# 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年第4季度报告

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

报告送出日期：2016年1月22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。

基金托管人海通证券股份有限公司根据本基金合同规定，于2016年01月18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。

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）"。原天弘添利分级债券型证券投资基金本报告期自2015年10月1日至2015年12月03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 基金产品概况

**转型后**

| | |
|---|---|
| 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3日 |
| 报告期末基金份额总额 | 1,579,387,495.06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。 |
| 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 |

**转型前**

| | |
|---|---|
| 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 | 契约型证券投资基金，本基金《基金合同》生效之日起5年内，添利A自《基金合同》生效之日起每满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5年期届满，本基金转换为上市开放式基金（LOF）。 |
| 基金合同生效日 | 2010年12月3日 |
| 报告期末基金份额总额 | 1,565,366,742.85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。 | |
| 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 |
| 下属分级基金的场内简称 | - | 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 | 112,329,182.86 | 999,979,831.67 |
| 下属两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 |

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为添利B。

## §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 | 转型后 |
|---|---|
| | 报告期（2015年12月4日-2015年12月31日） |
| 1.本期已实现收益 | 8,357,313.19 |
| 2.本期利润 | 12,720,581.29 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0085 |
| 4.期末基金资产净值 | 1,593,294,433.85 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.009 |

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。

### 3.1 主要财务指标

单位：人民币元

| 主要财务指标 | 转型前 |
|---|---|
| | 报告期（2015年10月1日-2015年12月3日） |
| 1.本期已实现收益 | 23,118,430.54 |
| 2.本期利润 | 17,710,209.01 |
| 3.加权平均基金份额本期利润 | 0.0156 |
| 4.期末基金资产净值 | 1,565,366,742.85 |
| 5.期末基金份额净值 | 1.000 |

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（转型后）

### 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

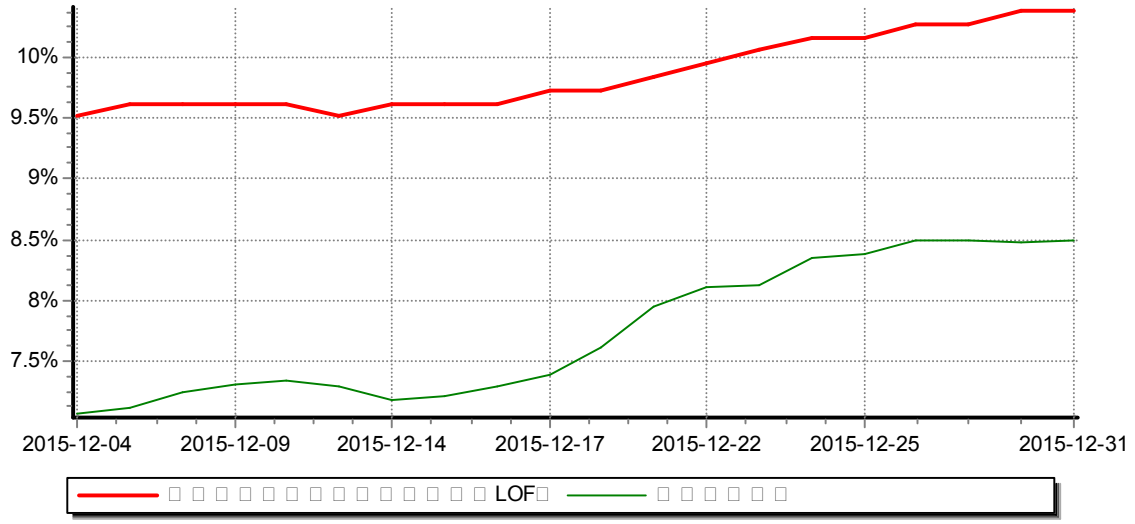
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月（2015年12月4日至2015年12月31日） | 0.90% | 0.06% | 1.43% | 0.09% | -0.53% | -0.03% |

### 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

天弘添利债券型证券投资基金（LOF）

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4日-2015年12月31日）




注：1、本基金合同于2010年12月03日生效，本基金于2015年12月03日五年封闭期届满，封闭期届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）"，封闭期届满日为本基金份额转换基准日，自本基金转型起至披露时点不满一年。

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。

## 3.2 基金净值表现（转型前）

### 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

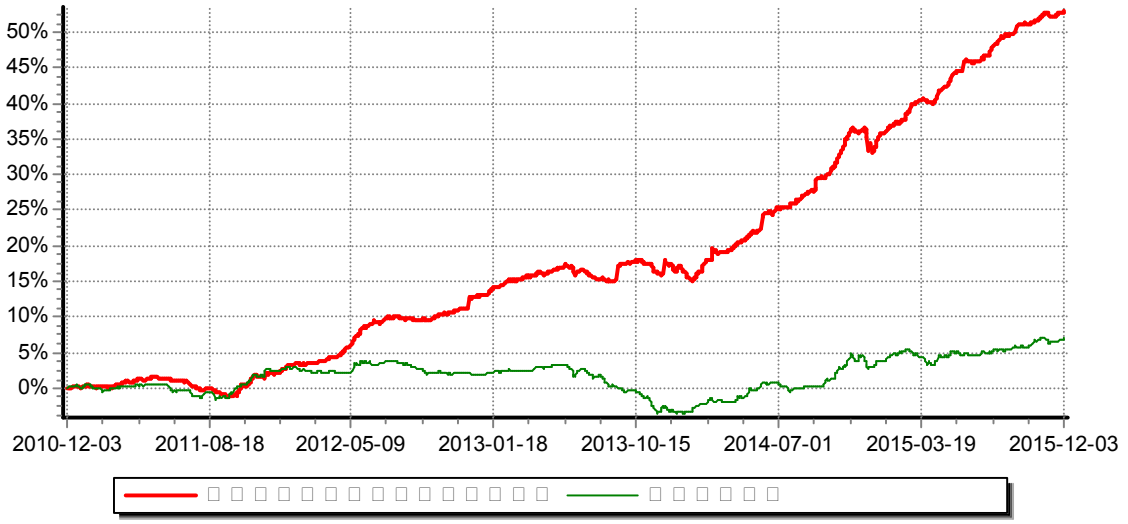
| 阶段 | 净值增长率① | 净值增长率标准差② | 业绩比较基准收益率③ | 业绩比较基准收益率标准差④ | ①-③ | ②-④ |
|---|---|---|---|---|---|---|
| 过去三个月（2015年10月1日至2015年12月3日） | 1.19% | 0.06% | 0.92% | 0.12% | 0.27% | -0.06% |

### 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

天弘添利分级债券型证券投资基金

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3日-2015年12月3日）




注：1、本基金合同于2010年12月3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。

### 3.3 其他指标（转型前）

## §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 | | |
| 陈钢 | 本基金基金经理；本公司副总经理、固定收益总监兼固定收益部总经理。 | 2011年11月 | — | 13年 | 男，工商管理硕士。历任华龙证券公司固定收益部高级经理；北京宸星投资管理公司投资经理；兴业证券公司债券总部研究部经理；银华基金管理有限公司机构理财部高级经理；中国人寿资产管理有限公司固定收益部高级投资经理。2011年加盟本公司，历任天弘永利 |

| | | | | | |
|---|---|---|---|---|---|
| | | | | | 债券型证券投资基金基金经理。 |

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 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资讯；公平对待不同投资组合，禁止各投资组合之间进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异常交易。

本报告期内，未出现违反公平交易制度的情况，公司旗下各基金不存在因非公平交易等导致的利益输送行为，公平交易制度的整体执行情况良好。

### 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

2015年四季度，经济基本面整体延续疲弱，虽然后半段经济有一定企稳迹象，但是弱势格局短期内无法根本性扭转。以基建投资扩张为核心的经济托底政策，无法充分对冲内需快速回落的冲击，只能在一定程度上延缓经济增速回落的速度，无法扭转整体的趋势。政策方面，经济下行压力大以及外汇流出加剧等因素使得货币政策依然处于宽松途中，央行于四季度继续进行了降准降息等宽松操作，呵护二季度以来流动性的宽松局面。资金面方面，得益于央行构建利率走廊的政策意图，资金利率稳定性显著提升。在基本面、政策面和资金面三方配合，以及资产荒格局下增量资金的涌入，债券收益率出现显著下行，尤其是利率债收益率一举突破前期低点，走出了一轮牛市。

本基金在报告期内，前期判断资产荒因素将利好债市，总体维持适当久期和较高杠杆，随后认为IPO重启概率大增等因素可能给市场带来冲击，降低了组合久期和杠杆水平，成功规避了风险，在冲击过去之后再度对组合适当延长久期、增加仓位，为客户创造了较高的稳健收益。

## 4.5 报告期内基金的业绩表现

截至2015年12月31日（2015年12月4日至2015年12月31日），本基金的基金份额净值为1.009元，本报告期份额净值增长率为0.90%，同期业绩比较基准增长率为1.43%。

截至2015年12月3日（2015年10月1日至2015年12月3日），本基金的基金份额净值为1.000元，本报告期份额净值增长率为1.19%，同期业绩比较基准增长率为0.92%。

## 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。

## 4.7 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2016年一季度，基本面方面，虽然前期稳增长政策的累积效应逐渐显现，对经济有一定支撑作用，但是经济下行压力仍存，且中央有意推进供给侧结构性改革，去产能过程将对经济增长形成进一步冲击，并且对CPI通胀也将形成制约，基本面对债市仍属利好。政策方面，虽然目前货币政策有转趋稳健的迹象，但在经济杠杆率较高、企业还本付息压力仍大的情况下宽松基调仍是应有之义，预计货币政策仍将维持稳健偏松态势。资金面方面，央行对于资金面的控制能力已经经过2015年的多重考验，而且目前央行也有动力维持资金面稳定，因此2016年资金面仍将维持相对稳定的态势，如果后续有进一步降息的操作，当前相对较高的资金利率大概率也将相应下调，从而

打开债券收益率进一步下行的空间。除此之外，我们认为资产稀缺的状况难以发生根本性的扭转，资产荒的状况依旧具有持续性，债市仍有增量资金入场。综合以上因素，债券市场一季度行情整体仍将趋暖。

投资策略上，本基金将密切跟踪宏观经济形势，及时调整组合策略，同时信用风险暴露阶段，细心甄别个券，降低组合信用风险，继续为投资者赚取稳健收益。

## §5 投资组合报告

**转型后：**

**报告期（2015年12月4日-2015年12月31日）**

### 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 | 固定收益投资 | 1,407,157,129.93 | 87.83 |
| | 其中：债券 | 1,407,157,129.93 | 87.83 |
| | 资产支持证券 | — | — |
| 3 | 贵金属投资 | — | — |
| 4 | 金融衍生品投资 | — | — |
| 5 | 买入返售金融资产 | — | — |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | — | — |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计 | 63,634,478.62 | 3.97 |
| 7 | 其他资产 | 131,320,101.05 | 8.20 |
| 8 | 合计 | 1,602,111,709.60 | 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 | 50,087,000.00 | 3.14 |
| | 其中：政策性金融债 | 50,087,000.00 | 3.14 |
| 4 | 企业债券 | 1,314,200,551.00 | 82.48 |
| 5 | 企业短期融资券 | 30,161,000.00 | 1.89 |
| 6 | 中期票据 | — | — |
| 7 | 可转债 | 12,708,578.93 | 0.80 |
| 8 | 同业存单 | — | — |
| 9 | 其他 | — | — |
| 10 | 合计 | 1,407,157,129.93 | 88.32 |

注：可转债项下包含可交换债4,340,201.20元。

## 5.5 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(元) | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 1480460 | 14十堰城投债 | 1,000,000 | 108,170,000.00 | 6.79 |
| 2 | 1480466 | 14绍交投债 | 1,000,000 | 107,570,000.00 | 6.75 |
| 3 | 122844 | 11筑城投 | 1,000,000 | 103,750,000.00 | 6.51 |
| 4 | 1480453 | 14龙海债 | 800,000 | 85,992,000.00 | 5.40 |
| 5 | 122882 | 10宁高新 | 800,010 | 82,545,031.80 | 5.18 |

## 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名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中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**

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 65,791.91 |
| 2 | 应收证券清算款 | — |
| 3 | 应收股利 | — |
| 4 | 应收利息 | 29,640,074.34 |
| 5 | 应收申购款 | 101,614,234.80 |
| 6 | 其他应收款 | — |
| 7 | 待摊费用 | — |
| 8 | 其他 | — |
| 9 | 合计 | 131,320,101.05 |

**5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细**

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|

| | | | | |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 113008 | 电气转债 | 6,963,348.60 | 0.44 |
| 2 | 110031 | 航信转债 | 753,072.00 | 0.05 |

**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。

## §5 投资组合报告

**转型前：**

**报告期（2015年10月1日-2015年12月3日）**

**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 | 固定收益投资 | 1,516,381,139.80 | 92.09 |
| | 其中：债券 | 1,516,381,139.80 | 92.09 |
| | 资产支持证券 | — | — |
| 3 | 贵金属投资 | — | — |
| 4 | 金融衍生品投资 | — | — |
| 5 | 买入返售金融资产 | — | — |
| | 其中：买断式回购的买入返售金融资产 | — | — |
| 6 | 银行存款和结算备付金合计 | 83,829,546.01 | 5.09 |
| 7 | 其他资产 | 46,409,883.36 | 2.82 |
| 8 | 合计 | 1,646,620,569.17 | 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 | 50,030,000.00 | 3.20 |
| | 其中：政策性金融债 | 50,030,000.00 | 3.20 |
| 4 | 企业债券 | 1,456,538,963.90 | 93.05 |
| 5 | 企业短期融资券 | — | — |
| 6 | 中期票据 | — | — |
| 7 | 可转债 | 9,812,175.90 | 0.63 |
| 8 | 同业存单 | — | — |
| 9 | 其他 | — | — |
| 10 | 合计 | 1,516,381,139.80 | 96.87 |

注：可转债项下包含可交换债2,425,536.90元。

## 5.5 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(元) | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|---|
| 1 | 1480460 | 14十堰城投债 | 1,000,000 | 106,600,000.00 | 6.81 |
| 2 | 1480466 | 14绍交投债 | 1,000,000 | 105,990,000.00 | 6.77 |
| 3 | 122872 | 10复星债 | 1,000,000 | 104,400,000.00 | 6.67 |
| 4 | 122844 | 11筑城投 | 1,000,000 | 103,690,000.00 | 6.62 |
| 5 | 1480453 | 14龙海债 | 800,000 | 84,736,000.00 | 5.41 |

## 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名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中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**

单位：人民币元

| 序号 | 名称 | 金额 |
|---|---|---|
| 1 | 存出保证金 | 65,791.91 |
| 2 | 应收证券清算款 | 6,933,839.02 |
| 3 | 应收股利 | — |
| 4 | 应收利息 | 39,405,648.99 |
| 5 | 应收申购款 | — |
| 6 | 其他应收款 | — |
| 7 | 待摊费用 | 4,603.44 |
| 8 | 其他 | — |
| 9 | 合计 | 46,409,883.36 |

### 5.11.4 报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

金额单位：人民币元

| 序号 | 债券代码 | 债券名称 | 公允价值(元) | 占基金资产净值比例（%） |
|---|---|---|---|---|
| 1 | 113008 | 电气转债 | 6,633,567.00 | 0.42 |

### 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

| | |
|---|---|
| 基金转型起始日（2015年12月4日）基金份额总额 | 1,565,366,742.85 |
| 基金转型起始日至报告期期末基金总申购份额 | 215,424,102.36 |
| 减：基金转型起始日至报告期期末基金总赎回份额 | 201,403,350.15 |
| 基金转型起始日至报告期期末基金拆分变动份额（份额减少以“-”填列） | — |
| 报告期期末基金份额总额 | 1,579,387,495.06 |

注：本基金合同于2010年12月03日生效。本基金于2015年12月03日五年封闭期届满，封闭期届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）"，封闭期届满日为本基金份额转换基准日。

## §7 基金管理人运用固有资金投资基金情况

本基金本报告期（包括转型前、后）未有基金管理人运用固有资金投资本基金。

## §8 影响投资者决策的其他重要信息

截至本报告期末，根据本基金《基金合同》中相关约定，本基金已于2015年12月3日5年期届满并转型为上市开放式基金（LOF)。转型后本基金已于2015年12月15日在深圳证券交易所挂牌交易，并于同日开通申购、赎回等业务。投资者欲了解相关信息，敬请关注本公司在指定媒介披露的相关公告及届时更新的《招募说明书》中相关内容。

## §9 备查文件目录

### 9.1 备查文件目录

1、1、中国证监会批准天弘添利分级债券型证券投资基金募集的文件

2、天弘添利分级债券型证券投资基金基金合同

3、天弘添利分级债券型证券投资基金招募说明书

4、天弘添利分级债券型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**

**二〇一六年一月二十二日**