天弘债券型发起式证券投资基金

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:中国工商银行股份有限公司
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。
基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年10月21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	天弘债券发起式
交易代码	420008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2012年08月10日
报告期末基金份额总额	608,053,835.78份
投资目标	本基金在追求基金资产长期稳健增值的基础上,力争获得高于业绩比较基准的投资收益。
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,在严格的风险控制基础上,主动构建及调整投资组合,力求实现基金资产的稳定增值。
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。
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
下属两级基金的基金简称	天弘债券型发起式A / 天弘债券型发起式B
下属两级基金的交易代码	420008 / 420108
报告期末下属两级基金的份额总额	565,226,785.09份 / 42,827,050.69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)	
	天弘债券型发起式A	天弘债券型发起式B
1.本期已实现收益	10,030,627.19	835,157.43
2.本期利润	15,246,193.98	1,280,261.56
3.加权平均基金份额本期利润	0.0268	0.0247
4.期末基金资产净值	585,609,414.91	44,017,363.06
5.期末基金份额净值	1.036	1.028

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

天弘债券型发起式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	2.68%	0.07%	0.70%	0.07%	1.98%	0.00%

天弘债券型发起式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	2.59%	0.06%	0.70%	0.07%	1.89%	-0.01%

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

放宽松信号。市场表现来看,在基本面及政策面的共同推动下,3季度资金面总体宽松,资金利率大幅下行,利率品表现来看,收益率曲线进一步平坦化下行,期限利差急剧收窄;信用品方面,经济下行阶段信用风险事件频现,但目前尚未出现一单完全不兜底的个券,市场总体仍处在由政策放松带来的乐观情绪中,信用利差继续收窄,信用品收益率曲线亦随基本面趋势平坦化下行。

本基金在报告期内,择机配置了部分中长久期优质城投债,总体维持了较高杠杆,为持有人赚取了丰厚的票息及收益率曲线下行过程中的资本利得。

4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2014年9月30日,本基金A级份额净值为1.036元,B级份额净值为1.028元。报告期内份额净值增长率A级为2.68%,B级为2.59%,同期业绩比较基准增长率为0.70%。

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,经济短期仍将维持弱势格局,经济去产能周期,结合PMI、PPI、上中下游库存、价格、房屋销售等指标来看,内需仍然疲弱,且目前来看,前期房产政策、货币政策放松对内需提振作用有限;外需方面,近期美、欧、日经济又有下探趋势,复苏道路坎坷,因此我国出口复苏可持续性存疑,出口对经济拉动作用减弱;物价方面,需求较弱背景下,PPI将延续通缩格局,CPI方面,猪周期效果减弱,但受基数影响,4季度同比将进入上升通道,对货币政策全面大幅放松构成一定制约,不过年内CPI绝对水平有望在2.5%以内,仍处在较低位置;政策面方面,财政政策有望维持积极,货币政策有望加大定向宽松力度,短期内受制于物价同比上行、金融系统风险较大等因素制约,全面大幅宽松概率不大。总体来看,4季度债券市场仍然较为安全,宏观环境利于债基延长久期、加杠杆以放大收益,利率品收益率大幅上行概率不大,但短期进一步下行空间有限,信用品方面,受新预算法影响,城投债供给将急剧收缩,从宏观基本面角度及债券供需角度,信用品收益率大幅上行概率亦不大,但经济下行周期,不排除个别债券出现信用风险带来市场短时期调整的可能。

投资策略上,本基金将继续做好组合久期、风险的匹配,总体维持高杠杆,偏长久期,同时根据市场形势变化及时调整组合仓位和久期。

§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	978,942,898.75	95.56
	其中:债券	978,942,898.75	95.56
	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	14,561,775.83	1.42
8	其他资产	30,869,319.38	3.01
9	合计	1,024,373,993.96	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	19,988,000.00	3.17
	其中:政策性金融债	19,988,000.00	3.17
4	企业债券	473,053,898.75	75.13
5	企业短期融资券	465,981,000.00	74.01
6	中期票据	19,920,000.00	3.16
7	可转债	-	-
8	其他	-	-
9	合计	978,942,898.75	155.48

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	041459002	14信城投CP001	600,000	60,870,000.00	9.67
2	041456002	14蜂峰CP001	600,000	60,840,000.00	9.66
3	041452003	14云投CP001	600,000	60,834,000.00	9.66
4	041459003	14苏汇鸿CP001	600,000	60,762,000.00	9.65
5	1480368	14普陀国资债	500,000	51,380,000.00	8.16

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 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。

5.11.2 基金投资的前十名股票,均为基金合同规定核心股票库之内的股票。

5.11.3 期末其他各项资产构成

单位:人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	5.44
2	应收证券清算款	383,094.64
3	应收股利	-
4	应收利息	30,483,527.60
5	应收申购款	2,691.70
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	30,869,319.38

5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细
本基金报告期期末未持有处于转股期的可转换债券。

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

	天弘债券型发起式A	天弘债券型发起式B
本报告期期初基金份额总额	570,744,476.36	60,649,858.79
本报告期基金总申购份额	613,901.02	7,220,119.16
减:本报告期基金总赎回份额	6,131,592.29	25,042,927.26
本报告期基金拆分变动份额	-	-
本报告期期末基金份额总额	565,226,785.09	42,827,050.69

注:总申购份额含转换入份额;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

单位:份

报告期期初管理人持有的本基金份额	10,287,988.75
报告期期间买入申购总份额	-
报告期期间卖出赎回总份额	-
报告期期末管理人持有的本基金份额	10,287,988.75
报告期期末持有的本基金份额占基金总份额比例(%)	1.69

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况
本报告期基金管理人未运用固有资金投资本基金。

§8 报告期末发起式基金发起资金持有份额情况

项目	持有份额总数	持有份额占基金总份额比例	发起份额总数	发起份额占基金总份额比例	发起份额承诺持有期限
基金管理人固有资金	10,287,988.75	1.69%	10,000,800.08	1.64%	三年
基金管理人高级管理人员	-	-	-	-	
基金经理等人员	-	-	-	-	
基金管理人股东	-	-	-	-	
其他	-	-	-	-	
合计	10,287,988.75	1.69%	10,000,800.08	1.64%	

注:本报告期末持有份额总数为发起份额总数和截至本报告期末红利再投份额数的合计。

§9 备查文件目录

9.1 备查文件目录
1、中国证监会批准天弘债券型发起式证券投资基金募集的文件
2、天弘债券型发起式证券投资基金合同
3、天弘债券型发起式证券投资基金招募说明书
4、天弘债券型发起式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

9.2 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

9.3 查阅方式
投资者可到基金管理人的注册登记地及网站或基金托管人的注册登记地免费查阅备查文件,在支付工本费后,可在合理时间内取得上述文件的复制件或复印件。

公司网站:www.thfund.com.cn

天弘基金管理有限公司
二〇一四年十月二十四日

天弘现金管家货币市场基金

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:中国邮政储蓄银行股份有限公司
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。
基金托管人中国邮政储蓄银行股份有限公司根据本基金合同规定,于2014年10月21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。
本报告中财务资料未经审计。
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	天弘现金管家货币	
基金主代码	420006	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012年06月20日	
报告期末基金份额总额	2,106,697,525.92份	
投资目标	在保持基金资产的低风险和高流动性的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。	
投资策略	本基金根据对短期利率变动的预测,采用投资组合平均剩余期限控制下的主动性投资策略,利用定性分析和定量分析方法,通过对短期金融工具的积极投资,在控制风险和保证流动性的基础上,力争获得稳定的当期收益。	
业绩比较基准	同期七天通知存款利率(税后)	
风险收益特征	本基金为货币市场基金,属于证券投资基金中的低风险品种,其预期收益和风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。	
基金管理人	天弘基金管理有限公司	
基金托管人	中国邮政储蓄银行股份有限公司	
下属两级基金的基金简称	天弘现金管家货币A类	天弘现金管家货币B类
下属两级基金的交易代码	420006	420106
报告期末下属两级基金的份额总额	147,748,479.70份	1,958,949,046.22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)	
	天弘现金管家货币A类	天弘现金管家货币B类
1.本期已实现收益	1,670,350.76	16,749,324.04
2.本期利润	1,670,350.76	16,749,324.04
3.期末基金资产净值	147,748,479.70	1,958,949,046.22

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,由于货币市场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。

3.2 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、天弘现金管家货币A类

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	0.8822%	0.0091%	0.3456%	0.0000%	0.5366%	0.0091%

2、天弘现金管家货币B类

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	0.9437%	0.0091%	0.3456%	0.0000%	0.5981%	0.0091%

注:本基金的收益分配是按日结转份额

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2012年6月20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		
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、天弘季加利理财债券型证券投资基金基金经理。	2012年08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讯;公平对待不同投资组合,禁止各投资组合之间违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投资异交易。

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
2014年3季度,经济下行趋势进一步确立,投资方面,房地产、制造业投资继续走弱,同时受制于财力限制,基建投资托底经济乏力;消费方面,经济下行背景下,收入难以大幅提升,消费需求低位震荡;出口方面,尽管3季度外需有所好转,但出口对经济拉动作用有限;综合来看,结合持续通缩的PPI及持续下探的CPI趋势,经济总体外需温和,内需疲弱,在稳增长及防风险的要求下,3季度政策面有进一步放松,财政政策方面,国务院出台固定资产加速折旧政策,以减轻企业负担;房产政策方面,各地方政府陆续放松限购限贷,同时央行银监会联合发布放贷新政以支持购房需求;货币政策方面,央行通过SLF等方式定向放松,并于7月、9月连续两次下调公开市场操作利率合计30bp,进一步释

§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	922,513,302.29	43.76
	其中:债券	922,513,302.29	43.76
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产[注]	397,197,515.80	18.84
	其中:买断式回购的买入返售金融资产[注]	-	-
3	银行存款和结算备付金合计	765,329,355.41	36.31
4	其他资产[注]	22,926,663.59	1.09
5	合计	2,107,966,837.09	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	4.48
	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货币市场基金,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
本报告期内,本货币市场基金债券正回购的资金余额均未超过资产净值的20%。

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

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	46
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	61
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	16

报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明
根据本货币市场基金基金合同的约定,其投资组合的平均剩余期限在每个交易日都不得超过120天,故本报告期内,本货币市场基金投资组合平均剩余期限未发生超过120天的情况。

5.3.2 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例(%)	各期限负债占基金资产净值的比例(%)
1	30天以内	52.83	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
2	30天(含)-60天	8.10	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
3	60天(含)-90天	35.66	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
4	90天(含)-180天	2.38	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
5	180天(含)-397天(含)	-	-
	其中:剩余存续期超过397天的浮动利率债	-	-
	合计	98.97	-

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	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	-	-
2	央行票据	-	-
3	金融债券	99,721,107.30	4.73
	其中:政策性金融债	99,721,107.30	4.73
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	722,585,132.74	34.30
6	中期票据	100,207,062.25	4.76
7	其他	-	-
8	合计	922,513,302.29	43.79
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	-	-

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

金额单位:人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本(元)	占基金资产净值比例(%)
1	1182287	11三峡MTN2	1,000,000	100,207,062.25	4.76
2	071411001	14国信证券CP001	1,000,000	99,984,770.89	4.75
3	071404012	14广发CP012	1,000,000	99,976,936.13	4.75
4	011440001	14港中旅SCP001	800,000	80,377,972.93	3.82
5	041356051	13深地铁CP001	500,000	50,633,855.72	2.40
6	041352041	13京能CP001	500,000	50,312,670.24	2.39
7	011473001	14鲁高速SCP001	500,000	50,134,912.15	2.38
8	011486001	14光伟SCP001	500,000	50,017,029.15	2.37
9	130243	13国开43	500,000	50,014,144.21	2.37
10	011497002	14兵器SCP002	500,000	49,996,932.24	2.37

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	0.1659%
报告期内偏离度的最低值	0.0562%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.1125%

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,按票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价,在其剩余存续期内按照实际利率法进行摊销,每日计提损益。本基金通过每日计算基金收益并分配的方式,使基金份额净值保持在人民币1.00元。为了避免采用"摊余成本法"计算的基金资产净值与按市场利率和交易市价计算的基金资产净值发生重大偏离,从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果,基金管理人于每一估值日,采用估值技术,对基金持有的估值对象进行重新评估,即"影子定价"。投资组合的摊余成本与其他可参考公允价值指标产生重大偏离的,应按其他公允指标对组合的账面价值进行调整,调整差额确认为"公允价值变动损益",并按其他公允价值指标进行后续计量。如基金份额净值恢复至1元,可恢复使用摊余成本法估算公允价值。如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的,基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后,按最能反映公允价值的价格估值。

5.8.2 本报告期内,本基金未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。

5.8.3 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。

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	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	22,847,437.33
4	应收申购款	79,226.26
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合计	22,926,663.59

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

	天弘现金管家货币A类	天弘现金管家货币B类
基金合同生效日基金份额总额	576,166,940.77	658,270,316.20
报告期期初基金份额总额	259,953,155.41	762,420,685.85
报告期基金总申购份额	355,088,062.71	3,064,184,455.46
减:报告期基金总赎回份额	467,292,738.42	1,867,656,095.09
报告期期末基金份额总额	147,748,479.70	1,958,949,046.22

注:1、总申购份额含红利再投、分级调整转入及转换入份额。
2、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

序号	交易方式	交易日期	交易份额(份)	交易金额(元)	适用费率
1	红利再投	2014年07月01日	316,248.84	-	-
2	申购	2014年07月10日	13,800,000.00	13,800,000.00	-
3	申购	2014年07月17日	100,000,000.00	100,000,000.00	-
4	申购	2014年07月18日	18,000,000.00	18,000,000.00	-
5	红利再投	2014年08月01日	407,518.87	-	-
6	申购	2014年08月07日	13,800,000.00	13,800,000.00	-
7	申购	2014年08月25日	18,000,000.00	18,000,000.00	-
8	红利再投	2014年09月01日	678,244.82	-	-
9	申购	2014年09月11日	13,440,000.00	13,440,000.00	-
合计			178,442,012.53	177,040,000.00	

§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现金管家货币市场基金募集的文件
2、天弘现金管家货币市场基金基金合同
3、天弘现金管家货币市场基金招募说明书
4、天弘现金管家货币市场基金托管协议
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
二〇一四年十月二十四日

汇添富和聚宝货币市场基金

2014 第三季度 报告

2014年9月30日

基金管理人:汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人:上海浦东发展银行股份有限公司
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。
基金托管人上海浦东发展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	汇添富和聚宝货币
交易代码	000600
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2014年5月28日
报告期末基金份额总额	657,474,026.04份
投资目标	在保持基金资产的低风险和高流动性的前提下,力争实现超越业绩比较基准的投资回报。
投资策略	本基金将结合宏观分析和微观分析制定投资策略,力求在满足安全性、流动性需要的基础上实现更高的收益率。
业绩比较基准	活期存款利率(税后)。
风险收益特征	本基金为货币市场证券投资基金,是证券投资基金中的低风险品种。本基金的预期风险和预期收益低于股票型基金、混合型基金、债券型基金。
基金管理人	汇添富基金管理股份有限公司
基金托管人	上海浦东发展银行股份有限公司

§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	7,037,422.97
2.本期利润	7,037,422.97
3.期末基金资产净值	657,474,026.04

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

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	1.1375%	0.0011%	0.0882%	0.0000%	1.0493%	0.0011%

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:本基金的《基金合同》生效日为2014年5月28日,截至本报告期末,基金成立未满1年,本基金建仓期为本《基金合同》生效之日(2014年5月28日)起6个月,建仓期结束时各项资产配置比例符合合同约定。

§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		
汤丞珊	汇添富货币基金、汇添富金额宝货币基金、汇添富理财30天债券基金、汇添富理财60天债券基金、汇添富和聚宝货币基金的基金经理。	2014年5月28日	-	6年	国籍:中国,学历:上海财经大学管理学硕士,相关业务资格:基金从业资格。从业经历:2008年5月加入汇添富基金管理股份有限公司,历任固定收益交易员、固定收益交易主管。2013年7月31日至今任汇添富货币基金的基金经理,2013年12月13日至今任汇添富金额宝货币基金的基金经理,2014年1月21日至今任汇添富理财30天债券、理财60天债券基金的基金经理,2014年5月28日至今任汇添富和聚宝货币基金的基金经理。

注:1、基金的首任基金经理,其"任职日期"为基金合同生效日,其"离职日期"为根据公司决议确定的解聘日期;
2、非首任基金经理,其"任职日期"和"离任日期"分别指根据公司决议确定的聘任日期和解聘日期;
3、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
本基金管理人在本报告期内严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他相关法律法规、证监会规定和本基金合同的约定,本着诚实信用、勤勉尽责的原则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,无损害基金持有人利益的行为。本基金无重大违法、违规行为,本基金投资组合符合有关法规及基金合同的约定。

4.3 公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况
本基金管理人高度重视投资者利益保护,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》等法规,借鉴国际经验,建立了健全、有效的公平交易制度体系,形成涵盖各开放式基金、特定客户资产管理组合和社保组合全部投资组合,交易所市场、银行间市场等各投资市场,债券、股票、回购等各投资标的,并贯穿分工授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估、监督检查各环节的公平交易机制。

本报告期内,基金管理人对公平交易制度和公平交易机制实现了流程优化和进一步系统化,确保全程嵌入式风险控制体系的有效运行,包括投资独立决策、研究公平分享、集中交易公平执行、交易严密监控和报告及时分析等在内的公平交易各环节执行情况良好。

本报告期内,通过投资交易监控、交易数据分析以及专项稽核检查,本基金管理人未发现任何违反公平交易的行为。

4.3.2 异常交易行为的专项说明
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》,公司制定了同日反向交易控制的规则,同时加强对基金、专户、社保同日反向交易的监控和隔日反向交易的检查,公司利用公平交易分析系统,对各组合间不同时间窗口下的同向交易指标进行持续监控,并定期对组合间的同向交易分析。本报告期内基金管理人管理的所有投资组合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总成交量5%的交易次数为1次,由于专户于到期清盘导致,经检查和分析未发现异常情况。

4.4 报告期内基金的投资策略和运作分析
2014年三季度经济下行压力较大,通胀数据维持低位,央行货