天弘永利债券型证券投资基金

2014 第三季度 报告

2014年9月30日

基金管理人:天弘基金管理有限公司
基金托管人:兴业银行股份有限公司
报告送出日期:2014年10月24日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人兴业银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年10月22日复核了本报告中的财务指标、净值表现和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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期自2014年7月1日起至2014年9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	天弘永利债券	
基金主代码	420002	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2008年04月18日	
报告期末基金份额总额	1,177,012,205.91份	
投资目标	在充分控制风险和保持资产良好流动性的前提下,力争为基金份额持有人获取较高的投资回报。	
投资策略	本基金通过对宏观经济自上而下的分析以及对微观面自下而上的分析,对宏观经济发展环境、宏观经济运行状况、货币政策和财政政策的变化、市场利率走势、经济周期、企业盈利状况等作出研判,从而确定整体资产配置,即债券、股票、现金及回购等的配置比例。本基金的股票投资将以新股申购为主,对于二级市场股票投资持谨慎态度。本基金将在充分重视本金安全的前提下,为基金份额持有人获取长期稳定的投资回报。	
业绩比较基准	中信标普全债指数	
风险收益特征	本基金为债券型基金,属于证券市场中风险较低的品种,其长期平均风险和预期收益率低于混合型基金,高于货币市场基金。	
基金管理人	天弘基金管理有限公司	
基金托管人	兴业银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	天弘永利债券A	天弘永利债券B
下属两级基金的交易代码	420002	420102
报告期末下属两级基金的份额总额	861,358,938.05份	315,653,267.86份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年07月01日-2014年09月30日)	
	天弘永利债券A	天弘永利债券B
1.本期已实现收益	5,983,041.08	4,123,907.07
2.本期利润	11,962,362.02	7,883,978.69
3.加权平均基金份额本期利润	0.0337	0.0366
4.期末基金资产净值	903,276,302.49	331,292,235.73
5.期末基金份额净值	1.0487	1.0495

注:1、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。

2、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。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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

天弘永利债券A

阶段	净值增长率①	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	3.38%	0.08%	1.66%	0.25%	1.72%	-0.17%

天弘永利债券B

阶段	净值增长率①	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	3.49%	0.08%	1.66%	0.25%	1.83%	-0.17%

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

注:1、本基金合同于2008年4月18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。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)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;天弘添利分级债券型证券投资基金基金经理;天弘丰利分级债券型证券投资基金基金经理;天弘债券型发起式证券投资基金基金经理;天弘稳利定期开放债券型证券投资基金基金经理;天弘弘利债券型证券投资基金基金经理;天弘同利分级债券型证券投资基金基金经理;本公司副总经理、固定收益总监兼固定收益部总经理。	2011年11月		12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;北京辰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。2011年加盟本公司。
姜晓丽	本基金基金经理;天弘稳利债券型证券投资基金基金经理;天弘安康养老混合型证券投资基金基金经理;天弘通利混合型证券投资基金基金经理。	2012年08月		5年	女,经济学硕士。历任本公司债券研究员兼债券交易员;光大永明人寿保险有限公司债券研究员兼交易员;本公司固定收益研究员、本基金基金经理助理。

注:1、上述任职日期为本基金管理人对外披露的任职日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公平交易的执行情况包括:建立统一的研究平台和公共信息平台,保证各组合得到公平的投资资讯;公平对待不同投资组合,禁止各投资组合之间进行以利益输送为目的的投资交易活动;在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时,严格执行授权审批程序;实行集中交易制度和公平交易分配制度;建立不同投资组合投资信息的管理及保密制度,保证不同投资组合经理之间的重大非公开投资信息的相互隔离;加强对投资交易行为的监察稽核力度,建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估体系等。

报告期内,公司公平交易程序运作良好,未出现异常情况。

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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

为规范投资行为,公平对待投资组合,制定《异常交易监控和报告办法》对可能显著影响市场价格、可能导致不公平交易、可能涉嫌利益输送等交易行为异常和交易价格异常的情形进行界定,拟定相应的监控、分析和防控措施。

本报告期内,严格控制同一基金或不同基金组合之间的同日反向交易,严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易;针对非公开发行股票申购,以公司名义进行的债券一级市场申购的申购方案和分配过程进行审核和监控,保证分配结果符合公平交易原则。未发现本基金存在异常交易行为。

本基金本报告期内未发生同一基金或不同基金组合之间在同一交易日内进行反向交易及其他可能导致不公平交易和利益输送的异常交易。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

3季度经济出现了快速下行,货币政策逐步放松、力度不断加强,房地产贷款政策也有相应调整。资金面逐步宽松,资金利率不断下行,债券市场整体快速上涨,从国债到信用债利率都有下行,利率下行幅度均在50bp左右,幅度较大。我们延续二季度观点,认为债市将延续牛市,所以三季度债券操作上较为积极,我们积极配置了长久期利率债,同时积极配置城投债,保持了组合较高杠杆和相对长的久期水平。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2014年9月30日,永利A基金份额净值为1.0487元,永利B基金份额净值为1.0495元。报告期内份额净值增长率永利A为3.38%,永利B为3.49%,同期业绩比较基准增长率为1.66%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

当前经济体下行压力仍较大,房地产市场虽然有政策调整,但是具体对拉动经济的实际作用仍需观察。随着地方性债务的规范制度出台和对非标规范的政策效果的体现,货币政策放松的空间在不断加大。经历了三季度收益率的下行,债券市场的牛市将从预期阶段进入兑现阶段---------以shibor为代表的货币市场利率水平将进入快速下行阶段。在此背景下,债券将继续延续牛市格局,但长端利率品的利率下行空间逐步缩窄,信用品的利差有望继续压缩。考虑到基本面的逆转仍需时日,我们在中期维持乐观判断,继续保持偏长的久期和偏高的杠杆。

§5 投资组合报告

5.1 报告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	基金投资	-	-
3	固定收益投资	1,801,579,589.51	92.74
	其中:债券	1,801,579,589.51	92.74
	资产支持证券	-	-
4	贵金属投资	-	-
5	金融衍生品投资	-	-
6	买入返售金融资产	-	-
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
7	银行存款和结算备付金合计	28,199,395.17	1.45
8	其他资产	112,929,693.81	5.81
9	合计	1,942,708,678.49	100.00

5.2 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。

5.3 报告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。

5.4 报告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	399,591,000.00	32.37
	其中:政策性金融债	399,591,000.00	32.37
4	企业债券	1,056,926,589.51	85.61
5	企业短期融资券	190,560,000.00	15.44
6	中期票据	154,502,000.00	12.51
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	1,801,579,589.51	145.93

5.5 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	140444	14农发44	1,000,000	100,110,000.00	8.11
2	041474001	14西宁经开CP001	600,000	60,096,000.00	4.87
3	140205	14国开05	500,000	54,650,000.00	4.43
4	140358	14进出58	500,000	50,560,000.00	4.10
5	140433	14农发33	500,000	50,360,000.00	4.08

5.6 报告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。

5.7 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。

5.8 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权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 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。

5.10 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。

5.11 投资组合报告附注

5.11.1 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。

5.11.2 本报告期内未发现本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。

5.11.3 其他资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	69,111.11
2	应收证券清算款	1,410,461.78
3	应收股利	-
4	应收利息	32,277,478.12
5	应收申购款	79,172,642.80
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	112,929,693.81

5.11.4 报告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可转换债券。

5.11.5 报告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。

5.11.6 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

	天弘永利债券A	天弘永利债券B
本报告期期初基金份额总额	183,804,587.56	173,844,313.40
本报告期基金总申购份额	2,058,212,213.56	150,723,115.08
减:本报告期基金总赎回份额	1,380,657,863.07	8,914,160.62
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	861,358,938.05	315,653,267.86

注:总申购份额含红利再投、转换入份额;总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立天弘永利债券型证券投资基金的文件

2、天弘永利债券型证券投资基金基金合同

3、天弘永利债券型证券投资基金托管协议

4、中国证监会批准设立天弘基金管理有限公司的文件

5、天弘永利债券型证券投资基金财务报表及报表附注

8.2 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

8.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的住所及网站或基金托管人的住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O一四年十月二十四日

天弘季加利理财债券型证券投资基金

2014 第三季度 报告

2014年9月30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
报告送出日期:2014年10月24日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

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2014年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2014年7月1日起至9月30日止。

§2 基金产品概况

基金简称	天弘季加利理财	
基金主代码	000670	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014年06月18日	
报告期末基金份额总额	233,446,929.46份	
投资目标	本基金在追求本金安全的基础上,力求获取较高的当期收益。	
投资策略	在封闭期内,本基金将在坚持组合久期与封闭期基本匹配的原则下,采用持有到期策略构建投资组合,基本保持大类品种配置的比例恒定,如果需要,在封闭期之间的短暂开放期内,本基金将采用流动性管理与组合调整相结合的策略。 本基金主要投资于银行定期存款、协议存款及大额存单、债券回购和短期债券(包括短期融资券、即将到期的中期票据等)三类利率市场化程度较高的金融工具。在封闭期,根据市场情况和可投资品种的容量,在严谨深入的研究分析基础上,综合考量市场资金面走向、信用债券的信用评级、协议存款交易对手的信用资质以及各类资产的收益率水平等,确定各类货币市场工具的配置比例,主要采取持有到期的投资策略。	
业绩比较基准	3个月银行定期存款利率(税后)	
风险收益特征	本基金为采用固定组合策略的短期理财债券型基金,属于证券投资基金中较低风险、预期收益较为稳定的品种,其预期的风险水平低于股票型基金、混合型基金和普通债券型基金。	
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	
下属两级基金的基金简称	天弘季加利理财A	天弘季加利理财B
下属两级基金的交易代码	000670	000671
报告期末下属两级基金的份额总额	183,929,192.36份	49,517,737.10份

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年07月01日-2014年09月30日)	
	天弘季加利理财A	天弘季加利理财B
1.本期已实现收益	7,567,450.17	1,079,109.37
2.本期利润	7,567,450.17	1,079,109.37
3.期末基金资产净值	183,929,192.36	49,517,737.10

3.1.1 主要财务指标_上期

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年06月18日-2014年06月30日)	
	天弘季加利理财A	天弘季加利理财B
1.本期已实现收益	918,888.20	131,331.79
2.本期利润	918,888.20	131,331.79
3.期末基金资产净值	626,763,420.58	85,005,040.00

注:1、本基金无持有人认购或交易基金的各项费用。

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,由于短期理财债券基金采用摊余成本法核算,因此,公允价值变动收益为零,本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3、本基金合同生效日为2014年6月18日,截止2014年6月30日本基金合同生效不足2个月,按照基金合同的规定,未编制当期季度报告。本基金在本报告期内,单独列示披露基金合同生效起至上个季度季末的财务指标。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1、天弘季加利理财A

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	1.2072%	0.0223%	0.6644%	0.0000%	0.5428%	0.0223%

2、天弘季加利理财B

阶段	净值收益率①	净值收益率标准差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	1.2695%	0.0223%	0.6644%	0.0000%	0.6051%	0.0223%

注:本基金的收益分配是按月结转份额。

3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值收益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2014年6月18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10个工作日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2014年6月18日—2014年7月1日,建仓期结束时,各项资产配置比例均符合基金合同的约定。

3、本报告期内,本基金的各项投资比例达到基金合同约定的各项比例要求。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)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		
王登峰	本基金基金经理、天弘增利宝货币市场基金基金经理、天弘现金管家货币市场基金基金经理。	2014年6月	-	5年	男,硕士研究生。历任中信建投证券股份有限公司固定收益部高级经理。2012年加盟本公司,历任固定收益研究员。

注:1、上述任职日期为本基金管理人对外披露的任职日期。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》的相关规定。

4.2 报告期内本基金运作遵规守信情况说明

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。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

公平交易的执行情况包括:建立统一的研究平台和公共信息平台,保证各组合得到公平的投资资讯;公平对待不同投资组合,禁止各投资组合之间进行以利益输送为目的的投资交易活动;在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时,严格执行授权审批程序;实行集中交易制度和公平交易分配制度;建立不同投资组合投资信息的管理及保密制度,保证不同投资组合经理之间的重大非公开投资信息的相互隔离;加强对投资交易行为的监察稽核力度,建立有效的异常交易行为日常监控和分析评估体系等。

报告期内,公司公平交易程序运作良好,未出现异常情况;场外、网下业务公平交易制度执行情况良好,未出现异常情况。

公司对旗下各投资组合的交易行为进行监控和分析,对各投资组合不同时间窗口(1日、3日、5日)内的同向交易的溢价金额与溢价率进行了T检验,未发现违反公平交易原则的异常交易。

本报告期内,未出现违反公平交易制度的情况,公司旗下各基金不存在因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。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

为规范投资行为,公平对待投资组合,制定《异常交易监控和报告办法》对可能显著影响市场价格、可能导致不公平交易、可能涉嫌利益输送等交易行为异常和交易价格异常的情形进行界定,拟定相应的监控、分析和防控措施。

本报告期内,严格控制同一基金或不同基金组合之间的同日反向交易,严格禁止可能导致不公平交易和利益输送的同日反向交易;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 报告期内基金的投资策略和运作分析

2014年3季度,投资增速偏低,宏观经济整体偏弱,物价水平仍处于较低位置,在稳增长和防风险的要求下,财政政策、货币政策和房地产政策都出现了一定程度的放松。在央行SLO、下调公开市场利率等放松操作的提振下,资金面维持宽松的状态,资金利率大幅下行,同业存款利率也随之调低,债券市场各期限的收益率也呈现出下行的态势。

报告期内,本组合继续秉承"稳健理财"的投资理念,根据本组合特点,灵活调整了债券和存款的比例,在控制好信用风险的前提下,为持有人创造了合理的收益。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截止2014年9月30日, 本基金A级份额本报告期净值收益率为1.2072%,B级份额净值收益率为1.2695%, 同期业绩比较基准收益率为0.6644%。

4.6 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2014年4季度,宏观经济仍将维持弱势的格局,受制于产能过剩等因素影响,前期政策放松短期内对经济的提振作用有限,物价方面,由于基数因素CPI有望处于上升通道,但不会构成通胀压力。货币政策方面,考虑到控制金融风险的角度,大幅放松的概率不大,但仍将维持宽松的状态,采取定向放松的政策来降低社会融资成本。资金面方面,宽松的状态有望维持,资金利率将维持地位,但不排除部分时点资金利率的上行。债券市场方面,收益率也将维持稳定基至下行,上行的概率不大。

投资策略上,本基金将继续将风险管理放在组合管理的第一位,灵活调整组合资产配置比例,继续为持有人创造持续、稳定、合理的收益。

§5 投资组合报告

5.1 报告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	固定收益投资	-	-
	其中:债券	-	-
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	50,000,275.00	21.30
	其中:买断式回购的买入返售金融资产	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	180,319,097.37	76.82
4	其他资产	4,415,565.80	1.88
5	合计	234,734,938.17	100.00

5.2 报告期债券回购融资情况

金额单位:人民币元

序号	项目	占基金资产净值比例(%)
1	报告期内债券回购融资余额	6.48
	其中:买断式回购融资	-
序号	项目	金额 / 占基金资产净值比例(%)
2	报告期末债券回购融资余额	- / -
	其中:买断式回购融资	- / -

注:报告期内债券回购融资余额占基金资产净值比例应取报告期内每个交易日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值;对于理财债券型基金,只要其投资的市场(如银行间市场)可交易,即可视为交易日。

债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本基金合同约定:"本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%;",本报告期内,本基金未发生超标情况。

5.3 基金投资组合平均剩余期限

5.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

不适用。

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

不适用。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

不适用。

5.4 报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本基金本报告期末未持有债券。

5.5 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

本基金本报告期末未持有债券。

5.6 "影子定价"与"摊余成本法"确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.1422%
报告期内偏离度的最低值	-0.1921%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1044%

5.7 报告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。

5.8 投资组合报告附注

5.8.1 基金计价方法说明。

本基金估值采用"摊余成本法",即估值对象以买入成本列示,按照票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价,在剩余存续期内平均摊销,每日计提损益。本基金不采用市场利率和上市交易的债券和票据的市价计算基金资产净值。

5.8.2 本报告期内,本基金持有的剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券的说明。

不适用。

5.8.3 本基金本报告期内不存在投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查,或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.8.4 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	14,574.36
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	80,798.96
4	应收申购款	4,320,192.48
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	4,415,565.80

5.8.5 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。

§6 开放式基金份额变动

单位:份

	天弘季加利理财A	天弘季加利理财B
基金合同生效日基金份额总额	626,763,420.58	85,005,040.00
报告期期初基金份额总额	626,763,420.58	85,005,040.00
报告期基金总申购份额	14,280,481.80	890,350.44
减:报告期基金总赎回份额	457,114,710.02	36,377,653.34
报告期期末基金份额总额	183,929,192.36	49,517,737.10

注:1、本基金合同生效日为2014年6月18日。

2、总申购份额含红利再投、转换入份额;总赎回份额含转换出份额。

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 备查文件目录

8.1 备查文件目录

1、中国证监会批准天弘季加利理财债券型证券投资基金募集的文件

2、天弘季加利理财债券型证券投资基金基金合同

3、天弘季加利理财债券型证券投资基金招募说明书

4、天弘季加利理财债券型证券投资基金托管协议

5、天弘基金管理有限公司批准成立批件及营业执照

8.2 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

8.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的住所及网站或基金托管人的住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O一四年十月二十四日

华富中小板指数增强型证券投资基金

2014 第三季度 报告

2014年9月30日

基金管理人:华富基金管理有限公司
基金托管人:中国建设银行股份有限公司
报告送出日期:2014年10月24日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及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责任。

基金托管人中国建设银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年10月23日复核了本报告中的财务指标、净值表现、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

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。

本报告财务资料未经审计。

本报告期间为2014年7月1日至2014年9月30日。

§2 基金产品概况

基金简称	华富中小板指数增强
基金主代码	410010
交易代码	410010
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2011年12月9日
报告期末基金份额总额	25,520,659.15份
投资目标	本基金为股票指数增强型基金,以被动跟踪标的指数为主,力争控制本基金净值增长率与业绩比较基准之间的日均跟踪偏离度的绝对值不超过0.5%,年化跟踪误差不超过7.75%。在分享中小板市场平均收益的基础之上,力争通过增强手段实现超越比较基准的投资收益,谋求基金资产的长期增值。
投资策略	作为指数增强型基金,本基金的投资策略是在指数化投资的基础之上,采用适度的主动投资辅助提高收益,降低投资风险。指数化投资部分本基金采用完全复制的方法,按照标的指数的成分股组成及其权重构建指数化投资组合,并按照标的指数成分股及其权重的变动进行相应调整。主动投资部分本基金将采用定量结合定性的方法适度调整资产配置及精选个股,在一定的跟踪误差范围内追求超越指数的收益。
业绩比较基准	中小板指数收益率*90%+一年期银行定期存款利率(税后)*10%
风险收益特征	本基金属于股票型基金,属于较高风险、较高收益的投资品种。一般情况下,其风险和收益高于混合型基金、债券型基金和货币市场基金。
基金管理人	华富基金管理有限公司
基金托管人	中国建设银行股份有限公司

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1 主要财务指标

单位:人民币元

主要财务指标	报告期(2014年7月1日 — 2014年9月30日)
1.本期已实现收益	4,432,417.51
2.本期利润	9,031,005.93
3.加权平均基金份额本期利润	0.1774
4.期末基金资产净值	31,060,743.01
5.期末基金份额净值	1.217

注:1、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。

2、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,计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2 基金净值表现

3.2.1 本报告期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	净值增长率①	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	19.08%	0.98%	15.21%	0.91%	3.87%	0.07%

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:根据《华富中小板指数增强型证券投资基金基金合同》的规定,本基金的资产配置范围为:投资于股票资产占基金资产的比例为85%-95%,其中被动投资于标的指数成份股及备选成份股的比例不低于股票资产的80%;现金或者到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%;其他金融工具的投资比例符合法律法规和监管机构的规定。本基金建仓期为2011年12月9日到2012年6月9日,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。本报告期内,本基金严格执行了《华富中小板指数增强型证券投资基金基金合同》的规定。

§4 管理人报告

4.1 基金经理(或基金经理小组)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		
朱蓓	华富中小板指数增强型基金基金经理、华富量子生命力股票型基金基金经理、华富中证100指数基金基金经理。	2012年12月19日	-	七年	上海交通大学安泰管理学院会计学硕士、研究生学历,曾担任平安资产管理有限责任公司量化投资部投资经理助理,2009年11月进入华富基金管理有限公司,曾任金融工程研究员、产品设计经理。

注:这里的任职日期指公司作出决定之日。证券从业年限的计算标准上,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

本报告期内,本基金管理人认真遵循《中华人民共和国证券投资基金法》及相关法律法规,对本基金的管理始终按照基金合同、招募说明书的要求和公司制度的规定进行。本基金的交易行为合法合规,未发现异常情况;相关信息披露真实、完整、准确、及时;基金各种账户类、申购赎回、注册登记业务均按规定的程序进行,未出现重大违法违规或违反基金合同的行为。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

本基金管理人根据中国证监会《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》等相关法规要求,结合实际情况,制定了《华富基金管理有限公司公平交易管理制度》,对证券的一级市场中购、二级市场交易相关的研究分析、投资决策、授权、交易执行、业绩评估等投资管理环节全部纳入公平交易管理中,实行事前控制、事中监控、事后分析反馈的流程化管理。在制度和流程上确保各组合享有同等信息知情权、均等交易机会,并保持各组合的独立投资决策权。

本报告期内,公司公平交易制度总体执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期内未发现本基金存在异常交易行为。本基金报告期内不存在参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边交易量超过该证券当日成交量的5%的情形。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析

7月份市场在地产股带动下触底反弹,并延续至整个三季度。国企改革的制度红利,以及流动性的改善,让我们对市场中长期走势转为乐观。上半年沪深300指数上涨13.2%,表现较好的三个行业分别为国防军工、纺织服装、钢铁,表现最差的三个行业为银行、传媒、家用电器。

作为中小板指数增强型基金,本基金的仓位和结构会严格按照基金合同的要求进行配置,将跟踪误差控制在基金合同要求的范围内,同时力争实现超越比较基准