798

2.4 信息披露方式

登载基金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

§ 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（转型后）

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2016年09月20日-2016年12月31日
本期已实现收益	12,330,692.20
本期利润	-8,065,264.18
加权平均基金份额本期利润	-0.0109
本期基金份额净值增长率	-0.60%
3.1.2 期末数据和指标	2016年末

期末可供分配基金份额利润	0.2908
期末基金资产净值	625,054,480.62
期末基金份额净值	0.994

注：1、所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如，开放式基金的申购赎回费等），计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

2、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益。

3.2 主要会计数据和财务指标（转型前）

天弘同利分级债券

金额单位：人民币元

3.2.1 期间数据和指标	2016年01月01日 -2016年09月19日	2015年	2014年
本期已实现收益	29,770,622.16	49,510,524.02	39,238,436.91
本期利润	20,631,384.35	68,354,951.04	66,857,127.16
加权平均基金份额本期利润	0.0701	0.1780	0.1092
本期基金份额净值增长率	8.09%	24.60%	14.21%
3.2.2 期末数据和指标	2016年09月19日	2015年末	2014年末
期末可供分配基金份额利润	0.2675	0.2716	0.0902
期末基金资产净值	403,572,743.24	401,186,387.46	466,572,980.28
期末基金份额净值	1.000	1.363	1.111

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。

3.3 基金净值表现(天弘同利债券型证券投资基金（LOF）)

3.3.1 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（转型后）

阶段 (天弘同利债券(LOF))	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	①-③	②-④

				④		
过去三个月（2016年10月1日-2016年12月31日）	-0.90%	0.11%	-2.32%	0.15%	1.42%	-0.04%
自基金合同转型日起至至今（2016年09月20日-2016年12月31日）	-0.60%	0.11%	-2.20%	0.14%	1.60%	-0.03%

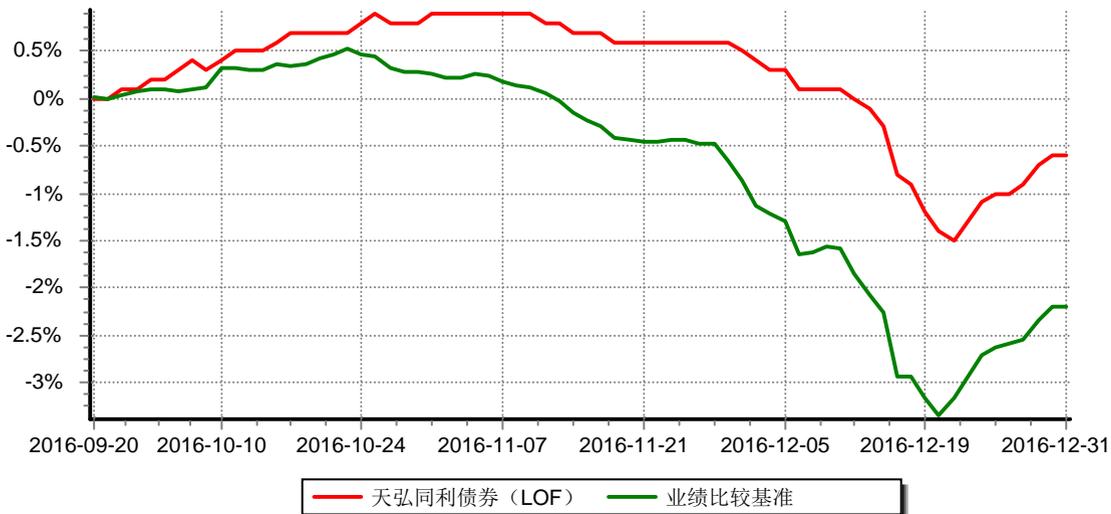
注：1、业绩比较基准：中债综合指数。中债综合指数由中央国债登记结算有限责任公司编制并发布，该指数样本具有广泛的市场代表性，涵盖主要交易市场（银行间市场、交易所市场等）、不同发行主体（政府、企业等）和期限（长期、中期、短期等），是中国目前最权威，应用也最广的指数。中债综合指数的构成品种完全覆盖了本基金的投资范围，反映债券全市场的整体价格和投资回报情况，适合作为本基金的业绩比较基准。

2、本基金合同于2013年9月17日生效，本基金于2016年9月19日三年封闭期届满，封闭期届满后本基金自动转换为上市开放式基金（LOF），基金名称变更为“天弘同利债券型证券投资基金（LOF）”，封闭期届满日为本基金份额转换基准日，自本基金转型以来至披露时点不满一年。

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。

3.3.2 自基金转型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（转型后）

天弘同利债券型证券投资基金（LOF）
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2016年09月20日-2016年12月31日)

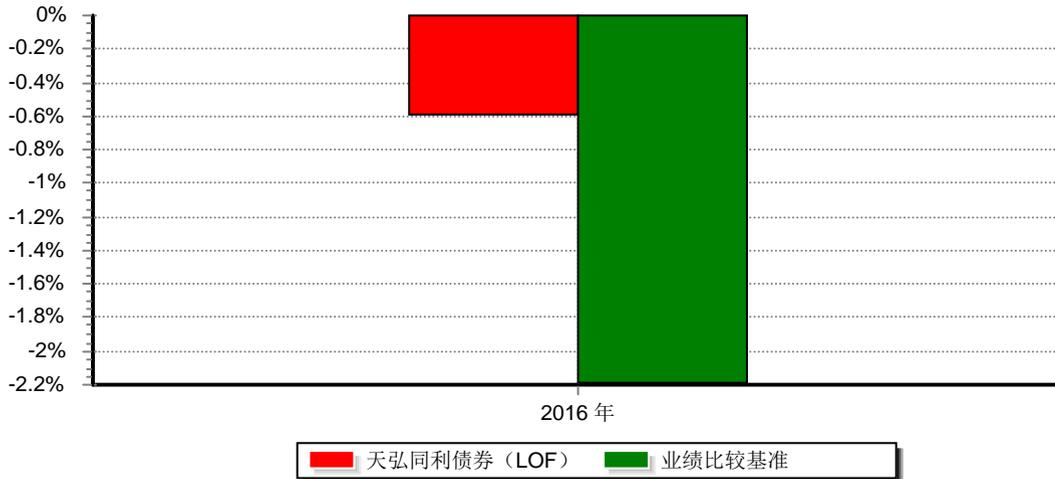


注：1、本基金合同于2013年9月17日生效，本基金于2016年9月19日封闭期届满，封闭期届满后本基

金自动转换为上市开放式基金（LOF），基金名称变更为“天弘同利债券型证券投资基金（LOF）”，封闭期届满日为本基金份额转换基准日，自本基金转型起至披露时点不满一年。

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。

3.3.3 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（转型后）



注：本基金合同于2013年9月17日生效，本基金于2016年9月17日五年封闭期届满，封闭期届满后本基金自动转换为上市开放式基金（LOF）。

3.4 基金净值表现(天弘同利分级债券型证券投资基金)

3.4.1 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（转型前）

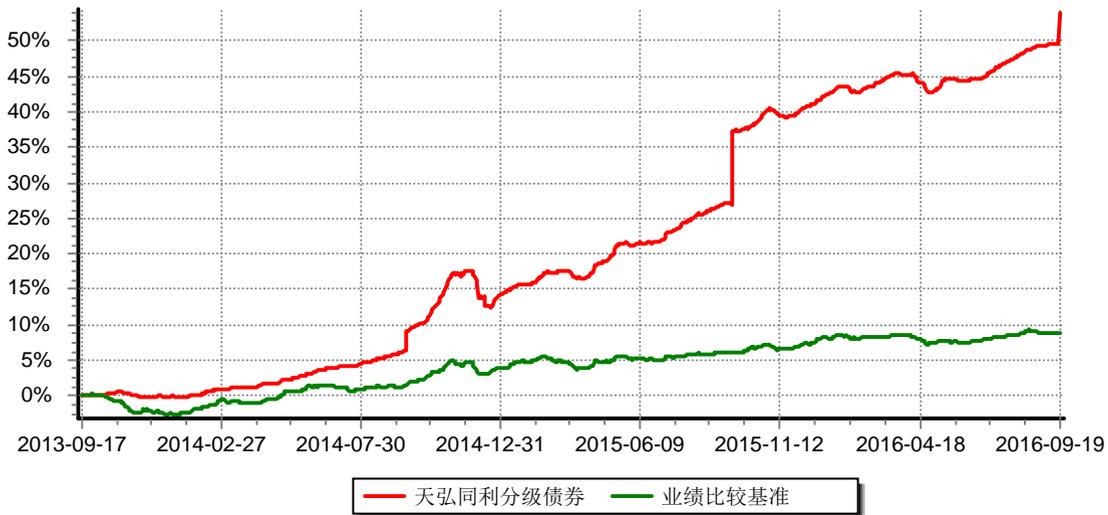
阶段 (天弘同利分级债券)	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月（2016年7月1日-2016年9月19日）	6.07%	0.38%	0.80%	0.05%	5.27%	0.33%
过去六个月（2016年7月1日-2016年9月19日）	6.07%	0.38%	0.80%	0.05%	5.27%	0.33%
过去一年（2016年1月	8.09%	0.23%	0.58%	0.06%	7.51%	0.17%

1日-2016年9月19日)						
过去三年（2014年1月1日-2016年9月19日）	53.81%	0.37%	11.65%	0.09%	42.16%	0.28%
自基金合同生效日起至今（2013年9月17日-2016年9月19日）	53.96%	0.36%	8.81%	0.09%	45.15%	0.27%

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

3.4.2 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（转型前）

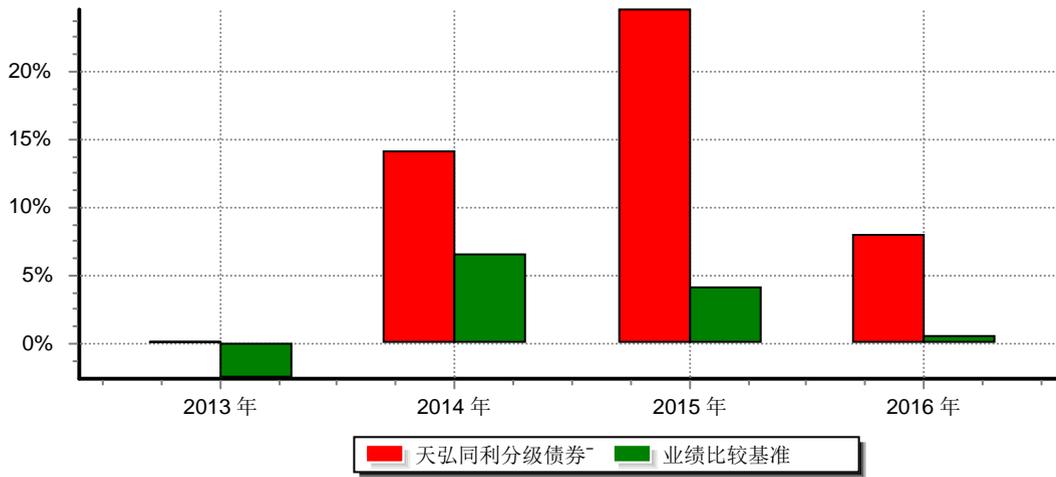
天弘同利分级债券型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率历史走势对比图
(2013年09月17日-2016年09月19日)



注：1、本基金合同于2013年9月17日生效，本基金于2016年9月19日封闭期届满，封闭期届满后本基金自动转换为上市开放式基金（LOF），基金名称变更为“天弘同利债券型证券投资基金（LOF）”，封闭期届满日为本基金份额转换基准日，自本基金转型起至披露时点不满一年。

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。

3.4.3 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（转型前）



注：本基金合同于2013年9月17日生效。基金合同生效当年2010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。

3.5 过去三年基金的利润分配情况

3.5.1 天弘同利债券型证券投资基金（LOF）（转型后）

本基金转型后未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

3.5.2 天弘同利分级债券型证券投资基金（转型前）

本基金过去三年未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

§ 4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

天弘基金管理有限公司（以下简称“公司”或“本基金管理人”）经中国证监会证监基金字[2004]164号文批准，于2004年11月8日正式成立。注册资本金为5.143亿元人民币，总部设在天津，在北京、上海、广州、天津设有分公司。公司股权结构为：

股东名称	股权比例
浙江蚂蚁小微金融服务集团股份有限公司	51%
天津信托有限责任公司	16.8%
内蒙古君正能源化工集团股份有限公司	15.6%

芜湖高新投资有限公司	5.6%
新疆天瑞博丰股权投资合伙企业（有限合伙）	3.5%
新疆天惠新盟股权投资合伙企业（有限合伙）	2%
新疆天阜恒基股权投资合伙企业（有限合伙）	2%
新疆天聚宸兴股权投资合伙企业（有限合伙）	3.5%
合计	100%

截至2016年12月31日，本基金管理人共管理53只基金：天弘精选混合型证券投资基金、天弘永利债券型证券投资基金、天弘永定价值成长混合型证券投资基金、天弘周期策略混合型证券投资基金、天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金、天弘添利债券型证券投资基金（LOF）、天弘丰利债券型证券投资基金（LOF）、天弘现金管家货币市场基金、天弘债券型发起式证券投资基金、天弘安康养老混合型证券投资基金、天弘余额宝货币市场基金、天弘稳利定期开放债券型证券投资基金、天弘弘利债券型证券投资基金、天弘通利混合型证券投资基金、天弘同利债券型证券投资基金（LOF）、天弘瑞利分级债券型证券投资基金、天弘沪深300指数型发起式证券投资基金、天弘中证500指数型发起式证券投资基金、天弘增益宝货币市场基金、天弘云端生活优选灵活配置混合型证券投资基金、天弘新活力灵活配置混合型发起式证券投资基金、天弘普惠养老保本混合型证券投资基金、天弘互联网灵活配置混合型证券投资基金、天弘惠利灵活配置混合型证券投资基金、天弘新价值灵活配置混合型证券投资基金、天弘云商宝货币市场基金、天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金、天弘中证医药100指数型发起式证券投资基金、天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金、天弘中证全指运输指数型发起式证券投资基金、天弘中证移动互联网指数型发起式证券投资基金、天弘中证证券保险指数型发起式证券投资基金、天弘中证银行指数型发起式证券投资基金、天弘创业板指数型发起式证券投资基金、天弘中证高端装备制造指数型发起式证券投资基金、天弘上证50指数型发起式证券投资基金、天弘中证100指数型发起式证券投资基金、天弘中证800指数型发起式证券投资基金、天弘中证环保产业指数型发起式证券投资基金、天弘中证电子指数型发起式证券投资基金、天弘中证休闲娱乐指数型发起式证券投资基金、天弘中证计算机指数型发起式证券投资基金、天弘中证食品饮料指数型发起式证券投资基金、天弘弘运宝货币市场基金、天弘鑫安宝保本混合型证券投资基金、天弘裕利灵活配置混合型证券投资基金、天弘乐享保本混合型证券投资基金、天弘价值精选灵活配置混合型发起式证券投资基金、天弘安盈灵活配置混合型证券投资基金、天弘喜利灵活配置混合型证券投资基金、天弘信利债券型证券投资基金、天弘聚利灵活配置混合型证券投资基金、天弘金利灵活配置混合型证券投资基金。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		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、固定收益总监兼固定收益部总经理。	2013年09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。

注：1、上述任职日期是基金合同生效日。

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。全年央行仅于二月末降准一次，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，积极根据市场情况变化调整组合配置情况，整体维持稳健的操作风格，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12月31日（2016年9月20日至2016年12月31日），本基金的基金份额净值为0.994元，本报告期份额净值增长率为-0.60%，同期业绩比较基准增长率为-2.20%。截至2016年9月19日（2016年1月1日至2016年9月19日），本基金的基金份额净值为1.000元，本报告期份额净值增长率为8.09%，同期业绩比较基准增长率为0.58%。

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，本基金将继续维持适度的组合久期和组合杠杆，在防范风险的前提下，为持有人创造稳健高回报，同时，将根据市场形势变化及时调整组合投资策略，适度参与波段性操作机会，在获取票息、杠杆收益的同时，获取一定资本利得，增厚组合收益。

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估值业务的高级管理人员、督察长、投资总监、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同利债券型证券投资基金（LOF）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合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，天弘同利债券型证券投资基金（LOF）的管理人——天弘基金管理有限公司在天弘同利债券型证券投资基金（LOF）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，天弘同利债券型证券投资基金（LOF）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同利债券型证券投资基金（LOF）2016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(天弘同利债券型证券投资基金（LOF）)

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 审计报告(天弘同利分级债券型证券投资基金)

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。

§ 8 年度财务报表(天弘同利债券型证券投资基金（LOF）)

转型后：

报告期（2016年09月20日-2016年12月31日）

8.1 资产负债表（转型后）

会计主体：天弘同利债券型证券投资基金（LOF）

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
资 产：		

银行存款		5,704,047.74
结算备付金		—
存出保证金		4,888.86
交易性金融资产		822,306,117.70
其中：股票投资		—
基金投资		—
债券投资		822,306,117.70
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		—
应收证券清算款		3,959,362.75
应收利息		17,790,306.39
应收股利		—
应收申购款		3,062,867.07
递延所得税资产		—
其他资产		—
资产总计		852,827,590.51
负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年12月31日
负 债：		
短期借款		—
交易性金融负债		—
衍生金融负债		—
卖出回购金融资产款		225,599,590.00
应付证券清算款		—
应付赎回款		921,587.74
应付管理人报酬		448,435.69
应付托管费		128,124.48

应付销售服务费		224,217.87
应付交易费用		10,617.22
应交税费		—
应付利息		71,269.28
应付利润		—
递延所得税负债		—
其他负债		369,267.61
负债合计		227,773,109.89
所有者权益：		
实收基金		427,653,638.26
未分配利润		197,400,842.36
所有者权益合计		625,054,480.62
负债和所有者权益总计		852,827,590.51

注：1、报告截止日2016年12月31日，基金份额净值0.994元，基金份额总额628,587,110.53份。

2、本财务报表的实际编制期间为2016年9月20日(转型后首日)至2016年12月31日。

8.2 利润表（转型后）

会计主体：天弘同利债券型证券投资基金（LOF）

本报告期：2016年09月20日（基金合同转型日）至2016年12月31日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016年09月20日（基金合同转型日）至 2016年12月31日
一、收入		-4,478,861.87
1.利息收入		12,336,826.88
其中：存款利息收入		129,331.77
债券利息收入		12,101,090.61
资产支持证券利息收入		—
买入返售金融资产收入		106,404.50

其他利息收入		—
2.投资收益(损失以“-”填列)		3,545,174.87
其中：股票投资收益		—
基金投资收益		—
债券投资收益		3,545,174.87
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		—
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）		-20,395,956.38
4.汇兑收益（损失以“-”号填列）		—
5.其他收入（损失以“-”号填列）		35,092.76
减：二、费用		3,586,402.31
1. 管理人报酬	8.4.8.2.1	1,424,121.50
2. 托管费	8.4.8.2.2	406,891.87
3. 销售服务费	8.4.8.2.3	712,060.80
4. 交易费用		7,751.51
5. 利息支出		897,367.66
其中：卖出回购金融资产支出		897,367.66
6. 其他费用		138,208.97
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		-8,065,264.18
减：所得税费用		—

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		-8,065,264.18
-------------------	--	---------------

8.3 所有者权益（基金净值）变动表（转型后）

会计主体：天弘同利债券型证券投资基金（LOF）

本报告期：2016年09月20日（基金合同转型日）至2016年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2016年09月20日（基金合同转型日）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）	274,553,748.78	129,018,994.46	403,572,743.24
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	-8,065,264.18	-8,065,264.18
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）	153,099,889.48	76,447,112.08	229,547,001.56
其中：1.基金申购款	511,742,603.04	245,492,124.98	757,234,728.02
2.基金赎回款	-358,642,713.56	-169,045,012.90	-527,687,726.46
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）	427,653,638.26	197,400,842.36	625,054,480.62

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告8.1至8.4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

8.4 报表附注(转型后)

8.4.1 基金基本情况

天弘同利债券型证券投资基金(LOF)(原天弘同利分级债券型证券投资基金)(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[2013]245号《关于核准天弘同利分级债券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《天弘同利分级债券型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集688,570,594.91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(2013)第610号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,基金合同于2013年9月17日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为688,752,427.97份基金份额,其中天弘同利分级债券型证券投资基金A级份额(以下简称“同利A”)434,308,907.72份,天弘同利分级债券型证券投资基金B级份额(以下简称“同利B”)254,443,520.25份;认购资金利息折合181,833.06份基金份额,其中同利A为79,312.81份,同利B为102,520.25份。募集结束时,同利A与同利B的份额配比为1.70689710:1。本基金的基金管理人为天弘基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

自《天弘同利分级债券型证券投资基金基金合同》生效后3年期届满后,原天弘同利分级债券型证券投资基金基金转换为上市开放式基金(LOF),不再进行基金份额分级,同利A和同利B的基金份额以各自的基金份额净值为基准转换为上市开放式基金(LOF)份额,并办理基金的申购与赎回业务。

根据《天弘同利分级债券型证券投资基金基金合同》,原天弘同利分级债券型证券投资基金的分级运作期于2016年9月19日届满。原天弘同利分级债券型证券投资基金转换为本基金后,《天弘同利分级债券型证券投资基金基金合同》继续有效。经深圳证券交易所《终止上市通知书》(深证上[2016]607号)同意,同利B于2016年9月19日终止上市。

本基金的转换基准日为2016年9月19日,在转换基准日,同利A和同利B的基金份额以各自的基金份额净值为基准转换为上市开放式基金(LOF)后的基金份额总额为403,572,740.97份,其中同利A根据1:1.00032787的转换比例转换成的基金份额为22,709,648.03份,同利B根据1:1.49684729的转换比例转换成的基金份额为380,863,092.94份。自2016年9月20日起,原天弘同利分级债券型证券投资基金的基金名称变更为天弘同利债券型证券投资基金(LOF)。

经深交所深证上[2016]第659号文审核同意,本基金5,963,578.00份基金份额于2016

年9月30日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外，基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘同利分级债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资对象是具有良好流动性的金融工具，主要投资于国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、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、银行存款等固定收益证券品种。本基金对债券等固定收益类证券品种的投资比例不低于基金资产的80%，持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金业绩比较基准：中债综合指数。本基金转换为上市开放式基金(LOF)后，本基金的投资目标、投资策略、投资理念、投资范围、投资限制、投资管理程序等保持不变。

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。

8.4.2 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》、《天弘同利分级债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注8.4.4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。

8.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2016年9月20日(转型后首日)至2016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2016年12月31日的财务状况以及2016年9月20日(转型后首日)至2016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。

8.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表相一致。

8.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

8.4.6 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，包括买卖债券的差价收入，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。

(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。

8.4.7 关联方关系

股东名称	股权比例
天弘基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金管理人、基金销售机构
浙江蚂蚁小微金融服务集团股份有限公司	基金管理人的股东
天津信托有限责任公司	基金管理人的股东
内蒙古君正能源化工集团股份有限公司	基金管理人的股东
芜湖高新投资有限公司	基金管理人的股东
新疆天瑞博丰股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
新疆天惠新盟股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东

新疆天阜恒基股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
新疆天聚宸兴股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
天弘创新资产管理有限公司(“天弘创新”)	基金管理人的全资子公司

注：1、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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

8.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

8.4.8.1 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。

8.4.8.2 关联方报酬

8.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年09月20日（基金合同转型日）至2016年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,424,121.50
其中：支付销售机构的客户维护费	33,992.80

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0.70%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： $\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.70\% / \text{当年天数}$ 。

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。

8.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2016年09月20日（基金合同转型日）至2016年12月31日
----	--

当期发生的基金应支付的托管费	406,891.87
----------------	------------

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费=前一日基金资产净值X0.20%/当年天数。

8.4.8.2.3 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09月20日（基金合同转型日）至2016年12月31日
天弘基金管理有限公司	524,277.06
中国工商银行	34,686.67
合计	558,963.73

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值0.35%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X0.35%/当年天数。

8.4.8.3 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。

8.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

8.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

报告期内无基金管理人运用固有资本投资本基金的情况。

8.4.8.4.2 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

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。

8.4.8.5 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09月20日（基金合同转型日）至2016年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国工商银行	5,704,047.74	93,490.62

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

8.4.8.6 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。

8.4.8.7 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。

8.4.9 期末（2016年12月31日）本基金持有的流通受限证券

8.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

8.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

8.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

8.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2016年12月31日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额139,999,590.00元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
1280103	12统众债	2017-01-05	107.70	300,000	32,310,000.00
1480286	14铜陵示范园债	2017-01-05	106.11	300,000	31,833,000.00
1480320	14新余城东债	2017-01-05	107.28	300,000	32,184,000.00
1480316	14一师新鑫债	2017-01-05	107.07	300,000	32,121,000.00
1382035	13澄星MTN1	2017-01-05	102.01	200,000	20,402,000.00
合计				1,400,000	148,850,000.00

8.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2016年12月31日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额85,600,000.00元，于2017年1月3日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

8.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1)公允价值

(a)金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b)持续的以公允价值计量的金融工具

(i)各层次金融工具公允价值

于2016年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为208,363.00元，属于第二层次的余额为822,097,754.70元，无属于第三层次的余额。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

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

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于2016年12月31日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产。

(d)不以公允价值计量的金融工具

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

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 9 年度财务报表(天弘同利分级债券型证券投资基金)

转型前:

报告期（2016年01月01日-2016年09月19日）

9.1 资产负债表（转型前）

会计主体：天弘同利分级债券型证券投资基金

报告截止日：2016年09月19日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2016年09月19日	上年度末 2015年12月31日
资产：			
银行存款		884,381.59	78,295.42
结算备付金		15,109,936.56	23,560,067.30
存出保证金		2,404.44	2,992.51
交易性金融资产		566,870,070.40	696,792,834.60
其中：股票投资		—	—
基金投资		—	—
债券投资		566,870,070.40	696,792,834.60
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		—	—
应收证券清算款		—	456,900.69
应收利息		15,373,141.25	16,453,066.90
应收股利		—	—
应收申购款		—	—
递延所得税资产		—	—
其他资产		1,851.37	—
资产总计		598,241,785.61	737,344,157.42

负债和所有者权益	附注号	本期末 2016年09月19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		174,999,779.00	335,199,635.00
应付证券清算款		868,623.74	—
应付赎回款		18,245,028.57	—
应付管理人报酬		153,110.89	236,079.70
应付托管费		43,745.98	67,451.32
应付销售服务费		76,555.45	118,039.87
应付交易费用		12,722.76	11,826.36
应交税费		—	—
应付利息		2,867.58	55,737.71
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债		266,608.40	469,000.00
负债合计		194,669,042.37	336,157,769.96
所有者权益:			
实收基金		274,553,748.78	290,715,689.57
未分配利润		129,018,994.46	110,470,697.89
所有者权益合计		403,572,743.24	401,186,387.46
负债和所有者权益总计		598,241,785.61	737,344,157.42

注：1、报告截止日2016年9月19日(分级运作期届满日)，天弘同利分级债券型证券投资基金的份额净值1.000元，天弘同利分级债券型证券投资基金A基金份额参考净值1.000元，天弘同利分级债券型证券投资基金B基金份额参考净值1.000元；基金份额总额403,572,740.97份，其中天弘同利分级债券型证券投资基金A基金份额22,709,648.03份，天弘同利分级债券型证券投资基金B基金份额380,863,092.94份。

2、本财务报表的实际编制期间为2016年1月1日至2016年9月19日。

9.2 利润表（转型前）

会计主体：天弘同利分级债券型证券投资基金

本报告期：2016年01月01日至2016年09月19日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2016年01月01日至 2016年09月19日	上年度可比期间 2015年01月01日至 2015年12月31日
一、收入		28,833,806.42	83,711,221.27
1.利息收入		30,230,963.56	53,652,637.03
其中：存款利息收入		215,107.41	350,993.25
债券利息收入		30,015,638.65	53,301,643.78
资产支持证券利息收入		—	—
买入返售金融资产收入		217.50	—
其他利息收入		—	—
2.投资收益(损失以“-”填列)		7,742,080.67	11,214,157.22
其中：股票投资收益		—	—
基金投资收益		—	—
债券投资收益		7,742,080.67	11,214,157.22
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		—	—
3.公允价值变动收益(损失以“-”号填列)		-9,139,237.81	18,844,427.02
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		8,202,422.07	15,356,270.23
1. 管理人报酬	9.4.8.2.1	2,057,666.07	3,237,128.05
2. 托管费	9.4.8.2.2	587,904.63	924,893.72
3. 销售服务费	9.4.8.2.3	1,028,833.12	1,618,564.14
4. 交易费用		2,805.86	2,799.86
5. 利息支出		4,193,453.70	9,111,730.76
其中：卖出回购金融资产支出		4,193,453.70	9,111,730.76
6. 其他费用		331,758.69	461,153.70
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		20,631,384.35	68,354,951.04
减：所得税费用		—	—
四、净利润（净亏损以“-”号填列）		20,631,384.35	68,354,951.04

9.3 所有者权益（基金净值）变动表（转型前）

会计主体：天弘同利分级债券型证券投资基金

本报告期：2016年01月01日至2016年09月19日

单位：人民币元

项目	本期 2016年01月01日至2016年09月19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）	290,715,689.57	110,470,697.89	401,186,387.46
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	20,631,384.35	20,631,384.35
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）	-16,161,940.79	-2,083,087.78	-18,245,028.57
其中：1.基金申购款	—	—	—
2.基金赎回款	-16,161,940.79	-2,083,087.78	-18,245,028.57

		78	
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）	274,553,748.78	129,018,994.46	403,572,743.24
项 目	上年度可比期间 2015年01月01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）	412,486,659.72	54,086,320.56	466,572,980.28
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	68,354,951.04	68,354,951.04
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）	-121,770,970.15	-11,970,573.71	-133,741,543.86
其中：1.基金申购款	600,926.52	59,073.48	660,000.00
2.基金赎回款	-122,371,896.67	-12,029,647.19	-134,401,543.86
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）	290,715,689.57	110,470,697.89	401,186,387.46

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告9.1至9.4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

9.4 报表附注（转型前）

9.4.1 基金基本情况

天弘同利分级债券型证券投资基金(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[2013]245号《关于核准天弘同利分级债券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《天弘同利分级债券型证券投资基金基金合同》(以下简称“基金合同”)负责公开募集。本基金为契约型开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集688,570,594.91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(2013)第610号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,基金合同于2013年9月17日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为688,752,427.97份基金份额,其中天弘同利分级债券型证券投资基金A级份额(以下简称“同利A”)434,308,907.72份,天弘同利分级债券型证券投资基金B级份额(以下简称“同利B”)254,443,520.25份;认购资金利息折合181,833.06份基金份额,其中同利A为79,312.81份,同利B为102,520.25份。募集结束时,同利A与同利B的份额配比为1.70689710:1。本基金的基金管理人为天弘基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。

根据基金合同和《天弘同利分级债券型证券投资基金招募说明书》(以下简称“招募说明书”)的有关规定,自基金合同生效之日起3年内,同利A每满1年开放一次,同利B封闭运作并上市交易。在同利A的每次开放日,基金管理人将对同利A进行基金份额折算,同利A的基金份额净值调整为1.000元,基金份额持有人持有的同利A份额数按折算比例相应增减。自基金合同生效之日起3年内,同利A的份额余额原则上不得超过7/3倍同利B的份额余额。同利B封闭运作,封闭期为基金合同生效之日起至3年后对应日止,封闭期内不接受申购与赎回。本基金在扣除同利A的应计收益后的全部剩余收益归同利B享有,亏损以同利B的资产净值为限由同利B承担。同利A根据基金合同的规定获取约定收益,其收益率将在每个开放日设定一次并公告,计算公式为:同利A的年收益率(单利)= 1.6×1 年期银行定期存款利率,年收益率计算按照四舍五入的方法保留到小数点后第2位。自基金合同生效之日起,基金管理人将根据届时中国人民银行公布并执行的金融机构人民币1年期银行定期存款基准利率设定同利A的首次年收益率;在同利A的每个开放日,基金管理人将根据该日中国人民银行公布并执行的金融机构人民币1年期银行定期存款基准利率重新设定同利A的年收益率。

基金合同生效后,在同利A的开放日计算同利A的基金份额净值,在同利B的封闭期届满日分别计算同利A和同利B的基金份额净值;基金管理人在计算基金资产净值的基础上,采用“虚拟清算”原则分别计算并公告同利A和同利B的基金份额参考净值,其中,同利A的基金份额参考净值计算日不包括同利A的开放日。自基金合同生效后3年期届满,本基金转换为上市开放式基金(LOF),本基金将不再进行基金份额分级,同利A和同

利B的基金份额将以各自的基金份额净值为基准转换为上市开放式基金(LOF)份额,并办理基金的申购与赎回业务。

经深圳证券交易所(以下简称“深交所”)深证上字[2013]第369号文审核同意,本基金同利B 701,035.00份基金份额于2013年10月30日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外,基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《天弘同利分级债券型证券投资基金之同利B终止上市的公告》,本基金同利B于2016年9月14日进行终止上市权利登记,2016年9月19日终止上市。

根据《天弘同利分级债券型证券投资基金基金合同》以及《天弘同利分级债券型证券投资基金三年期届满转型后基金名称变更与转换基准日等事项的公告》,本基金自基金合同生效后3年期届满时自动转换为上市开放式基金(LOF),名称变更为“天弘同利债券型证券投资基金(LOF)”(以下简称“同利LOF”)。本基金的转换基准日为2016年9月19日,在转换基准日,同利A、同利B的基金份额将以各自的基金份额净值为基准转换为同利LOF份额,本基金的基金管理人将进行注册登记变更、账户更名等操作。本基金转换成上市开放式基金(LOF)后的基金份额净值调整为1.000元。本基金转换完成后,《天弘同利分级债券型证券投资基金基金合同》中除仅适用于本基金的条款外,继续适用于转换后的同利LOF。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《天弘同利分级债券型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资对象是具有良好流动性的金融工具,主要投资于国内依法发行上市的国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、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、银行存款以及法律、法规或监管机构允许基金投资的其它固定收益类金融工具及其衍生工具。本基金对债券等固定收益类证券品种的投资比例不低于基金资产的80%,持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金业绩比较基准:中债综合指数。

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。

9.4.2 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》、

《天弘同利分级债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注9.4.4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。

经中国证监会批准并经深交所同意，基金管理人天弘基金管理有限公司将本基金于分级运作期届满日转型为同利LOF并相应延长存续期至不定期，因此本基金财务报表仍以持续经营假设为编制基础。

9.4.3 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9月19日(分级运作期届满日)的财务状况以及2016年1月1日至2016年9月19日(分级运作期届满日)止期间的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

9.4.4 本报告期所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度报告相一致的说明

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策、会计估计与最近一期年度会计报表相一致。

9.4.5 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

9.4.6 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，包括买卖债券的差价收入，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。

(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。

9.4.7 关联方关系

股东名称	股权比例
天弘基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国工商银行股份有限公司(“中国工商银行”)	基金管理人、基金销售机构
浙江蚂蚁小微金融服务集团股份有限公司	基金管理人的股东
天津信托有限责任公司	基金管理人的股东
内蒙古君正能源化工集团股份有限公司	基金管理人的股东
芜湖高新投资有限公司	基金管理人的股东
新疆天瑞博丰股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
新疆天惠新盟股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
新疆天阜恒基股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
新疆天聚宸兴股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
天弘创新资产管理有限公司(“天弘创新”)	基金管理人的全资子公司

注：1、下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

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

9.4.8 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

9.4.8.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

9.4.8.2 关联方报酬

9.4.8.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2016年01月01日至2016年09 月19日	上年度可比期间 2015年01月01日至2015年12 月31日
当期发生的基金应支付的管理费	2,057,666.07	3,237,128.05
其中：支付销售机构	33,164.27	437,552.75

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： $\text{日管理人报酬} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.70\% / \text{当年天数}$ 。

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。

9.4.8.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期	上年度可比期间
	2016年01月01日至2016年09月19日	2015年01月01日至2015年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	587,904.63	924,893.72

注：支付基金托管人中国工商银行的托管费按前一日基金资产净值0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为： $\text{日托管费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.20\% / \text{当年天数}$ 。

9.4.8.2.3 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01月01日至2016年09月19日		
	同利A	同利B	合计
天弘基金管理有限公司	358.83	911,265.65	911,624.48
中国工商银行	33,266.98	574.31	33,841.29
合计	33,625.81	911,839.96	945,465.77
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间2015年01月01日至2015年12月31日		
	同利A	同利B	合计
天弘基金管理有限公司	6,555.72	1,142,954.08	1,149,509.80
中国工商银行	135,978.27	3,220.36	139,198.63

合计	142,533.99	1,146,174.44	1,288,708.43
----	------------	--------------	--------------

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值0.35%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： $\text{日销售服务费} = \text{前一日基金资产净值} \times 0.35\% / \text{当年天数}$ 。

9.4.8.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本报告期及上年度可比期间未与关联方进行过银行间同业市场的债券(含回购)交易。

9.4.8.4 各关联方投资本基金的情况

9.4.8.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

本基金本报告期及上年度可比期间无基金管理人运用固有资金投资本基金的情况。

9.4.8.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

9.4.8.5 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01月01日至2016年09月19日		上年度可比期间 2015年01月01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
中国工商银行	884,381.59	6,320.15	78,295.42	18,446.17

注：本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行保管，按银行同业利率计息。

9.4.8.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券交易。

9.4.8.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

9.4.9 期末（2016年09月19日）本基金持有的流通受限证券

9.4.9.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

9.4.9.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限的股票。

9.4.9.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

9.4.9.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2016年9月19日止，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额41,999,779.00元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
1280103	12统众债	2016-09-20	112.82	300,000	33,846,000.00
1480285	14萧山经开债	2016-09-20	109.37	120,000	13,124,400.00
合计				420,000	46,970,400.00

9.4.9.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2016年9月19日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额133,000,000.00元，于2016年9月20日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

9.4.10 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a) 金融工具公允价值计量的方法

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

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2016年9月19日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层次的余额为225,856.00元，属于第二层次的余额为566,644,214.40元，无

属于第三层次的余额(2015年12月31日：第一层次的余额为1,210,607.10元，第二层次的余额为695,582,227.50元，无第三层次)。

(ii)公允价值所属层次间的重大变动

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

(iii)第三层次公允价值余额和本期变动金额

无。

(c)非持续的以公允价值计量的金融工具

于2016年9月19日，本基金未持有非持续的以公允价值计量的金融资产(2015年12月31日：同)。

(d)不以公允价值计量的金融工具

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

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

§ 10 投资组合报告(天弘同利债券型证券投资基金（LOF）)

转型后：

报告期（2016年09月20日-2016年12月31日）

10.1 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	822,306,117.70	96.42
	其中：债券	822,306,117.70	96.42
	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	5,704,047.74	0.67
7	其他各项资产	24,817,425.07	2.91
8	合计	852,827,590.51	100.00

10.2 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。

10.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

10.4 报告期内股票投资组合的重大变动

10.4.1 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

本基金本报告期末未有买入股票。

10.4.2 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

本基金本报告期末未有卖出股票。

10.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期未有买入及卖出股票。

10.5 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	19,472,000.00	3.12
2	央行票据	—	—
3	金融债券	50,170,000.00	8.03
	其中：政策性金融债	50,170,000.00	8.03
4	企业债券	649,445,955.60	103.90
5	企业短期融资券	40,064,000.00	6.41
6	中期票据	60,986,000.00	9.76
7	可转债	2,168,162.10	0.35
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	822,306,117.70	131.56

注：可转债项下包含可交换债1,601,633.20元。

10.6 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	124915	14宏桥02	362,000	40,210,960.00	6.43
2	011699844	16龙源电力SCP007	400,000	40,064,000.00	6.41
3	122513	12伟星集	395,000	39,808,100.00	6.37
4	122735	11六安债	377,000	39,615,160.00	6.34
5	124743	14银城投	377,000	39,592,540.00	6.33

10.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

10.8 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。

10.9 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。

10.10 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。

10.11 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。

10.12 投资组合报告附注

10.12.1 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。

10.12.2 本基金本报告期末未持有股票，故不存在所投资的前十名股票中超出基金合同规定之备选股票库的情况。

10.12.3 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	4,888.86
2	应收证券清算款	3,959,362.75
3	应收股利	—
4	应收利息	17,790,306.39
5	应收申购款	3,062,867.07
6	其他应收款	—

7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	24,817,425.07

10.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113008	电气转债	358,165.90	0.06
2	132003	15清控EB	235,296.00	0.04
3	110031	航信转债	10,858.00	0.00

10.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

10.12.6 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。

§ 11 投资组合报告(天弘同利分级债券型证券投资基金)

转型前:

报告期（2016年01月01日-2016年09月19日）

11.1 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	566,870,070.40	94.76
	其中：债券	566,870,070.40	94.76
	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	15,994,318.15	2.67
7	其他各项资产	15,377,397.06	2.57
8	合计	598,241,785.61	100.00

11.2 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。

11.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

11.4 报告期内股票投资组合的重大变动

11.4.1 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

本基金本报告期末未有买入股票。

11.4.2 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

本基金本报告期未有卖出股票。

11.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

本基金本报告期未有买入及卖出股票。

11.5 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	566,040,626.00	140.26
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	可转债	829,444.40	0.21
8	同业存单	—	—
9	其他	—	—
10	合计	566,870,070.40	140.46

注：可转债项下包含可交换债245,422.50元。

11.6 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	122735	11六安债	385,000	41,094,900.00	10.18
2	124915	14宏桥02	370,000	41,036,700.00	10.17
3	1080154	10安顺国资债01	400,000	40,744,000.00	10.10
4	122513	12伟星集	400,000	40,736,000.00	10.09

5	124743	14银城投	380,000	40,561,200.00	10.05
---	--------	-------	---------	---------------	-------

11.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

11.8 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。

11.9 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。

11.10 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。

11.11 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。

11.12 投资组合报告附注

11.12.1 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。

11.12.2 本基金本报告期末未持有股票，故不存在所投资的前十名股票中超出基金合同规定之备选股票库的情况。

11.12.3 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	2,404.44
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	15,373,141.25
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—

7	待摊费用	1,851.37
8	其他	—
9	合计	15,377,397.06

11.12.4 期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

序号	股票代码	股票名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	113008	电气转债	358,165.90	0.09
2	110031	航信转债	11,131.00	0.00

11.12.5 期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

11.12.6 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。

§ 12 基金份额持有人信息(天弘同利债券型证券投资基金（LOF）)

转型后：

报告期（2016年09月20日-2016年12月31日）

12.1 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
9,286	67,691.91	425,174,687 .65	67.64%	203,412,422 .88	32.36%

12.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	卢嘉喜	978,000.00	6.94%
2	中国对外经济贸易信托有限公司—南海成长(二期)信托计划	888,092.00	6.30%
3	李金亮	600,000.00	4.26%
4	刘富强	499,004.00	3.54%
5	朱元杰	497,122.00	3.53%
6	徐明哲	297,400.00	2.11%
7	曾灵	280,129.00	1.99%
8	胡莉莉	280,000.00	1.99%
9	杨兴中	227,500.00	1.61%
10	熊初声	223,000.00	1.58%

12.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

项目	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	1,189.18	0.00%

12.4 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。

§ 13 基金份额持有人信息(天弘同利分级债券型证券投资基金)

转型前:

报告期（2016年01月01日-2016年09月19日）

13.1 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
同利A	780	29,114.93	0	0.00%	22,709,648.03	100%
同利B	619	615,287.71	374,507,752.87	98.33%	6,355,340.07	1.67%
合计	1399	288,472.30	374,507,752.87	92.80%	29,064,988.10	7.20%

13.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	张兰芳	277,366.00	4.65%
2	孙镜媛	179,622.00	3.01%
3	宋书昌	160,163.00	2.69%
4	王钊	151,182.00	2.54%
5	张建华	149,685.00	2.51%
6	钱杜鸿	149,685.00	2.51%
7	丁佩民	127,681.00	2.14%
8	张励	119,748.00	2.01%
9	丁美明	113,760.00	1.91%
10	杨光平	108,521.00	1.82%

13.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金的情况

期末基金管理人的从业人员未持有本开放式基金。

13.4 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。

§ 14 开放式基金份额变动

14.1 开放式基金份额变动(转型后)

单位：份

项目	同利（LOF）
基金转型生效日(2016年09月19日) 基金份额总额	403,572,740.97
本报告期期间基金总申购份额	752,204,403.87
减：本报告期期间基金总赎回份额	527,190,034.31
本报告期期间基金拆分变动份额	—
本报告期期末基金份额总额	628,587,110.53

注：本基金合同于2013年9月17日生效。本基金于2016年9月19日五年封闭期届满，封闭期届满后本基金自动转换为上市开放式基金（LOF），基金名称变更为“天弘同利债券型证券投资基金（LOF）”，封闭期届满日为本基金份额转换基准日。

14.2 开放式基金份额变动(转型前)

单位：份

项目	同利A	同利B
基金合同生效日(2013年09月17日) 基金份额总额	434,308,907.72	254,443,520.25
本报告期期初基金份额总额	39,837,868.73	254,443,520.25
本报告期期间基金总申购份额	—	—
减：本报告期期间基金总赎回份额	18,245,028.57	—
本报告期期间基金拆分变动份额	1,116,807.87	126,419,572.69
本报告期期末基金份额总额	22,709,648.03	380,863,092.94

注：1、本基金合同生效日为2013年9月17日。

2、同利B在《基金合同》生效后封闭运作封闭期为3年，封闭期内不接受申购与赎回。

§ 15 重大事件揭示

15.1 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。

15.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，宁辰、张磊先生已离任本公司副总经理职务，具体信息请参见基金管

理人于2016年4月30日和2016年7月2日披露的《天弘基金管理有限公司关于高级管理人员变更的公告》。

本报告期基金托管人的专门基金托管部门无重大人事变动。

15.3 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本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

15.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略没有发生改变。

15.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内应向普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）支付服务费6万元。截至本报告期末，普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）已为本基金提供审计服务3年4个月。

15.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况

本报告期内未发现本基金管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚的情况。

15.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

15.7.1 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	
渤海证券	2	—	—	—	—	

15.7.2 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	成交金额	占债券回购	成交金额	占权证

		成交总额比 例		成交总额比 例		成交总额比 例
渤海证券	167,474, 604.40	100.00%	32,482,9 47,000.0 0	100.00%	—	—

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2个，为：中银国际证券深圳交易单元1个；国开证券上海交易单元1个。

4、本基金报告期内停止租用交易单元1个，为：民生证券深圳交易单元1个。

§ 16 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内，根据《基金合同》约定，本基金已于2016年9月19日3年期届满并转型为上市开放式基金（LOF）。转型后本基金已于2016年9月30日在深圳证券交易所挂牌交易，并于同日开放日常申购、赎回等业务。具体信息请参见基金管理人在指定媒介披露的相关公告及更新的《招募说明书》中相关内容。

天弘基金管理有限公司
二〇一七年三月三十日