天弘添利债券型证券投资基金（LOF）

(原天弘添利分级债券型证券投资基金转型)

2015 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:中国工商银行股份有限公司
送出日期:2016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2016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,投资者风险、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。

根据《天弘添利分级债券型证券投资基金基金合同》(以下简称"基金合同")约定(《基金合同》生效后5年期满满,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,2015年12月04日天弘添利分级债券型证券投资基金正式更名为"天弘添利债券型证券投资基金(LOF)")。

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。

原天弘添利分级债券型证券投资基金本报告期自2015年1月1日至2015年12月04日止,天弘添利债券型证券投资基金(LOF)本报告期自2015年12月04日至2015年12月31日止。

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

2.1.1 天弘添利债券型证券投资基金(LOF)(转型后)

基金名称	天弘添利债券型证券投资基金(LOF)
基金简称	天弘添利债券(LOF)
场内简称	天弘添利
基金主代码	164206
基金运作方式	契约型开放式
基金转型生效日	2015年12月03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	1,579,387,495.66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	2015年12月15日

2.1.2 天弘添利分级债券型证券投资基金(转型前)

基金名称	天弘添利分级债券型证券投资基金
基金简称	天弘添利分级债券
场内简称	天弘添利
基金主代码	164206
基金运作方式	契约型定期开放式
基金合同生效日	2010年12月03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	1,568,366,736.09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	2010年12月20日

下属分级基金的基金简称	添利A	添利B	
下属分级基金场内简称		添利B	
下属分级基金的交易代码	164207	150027	
报告期末下属分级基金的份额总额	112,335,182.43份	1,453,031,553.66份	

注:(1)基金合同于2015年12月04日生效,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:添利B。

2.2 基金产品说明

2.2.1 天弘添利债券型证券投资基金(LOF)(转型后)

投资目标	本基金在追求基金资产稳定增值的基础上,力求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增长、通货膨胀、利率走势和货币政策四个方面的分析和预测,确定经济变量的变动对不同券种收益率、信用趋势和风险的潜在影响,基于各类券种对利率、通胀的反应,制定有效的投资策略,在控制利率风险、信用风险以及流动性风险的基础上,主动构建及调整固定收益投资组合,力争获取超额收益。此外,通过对首次发行和增发公司内在价值和一级市场申购收益率的全面分析,积极参与新股申购,获得较为安全的新股申购收益。
业绩比较基准	中国债券总指数
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 天弘添利分级债券型证券投资基金(转型前)

投资目标	本基金在追求基金资产稳定增值的基础上,力求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增长、通货膨胀、利率走势和货币政策四个方面的分析和预测,确定经济变量的变动对不同券种收益率、信用趋势和风险的潜在影响,基于各类券种对利率、通胀的反应,制定有效的投资策略,在控制利率风险、信用风险以及流动性风险的基础上,主动构建及调整固定收益投资组合,力争获取超额收益。此外,通过对首次发行和增发公司内在价值和一级市场申购收益率的全面分析,积极参与新股申购,获得较为安全的新股申购收益。
业绩比较基准	中国债券总指数
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。
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	袁建林	洪渊
	联系电话	022-83310208	010-66105799
	电子邮箱	service@tfjdfund.com.cn	custody@icbc.com.cn
客户服务电话		4007009999	95588
传真		022-83865569	010-66105798
注册地址		天津自贸区(中心商务区)响螺湾旷世国际大厦A座1704-2室	北京市西城区复兴门内大街55号
办公地址		天津市河西区马场道89号天津国际投资贸易中心A座16层	北京市西城区复兴门内大街55号
邮政编码		300203	100140
法定代表人		肖贤栋	姜建清

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.tfjdfund.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)	上海市湖滨路202号普华永道中心11楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

2.5.3 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	2015年12月04日-2015年12月31日
本期已实现收益	8,357,313.19
本期利润	12,720,581.29
加权平均基金份额本期利润	0.0086
本期基金加权平均净值利润率	0.85%
本期基金份额净值增长率	0.90%
3.1.2 期末数据和指标	2015年末
期末可供分配利润	423,382,346.90
期末可供分配基金份额利润	0.2681
期末基金资产净值	1,593,294,433.85
期末基金份额净值	1.009
3.1.3 累计期末指标	2015年末
基金份额累计净值增长率	0.90%

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.期末可供分配利润采用期末资产负债表未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 主要会计数据和财务指标(转型前)

天弘添利分级债券

3.2.1 期间数据和指标	2015年01月01日-2015年12月03日	2014年	2013年
本期已实现收益	128,564,833.51	63,024,944.20	158,874,753.16
本期利润	154,847,516.74	177,777,516.90	25,084,502.61
加权平均基金份额本期利润	0.1311	0.1265	0.0108
本期基金加权平均净值利润率	9.87%	10.99%	0.99%
本期基金份额净值增长率	12.75%	15.93%	3.57%
3.2.2 期末数据和指标	2015年12月03日	2014年末	2013年末
期末可供分配利润	410,784,576.73	301,175,180.33	221,736,276.04
期末可供分配基金份额利润	0.2624	0.2425	0.1319
期末基金资产净值	1,565,366,742.85	1,545,973,536.49	1,824,769,883.49
期末基金份额净值	1.000	1.245	1.085
3.2.3 累计期末指标	2015年12月03日	2014年末	2013年末
基金份额累计净值增长率	52.99%	35.70%	17.03%

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.期末可供分配利润采用期末资产负债表未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.3 基金份额净值表现(天弘添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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①-③	②-④
过去三个月	0.90%	0.06%	1.43%	0.09%	-0.53%	-0.03%
自基金合同转型后首至今(2015年12月04日-2015年12月31日)	0.90%	0.06%	1.43%	0.09%	-0.53%	-0.03%

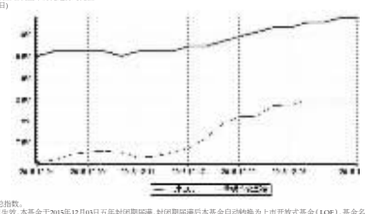
注:天弘添利分级债券基金业绩比较基准:中国债券总指数,天弘添利分级债券型证券投资基金根据《基金合同》转换为上市开放式基金(LOF)后,本基金业绩比较基准保持不变。

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)

天弘添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

(2015年12月04日-2015年12月31日)

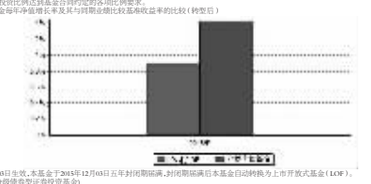


注:1.业绩比较基准:中国债券总指数。

2.本基金合同于2010年12月03日生效,本基金于2015年12月03日五年封闭期满,封闭期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"天弘添利债券型证券投资基金(LOF)",封闭期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。

3.3.3 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2010年12月03日生效,本基金于2015年12月03日五年封闭期满,封闭期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(天弘添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(天弘添利分级债券)	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	1.19%	0.06%	0.92%	0.12%	0.27%	-0.06%
过去六个月	4.82%	0.09%	2.24%	0.10%	2.58%	-0.01%
过去一年	12.75%	0.12%	3.03%	0.12%	9.72%	0.00%
过去三年	35.40%	0.18%	4.88%	0.13%	30.52%	0.05%
过去五年	52.54%	0.15%	6.81%	0.12%	45.73%	0.03%
自基金合同生效日起至今(2010年12月03日-2015年12月03日)	52.99%	0.15%	6.96%	0.11%	46.03%	0.04%

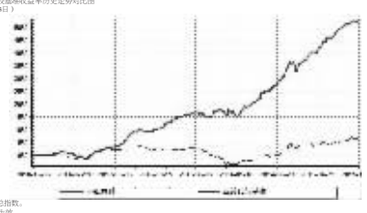
注:天弘添利分级债券基金业绩比较基准:中国债券总指数,中国债券总指数是全样本债券指数,包括市场上所有具有可比性的符合指数编制标准的债券(如交易所和银行间国债、银行间金融债券等),理论上能客观反映中国债券总体情况。

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)

天弘添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

(2010年12月03日-2015年12月03日)

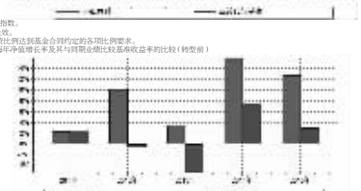


注:1.业绩比较基准:中国债券总指数。

2.本基金合同于2010年12月03日生效。

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。

3.4.3 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2010年12月03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日当年的实际存续期计算,不按整个自然年度进行折算。

3.5.1 天弘添利债券型证券投资基金(LOF)(转型后)

本基金的投资组合比例为:股票占基金资产净值比例为0%-95%,其中,港股通标的股票投资比例为股票资产的0%-50%;现金、银行存款、结算备付金、存出保证金、债券逆回购、买入返售金融资产、债券正回购、卖出回购金融资产款、应付证券清算款、应付赎回款、应付管理人报酬、应付销售服务费、应付交易费用、应付利息、应付利润、其他应付款、其他应付款项、其他各项负债、其他各项资产