

天弘添利分级债券型证券投资基金

2013第四季度报告

2013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
报告送出日期:2014年1月21日

8.1 重要提示

基金管理人的董事会对本基金所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其实质性、准确性和完整性承担责任；基金托管人中国工商银行股份有限公司根据本基金合同的规定，于2014年1月17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、误导性陈述和重大遗漏。

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。

报告期自2013年10月1日起至2013年12月31日止。

8.2 基金产品概况

基金简称 天弘添利分级债券型证券投资基金

基金主代码 164207

基金运作方式 约定开放型

基金合同生效日 2010年12月31日

报告期本基金份额总额 1,681,333,017.55份

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回报。

投资策略 本基金通过宏观经济、通货膨胀、利率走势、货币政策和债券定价四个方面的分析，结合对不同券种的收益率、信用风险及流动性风险的分析，制定有效的投资策略，在控制利率风险、信用风险及流动性风险的基础上，通过久期调整和券种选择，力求在控制风险的前提下，获得高于业绩比较基准的回报。

业绩比较基准 中国国债总指数

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。

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

下属分级基金的基金简称 添利A 添利B

添利A 150002

报告期初两级基金的份额总额 681,353,185.88份 999,979,831.67份

下属分级基金的风险收益特征 低风险，收益相对稳定

注: 添利A合同期效日起5年内,在深圳证券交易所上市的交易型封闭运作的基金的简称简称为添利B。

§ 3 主要财务指标和基金业绩表现

单位:人民币元

主要财务指标 报告期 2013年10月1日-2013年12月31日

1.本期已实现收益 27,357,969.78

2.本期利润 -44,109,761.70

3.加权平均基金份额本期利润 -0.0229

4.期末基金资产净值 1,824,769,883.49

5.期末基金份额净值 1.085

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申购基金产生的申购费用,赎回费用后实际收益以报告期最后一日的基金份额净值为基准计算。

3.2 本期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

单位:人民币元

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

过去三个月 -0.54% 0.29% -1.13% 0.14%

①-③ 2.59% 0.09%

注:1.本基金合同于2010年12月1日生效。

2.本报告期,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 其他指标

报告期 2013年10月1日-2013年12月31日

添利A与添利B基金资产配比 0.681366931

期末添利A资产净值 1,003

添利A资产配置比例 1.135

添利A资产配置比例 211,715,073.36

添利B资产配置比例 1,141

添利B资产配置比例 1.141

添利A收益(税后) 1.141

添利B收益(税后) 1.3906

添利A的年收益率率 3.90%

添利B的年收益率率 3.90%

注:1.本基金合同于2010年12月1日生效。

2.本报告期,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 其他指标

报告期 2013年10月1日-2013年12月31日

添利A与添利B基金资产配比 0.681366931

期末添利A资产净值 1,003

添利A资产配置比例 1.135

添利A资产配置比例 211,715,073.36

添利B资产配置比例 1,141

添利B资产配置比例 1.141

添利A收益(税后) 1.141

添利B收益(税后) 1.3906

添利A的年收益率率 3.90%

添利B的年收益率率 3.90%

注:1.本基金合同于2010年12月1日生效。

2.本报告期,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 其他指标

报告期 2013年10月1日-2013年12月31日

添利A与添利B基金资产配比 0.681366931

期末添利A资产净值 1,003

添利A资产配置比例 1.135

添利A资产配置比例 211,715,073.36

添利B资产配置比例 1,141

添利B资产配置比例 1.141

添利A收益(税后) 1.141

添利B收益(税后) 1.3906

添利A的年收益率率 3.90%

添利B的年收益率率 3.90%

注:1.本基金合同于2010年12月1日生效。

2.本报告期,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 其他指标

报告期 2013年10月1日-2013年12月31日

添利A与添利B基金资产配比 0.681366931

期末添利A资产净值 1,003

添利A资产配置比例 1.135

添利A资产配置比例 211,715,073.36

添利B资产配置比例 1,141

添利B资产配置比例 1.141

添利A收益(税后) 1.141

添利B收益(税后) 1.3906

添利A的年收益率率 3.90%

添利B的年收益率率 3.90%

注:1.本基金合同于2010年12月1日生效。

2.本报告期,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 其他指标

报告期 2013年10月1日-2013年12月31日

添利A与添利B基金资产配比 0.681366931

期末添利A资产净值 1,003

添利A资产配置比例 1.135

添利A资产配置比例 211,715,073.36

添利B资产配置比例 1,141

添利B资产配置比例 1.141

添利A收益(税后) 1.141

添利B收益(税后) 1.3906

添利A的年收益率率 3.90%

添利B的年收益率率 3.90%

注:1.本基金合同于2010年12月1日生效。

2.本报告期,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 其他指标

报告期 2013年10月1日-2013年12月31日

添利A与添利B基金资产配比 0.681366931

期末添利A资产净值 1,003

添利A资产配置比例 1.135

添利A资产配置比例 211,715,073.36

添利B资产配置比例 1,141

添利B资产配置比例 1.141

添利A收益(税后) 1.141

添利B收益(税后) 1.3906

添利A的年收益率率 3.90%

添利B的年收益率率 3.90%

注:1.本基金合同于2010年12月1日生效。

2.本报告期,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 其他指标

报告期 2013年10月1日-2013年12月31日

添利A与添利B基金资产配比 0.681366931

期末添利A资产净值 1,003

添利A资产配置比例 1.135

添利A资产配置比例 211,715,073.36

添利B资产配置比例 1,141

添利B资产配置比例 1.141

添利A收益(税后) 1.141

添利B收益(税后) 1.3906

添利A的年收益率率 3.90%

添利B的年收益率率 3.90%

注:1.本基金合同于2010年12月1日生效。

2.本报告期,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 其他指标

报告期 2013年10月1日-2013年12月31日

添利A与添利B基金资产配比 0.681366931

期末添利A资产净值 1,003

添利A资产配置比例 1.135

添利A资产配置比例 211,715,073.36

添利B资产配置比例 1,141

添利B资产配置比例 1.141

添利A收益(税后) 1.141

添利B收益(税后) 1.3906

添利A的年收益率率 3.90%

添利B的年收益率率 3.90%

注:1.本基金合同于2010年12月1日生效。

2.本报告期,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 其他指标

报告期 2013年10月1日-2013年12月31日

添利A与添利B基金资产配比 0.681366931

期末添利A资产净值 1,003

添利A资产配置比例 1.135

添利A资产配置比例 211,715,073.36

添利B资产配置比例 1,141