

天弘添利分级债券型证券投资基金

【2012】第四季度报告

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:二〇一三年一月二十二日

§ 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。

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。

本报告期财务资料未经审计。

本报告期自2012年10月1日起至2012年12月31日止。

§ 2 基金产品概况

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 162040

基金运作方式 约定的证券投资基金，本基金《基金合同》生效之日起3年内，添利A自基金合同生效之日起封闭3个月开放一次，添利B封闭运作并上市交易，本基金《基金合同》生效后3年期届满，本基金转换为场内开放式基金(LOF)。

基金合同生效日 2010年12月31日

报告期末基金份额总额 2,458,524,087.50份

投资目标 本基金在追求基金资产稳定增值的基础上，力求获取高于行业基准的稳定的投资收益。

投资策略 本基金通过对宏观经济增长、通胀水平、利率走势和货币政策四个方面的分析预测，结合对股票市场的判断，基于对类券种对利率、通胀的反应，制定合理的投资策略，在控制利率风险、信用风险以及流动性风险的前提下，主动建仓及调整固收投资组合，力争获取超额收益。此外，通过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，其风险收益特征高于货币市场基金，但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 添利A 添利B

下属两级基金的交易代码 162040 150027

A类 B类

报告期末下属两级基金的份额总额 1,458,524,255.83份 999,797,831.67份

下属两级基金的风险收益特征 低风险 收益相对稳定 高风险 收益较高

注：基金合同生效之日起5年内，在深圳证券交易所上市交易并封闭运作的基金份额简称添利添利

§ 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(2012年10月1日-2012年12月31日)

本期已实现收益 56,844,300.31

本期利润 49,624,490.27

加权平均基金份额本期利润 0.0176

期末基金资产净值 2,631,287,346.48

期末基金份额净值 1.0700

注：1.本公司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，本期利润为本公司已实现收益加上本期公允价值变动收益。

2.本期基金份额净值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），计入费用后实际净值将低于原有净值。

3.报告期3、4、5、6、7、8、9、10、11、12月的各月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

金额单位：人民币元

报告期末 其他指标

添利A与添利B基金份额配比 1,458,527,671.1

添利A末日参考净值 1.003

添利B末日参考净值 1.091

添利A累计计价份额 157,304,171.68

添利B累计计价份额 1.168

添利A年收益率 3.90%

添利B年收益率 3.90%

注：根据基金合同的规定，添利A的年收益率将在每次开放日设定一次公告。截至本报告期期末，添利A年收益率为3.90%。本报告期内 2012年10月1日至2012年12月31日期间，添利A的年收益率为3.90%。

§ 4 管理人报告

4.1 基金简介

姓名 职务 任本基金的基金经理期限 任职日期 证券从业年限 说明

陈钢 基金经理 经理助理 天弘基金管理有限公司 历任华泰证券公司固定收益部高级经理，北京信托投资公司投资经理，兴业银行资产管理部高级经理，北京信托投资公司机构部高级经理，中国人寿资产管理部固定收益部高级经理，中国人寿资产管理部固定收益部总经理。2011年加入本公司。

注：1.上述任职日期为本基金经理对外披露的任职日期。
2.证券从业人员含义遵行业协会《证券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守法律法规的情况说明

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。

基金管理人的董事会及董事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。

本报告财务数据未经审计。

本报告期内 2012年10月1日至2012年12月31日止。

§ 5 报告期内本基金各项投资比例达到基金合同约定的各项比例要求。

5.1 主要财务指标和基金净值表现

5.2 报告期末基金资产组合情况

序号 项目 金额(元) 占基金总资产的比例(%)

1 固定收益投资 - -

其中：股票 - -

2 固定收益投资 3,319,661,461.30 92.63

其中：债券 3,319,661,461.30 92.63

3 金融衍生品投资 - -

其中：权证 - -

4 买入返售金融资产 - -

其中：买断式回购的买入返售金融资产 - -

5 银行存款和结算备付金合计 122,824,865.74 3.43

6 其他各项资产 141,267,470.84 3.94

7 合 计 3,583,753,797.88 100.00

5.3 报告期末按行业分类的股票投资组合

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 采掘业 - -

C 制造业 - -

D 交通运输、仓储业 - -

E 电力、煤气及水的生产和供应业 - -

F 建筑业 - -

G 交通运输、仓储业 - -

H 批发和零售贸易 - -

I 金融、保险业 - -

J 房地产业 - -

K 社会服务业 - -

L 传播与文化产业 - -

M 综合类 - -

5.4 报告期末按行业分类的债券投资组合

序号 债券品种 公允价值(元) 占基金资产净值比例(%)

1 国家债券 - -

2 政府债券 - -

3 金融债券 169,547,000.00 6.44

其中：政策性金融债 169,547,000.00 6.44

4 企业债券 2,814,918,838.70 106.98

5 企业短期融资券 100,728,000.00 3.83

6 中期票据 190,612,000.00 7.24

7 可转债 43,855,622.60 1.67

8 合 计 3,191,661,461.30 126.16

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股票投资明细

5.6 报告期末按资产支持证券投资的前十名资产支持证券

5.7 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的前五名权证投资明细

5.8 投资组合报告

5.9 投资组合报告附注

5.10 投资组合报告附注

5.11 投资组合报告附注

5.12 投资组合报告附注

5.13 投资组合报告附注

5.14 投资组合报告附注

5.15 投资组合报告附注

5.16 投资组合报告附注

5.17 投资组合报告附注

5.18 投资组合报告附注

5.19 投资组合报告附注

5.20 投资组合报告附注

5.21 投资组合报告附注

5.22 投资组合报告附注

5.23 投资组合报告附注

5.24 投资组合报告附注

5.25 投资组合报告附注

5.26 投资组合报告附注

5.27 投资组合报告附注

5.28 投资组合报告附注

5.29 投资组合报告附注

5.30 投资组合报告附注

5.31 投资组合报告附注

5.32 投资组合报告附注

5.33 投资组合报告附注

5.34 投资组合报告附注

5.35 投资组合报告附注

5.36 投资组合报告附注

5.37 投资组合报告附注

5.38 投资组合报告附注

5.39 投资组合报告附注

5.40 投资组合报告附注

5.41 投资组合报告附注

5.42 投资组合报告附注

5.43 投资组合报告附注

5.44 投资组合报告附注

5.45 投资组合报告附注

5.46 投资组合报告附注

5.47 投资组合报告附注

5.48 投资组合报告附注

5.49 投资组合报告附注

5.50 投资组合报告附注

5.51 投资组合报告附注

5.52 投资组合报告附注

5.53 投资组合报告附注

5.54 投资组合报告附注

5.55 投资组合报告附注

5.56 投资组合报告附注

5.57 投资组合报告附注

<p