

天弘丰利债券型证券投资基金(LOF)

2018年第三季度报告

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
2018年3季度,短期经济韧性仍在,但逐步有趋弱迹象,市场对于基本面下行有较强预期;通胀方面,PPI由于基数原因开始下行,但是CPI由于猪肉、寿光水灾等因素导致的价格反弹,同比增速有所上行,市场对通胀的担忧较为强烈。政策方面,政府转向推动宽信用,政策方向有所调整。资金方面,3季度初资金面快速转向宽松,与货币政策时滞有关,此后逐步收敛。债市方面,总体呈现宽幅震荡态势,信用债由于宽信用政策,信用利差出现了一波明显修复。

4.5 报告期内基金的投资表现
截至2018年09月30日,本基金份额净值为1.1945元,本报告期份额净值增长率2.09%,同期业绩比较基准增长率0.57%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明
本报告期内本基金管理人无应说明预警信息。

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	-	-
2	固定收益	-	-
3	基金投资	-	-
4	买入返售金融资产	56,009,062.00	91.96
5	银行存款	56,009,062.00	91.96
6	应收利息	-	-
7	其他资产	-	-
8	其他负债	-	-
9	合计	60,697,426.72	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和分类的债券投资组合

序号	债券品种	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	-	-	-
2	央行票据	-	-	-
3	金融债	-	-	-
4	企业债	-	-	-
5	可转债(可交换债)	-	-	-
6	同业存单	-	-	-
7	其他	-	-	-
8	合计	-	-	-

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	180210	18国债10	200,000	19,746,000.00	33.00
2	180204	18国债04	60,000	5,926,400.00	10.00
3	182424	18国债24	80,100	5,726,410.00	9.58
4	140205	14国债05	90,000	5,504,400.00	9.23
5	130103	13国债03	260,000	5,467,200.00	9.18

5.6 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 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超出基金合同规定之备选股票库的情况。
5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	30,729.42
2	应收利息	1.23
3	应收股利	-
4	应收利息	769,434.43
5	应收申购款	146,473.81
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	944,637.86

5.12 影响投资者决策的其他重要信息
本报告期内,本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

9.1 备查文件目录
1、中国证监会批准天弘丰利分级债券型证券投资基金募集的文件
2、天弘丰利债券型证券投资基金(LOF)基金合同
3、天弘丰利债券型证券投资基金(LOF)托管协议
4、天弘丰利债券型证券投资基金(LOF)招募说明书
5、报告期内在指定报刊上披露的各项公告
6、中国证监会规定的其他文件
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办公场所或网站或基金托管人的办公场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印件或电子件。
公司网站:www.thfund.com.cn

天弘安康颐养混合型证券投资基金

2018年第三季度报告

充裕,市场收益率快速下行,10年期国债收益率逐月累计下行20bp,但中间出现了一定反弹,原因有二:一是猪周期,寿光水灾,PTA涨价等因素使得市场对通胀上行预期较大;二是前期债市已经对资金宽松预期和经济下行预期等利多因素进行了反应,需要新的因素触发;三是担忧地方债大量供给给消耗市场流动性,对利率债形成挤压。

在报告期内,本基金比较敏感地抓住了市场机会,根据交易系统发出的信号进行了增强交易。同时适度将久期适度拉长。

4.5 报告期内基金的投资表现
截至2018年09月30日,本基金份额净值为1.520元,本报告期份额净值增长率1.20%,同期业绩比较基准增长率0.73%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明
本报告期内本基金管理人无应说明预警信息。

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	74,528,328.10	628
2	固定收益	74,528,328.10	628
3	基金投资	-	-
4	买入返售金融资产	976,721,461.20	9019
5	银行存款	976,721,461.20	9019
6	应收利息	-	-
7	其他资产	-	-
8	其他负债	-	-
9	合计	1,022,269,138.11	100.00

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	制造业	-	-
C	建筑业	-	-
D	批发和零售业	30,131,466.10	2.85
E	交通运输、仓储和邮政业	-	-
F	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
G	金融业	36,182,671.00	4.28
H	房地产业	-	-
I	租赁和商务服务业	-	-
J	科学研究和技术服务业	-	-
K	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
L	建筑业	-	-
M	水利、环境和公共设施管理业	-	-
N	卫生、社会保障和社会福利业	-	-
O	教育	-	-
P	文化、体育和娱乐业	3,469,200.00	0.42
Q	综合	-	-
合计		74,528,328.10	628

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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	000002	万科A	276,000	16,742,500.00	1.62
2	000001	平安银行	300,000	10,452,000.00	1.23
4	002620	金风科技	790,500	9,407,350.00	1.17
5	000838	五矿发展	112,322	7,473,400.00	0.84
6	601136	中信国安	109,566	7,528,471.00	0.82
7	600308	招商银行	200,000	6,138,000.00	0.75
8	002243	聚友传媒	200,000	5,205,200.00	0.62
9	000513	中粮地产	79,170	2,489,355.00	0.31
10	300724	乐视网	3,070	16,963.00	0.01

5.4 报告期末按债券品种和分类的债券投资组合

序号	债券品种	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	-	-	-
2	央行票据	-	-	-
3	金融债	-	-	-
4	企业债	-	-	-
5	可转债(可交换债)	-	-	-
6	同业存单	-	-	-
7	其他	-	-	-
8	合计	-	-	-

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	180210	18国债10	1,500,000	14,856,000.00	30.04
2	122208	12国债08	800,000	60,478,000.00	7.29
3	112890	11国债90	500,000	50,288,000.00	6.14
4	122427	12国债27	500,000	48,220,000.00	5.88
5	100424	10国债24	400,000	48,220,000.00	6.03

5.6 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,均为基金合同规定备选股票库之内的股票。
5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	271,753.13
2	应收证券清算款	6,256,470.11
3	应收股利	-
4	应收利息	4,281,208.64
5	应收申购款	1,100.00
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	9,067,711.92

5.12 影响投资者决策的其他重要信息
本报告期内,本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

9.1 备查文件目录
1、中国证监会批准天弘安康养老混合型证券投资基金募集的文件
2、天弘安康颐养混合型证券投资基金基金合同
3、天弘安康颐养混合型证券投资基金托管协议
4、天弘安康颐养混合型证券投资基金招募说明书
5、报告期内在指定报刊上披露的各项公告
6、中国证监会规定的其他文件
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办公场所或网站或基金托管人的办公场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印件或电子件。
公司网站:www.thfund.com.cn

天弘弘利债券型证券投资基金

2018年第三季度报告

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
2018年3季度,随着央行货币政策基调从合理稳定转向合理充裕,市场收益率快速下行,10年期国债收益率逐月累计下行20bp,但中间出现了一定反弹,原因有二:一是猪周期、寿光水灾、PTA涨价等因素使得市场对通胀上行预期较大;二是前期债市已经对资金宽松预期和经济下行预期等利多因素进行了反应,需要新的因素触发;三是担忧地方债大量供给给消耗市场流动性,对利率债形成挤压。

在报告期内,本基金比较敏感地抓住了市场机会,根据交易系统发出的信号进行了增强交易。同时适度将久期适度拉长。

4.5 报告期内基金的投资表现
截至2018年09月30日,本基金份额净值为1.192元,本报告期份额净值增长率0.59%,同期业绩比较基准增长率0.89%。

4.6 报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明
本报告期内本基金管理人无应说明预警信息。

5.1 报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金资产净值比例(%)
1	权益投资	23,426,741.80	8.85
2	固定收益	23,426,741.80	8.85
3	基金投资	-	-
4	买入返售金融资产	216,600,000.00	81.23
5	银行存款	216,600,000.00	81.23
6	应收利息	-	-
7	其他资产	-	-
8	其他负债	-	-
9	合计	259,626,743.60	96.88

5.2 报告期末按行业分类的股票投资组合

代码	行业类别	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
A	农、林、牧、渔业	-	-
B	制造业	-	-
C	建筑业	-	-
D	批发和零售业	20,769,266.00	9.30
E	交通运输、仓储和邮政业	-	-
F	信息传输、软件和信息技术服务业	-	-
G	金融业	-	-
H	房地产业	-	-
I	租赁和商务服务业	-	-
J	科学研究和技术服务业	-	-
K	电力、热力、燃气及水生产和供应业	-	-
L	建筑业	-	-
M	水利、环境和公共设施管理业	-	-
N	卫生、社会保障和社会福利业	-	-
O	教育	-	-
P	文化、体育和娱乐业	-	-
Q	综合	-	-
合计		23,426,741.80	93.37

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

序号	股票代码	股票名称	数量(股)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	600304	招商证券	7,800	5,548,000.00	2.45
2	002204	华信转债	2,500,000	2,400,000.00	1.28
3	600780	中顺纸业	70,000	2,701,200.00	1.20
4	600877	航天机电	126,131	2,701,065.10	1.23
5	600220	中顺纸业	174,500	2,469,950.00	1.18
6	600111	诺德股份	96,340	2,469,950.00	1.18
7	600583	海航机场	447,200	2,469,200.00	1.14
8	002620	金风科技	129,400	1,806,100.00	0.80

5.4 报告期末按债券品种和分类的债券投资组合

序号	债券品种	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国债	-	-	-
2	央行票据	-	-	-
3	金融债	-	-	-
4	企业债	-	-	-
5	可转债(可交换债)	-	-	-
6	同业存单	-	-	-
7	其他	-	-	-
8	合计	-	-	-

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

序号	债券代码	债券名称	数量(张)	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	143076	14国债07	220,000	22,220,000.00	9.86
2	101054900	10国债01	200,000	19,900,000.00	8.81
3	126250	12国债50	200,000	19,900,000.00	8.81
4	130229	13国债29	200,000	19,900,000.00	8.81

5.6 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,均为基金合同规定备选股票库之内的股票。
5.11.3 其他资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	222,260,000.00
2	应收证券清算款	729,000.00
3	应收股利	-
4	应收利息	33,481,649.60
5	应收申购款	189,561,072.60

5.12 影响投资者决策的其他重要信息
本报告期内,本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

9.1 备查文件目录
1、中国证监会批准天弘弘利债券型证券投资基金募集的文件
2、天弘弘利债券型证券投资基金基金合同
3、天弘弘利债券型证券投资基金托管协议
4、天弘弘利债券型证券投资基金招募说明书
5、报告期内在指定报刊上披露的各项公告
6、中国证监会规定的其他文件
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办公场所或网站或基金托管人的办公场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印件或电子件。
公司网站:www.thfund.com.cn

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:2018年10月24日

§1 重要提示
基金管理人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2018年10月24日复核了本报告内容,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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,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。
本报告期内基金未发生诉讼、仲裁事项。
本报告期自2018年07月01日起至2018年09月30日止。

§2 基金产品概况

基金名称	天弘丰利债券型证券投资基金(LOF)
场内简称	天弘丰利
基金主代码	646008
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日期	2011年11月23日
报告期内基金申购总额	50,200,171.99元
报告期内基金赎回总额	1,500,644.80元
报告期内基金净申购总额	48,699,527.19元
期末基金份额总额	1,949,128,183.02份

§3 主要财务指标和基金净值表现

主要财务指标	报告期(2018年07月01日-2018年09月30日)	单位:人民币元
1.本期已实现收益	1,906,644.80	
2.本期利润	2,000,639.67	
3.加权平均基金份额本期利润	0.01045	
4.期末基金份额净值	99.736,662.92	

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低于所列数字。
3、本基金合同于2011年11月23日生效。
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	净值增长率标准差	业绩比较基准收益率	业绩比较基准收益率标准差	①-③	②-④
过去三个月	2.09%	0.046%	0.57%	0.07%	1.52%	0.01%

3.2.2 自基金转型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

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:2018年10月24日

§1 重要提示
基金管理人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2018年10月24日复核了本报告内容,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,也不保证基金份额持有人的本金不受损失,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。
本报告期内基金未发生诉讼、仲裁事项。
本报告期自2018年07月01日起至2018年09月30日止。