

# 天弘季加利理财债券型证券投资基金 招募说明书(更新)摘要

基金管理人：天弘基金管理有限公司

基金托管人：中国农业银行股份有限公司

日 期：二零一五年七月

## 重要提示

天弘季加利理财债券型证券投资基金（以下简称“本基金”）于 2014 年 5 月 20 日经中国证监会证监许可[2014]514 号文注册募集。中国证监会对本基金募集的注册，并不表明其对本基金的价值和收益作出实质性判断或保证，也不表明投资于本基金没有风险。本基金的基金合同于 2014 年 6 月 18 日正式生效。

本基金管理人保证招募说明书的内容真实、准确、完整。

投资有风险，投资者认购（或申购）本基金时应认真阅读本招募说明书。

证券投资基金是一种长期投资工具，其主要功能是分散投资，降低投资单一证券所带来的个别风险。基金投资不同于银行储蓄和债券等能够提供固定收益预期的金融工具，投资者购买基金，既可能按其持有份额分享基金投资所产生的收益，也可能承担基金投资所带来的损失。本基金投资中的风险包括：因整体政治、经济、社会等环境因素对证券市场价格产生影响而形成的系统性风险，个别证券特有的非系统性风险，由于基金份额持有人连续大量赎回基金产生的流动性风险，基金管理人在基金管理实施过程中产生的基金管理风险，本基金的特定风险等。

本基金为采用固定组合策略的短期理财债券型基金，属于证券投资基金中较低风险、预期收益较为稳定的品种，其预期的风险水平低于股票型基金、混合型基金和普通债券型基金。本基金可投资中小企业私募债券，当基金所投资的中小企业私募债券之债务人出现违约，或在交易过程中发生交收违约，或由于中小企业私募债券信用质量降低导致价格下降等，可能造成基金财产损失。此外，受市场规模及交易活跃程度的影响，中小企业私募债券可能无法在同一价格水平上进行较大数量的买入或卖出，存在一定的流动性风险，从而对基金收益造成影响。

投资者应当认真阅读《基金合同》、《招募说明书》等基金法律文件，了解基金的风险收益特征，根据自身的投资目的、投资经验、资产状况等判断基金是否和自身的风险承受能力相适应，并通过基金管理人或基金管理人委托的具有基金代销业务资格的其他机构购买基金。

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，但不保证本基金一定盈利，也不保证最低收益。基金管理人管理的其他基金的业绩并不构成对本基金业绩表现的保证。基金管理人提醒投资者注意基金投资的“买者自负”原则，在做出投资决策后，基金运营状况与基金净值变化引致的投资风险，由投资者自行承担。

基金招募说明书自基金合同生效之日起，每 6 个月更新一次，并于每 6 个月结束之日后的 45 日内公告。本招募说明书所载内容截止日为 2015 年 6 月 17 日，有关财务数据和净值表现截止日为 2015 年 3 月 26 日（财务数据未经审计）。

## 一、基金管理人

### (一) 基金管理人概况

名称：天弘基金管理有限公司

住所：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

办公地址：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

成立日期：2004 年 11 月 8 日

法定代表人：井贤栋

联系电话：（022）83310208

组织形式：有限责任公司

注册资本及股权结构

天弘基金管理有限公司（以下简称“公司”或“本公司”）经中国证券监督管理委员会批准（证监基金字[2004]164号），于2004年11月8日成立。公司注册资本为人民币5.143亿元，股权结构为：

股东名称	股权比例
浙江蚂蚁小微金融服务集团有限公司	51%
天津信托有限责任公司	16.8%
内蒙古君正能源化工集团股份有限公司	15.6%
芜湖高新投资有限公司	5.6%
新疆天瑞博丰股权投资合伙企业（有限合伙）	3.5%
新疆天惠新盟股权投资合伙企业（有限合伙）	2%
新疆天阜恒基股权投资合伙企业（有限合伙）	2%
新疆天聚宸兴股权投资合伙企业（有限合伙）	3.5%
合计	100%

截止2015年6月17日，本公司旗下管理的基金有天弘精选混合型证券投资基金、天弘永利债券型证券投资基金、天弘永定价值成长股票型证券投资基金、天弘周期策略股票型证券投资基金、天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金、天弘添利分级债券型证券投资基金、天弘丰利债券型证券投资基金（LOF）、天弘现金管家货币市场基金、天弘债券型发起式证券投资基金、天弘

安康养老混合型证券投资基金、天弘余额宝货币市场基金、天弘稳利定期开放债券型证券投资基金、天弘弘利债券型证券投资基金、天弘同利分级债券型证券投资基金、天弘通利混合型证券投资基金、天弘季加利理财债券型证券投资基金、天弘瑞利分级债券型证券投资基金、天弘沪深 300 指数型发起式证券投资基金、天弘中证 500 指数型发起式证券投资基金、天弘增益宝货币市场基金、天弘云端生活优选灵活配置混合型证券投资基金、天弘新活力灵活配置混合型发起式证券投资基金、天弘普惠养老保本混合型证券投资基金、天弘互联网灵活配置混合型证券投资基金、天弘惠利灵活配置混合型证券投资基金、天弘新价值灵活配置混合型证券投资基金。

公司下设股票投资、固定收益投资、中央交易、国际业务、品牌管理、渠道管理、互联网金融、机构理财、风险管理、监察稽核、信息技术、基金运营、公司财务、客户服务、综合管理、人力资源等部门和北京分公司、上海分公司、广州分公司、天津分公司。随着公司业务发展的需要，将对相关业务部门进行适当的调整。

基金管理人无任何处罚记录。

## (二) 主要人员情况

### 1、董事会成员基本情况：

井贤栋先生，董事长，硕士研究生。历任太古饮料有限公司旗下装瓶厂或业务单元的财务总监，广州百事可乐有限公司首席财务官，阿里巴巴（中国）信息技术有限公司财务副总裁，支付宝（中国）网络技术有限公司首席财务官。现任浙江蚂蚁小微金融服务集团有限公司首席运营官。

卢信群先生，副董事长，大学本科。历任君正国际投资（北京）有限公司研究员、研究部经理、投资部经理，乌海市君正科技有限责任公司副总裁，内蒙古君正能源化工集团股份有限公司董事、副总经理、财务总监、董事会秘书。现任北京博晖创新光电技术股份有限公司副董事长、总经理，君正国际投资（北京）有限公司董事。

袁雷鸣先生，董事，硕士研究生。历任中国银联股份有限公司法律专员。现任浙江蚂蚁小微金融服务集团有限公司金融事业部总经理。

屠剑威先生，董事，硕士研究生。历任中国工商银行浙江省分行营业部法

律事务处案件管理科副科长，香港永亨银行有限公司上海分行法律合规监察部经理，花旗银行（中国）有限公司合规部助理总裁，永亨银行（中国）有限公司法律合规部主管。现任浙江蚂蚁小微金融服务集团有限公司法务及合规部资深总监。

付岩先生，董事，大学本科。历任北洋（天津）物产集团有限公司期货部交易员，中国经济开发信托投资公司天津证券部投资部职员，顺驰（中国）地产有限公司资产管理部高级经理，天津信托有限责任公司投资银行部项目经理。现任天津信托有限责任公司自营业务部总经理。

郭树强先生，董事，总经理，硕士研究生。历任华夏基金管理有限公司交易主管、基金经理、研究总监、机构投资总监、投资决策委员会委员、机构投资决策委员会主任、公司管委会委员、公司总经理助理。现任本公司总经理，天弘创新资产管理有限公司总经理、董事。

魏新顺先生，独立董事，大学本科。历任天津市政府法制办执法监督处副处长，天津市政府法制办经济法规处处长，天津达天律师事务所律师。现任天津英联律师事务所主任律师。

张军先生，独立董事，博士研究生。历任复旦大学经济学系助教、讲师、副教授、教授。现任复旦大学发展研究院副院长、中国社会主义市场经济研究中心主任、经济学院院长。

贺强先生，独立董事，大学本科。历任黑龙江生产建设兵团员工，武汉理工大学员工。现任中央财经大学金融学院教授。

## 2、监事会成员基本情况

李琦先生，监事会主席，硕士研究生。历任天津市民政局事业处团委副书记，天津市人民政府法制办公室、天津市外经贸委办公室干部，天津信托有限责任公司条法处处长、总经理助理兼条法处处长、副总经理，本公司董事长。

张杰先生，监事，专科。现任内蒙古君正化工有限责任公司监事，乌海市君正矿业有限责任公司监事，内蒙古中鑫能源有限公司董事，内蒙古君正能源化工集团股份有限公司董事、董事会秘书兼董事会办公室主任、审计监察室主任。

方隽先生，监事，硕士研究生。历任厦门中恒信会计师事务所审计部门经

理，福建立信闽都会计师事务所副主任会计师，立信会计师事务所厦门分所副主任会计师。现任芜湖高新投资有限公司总经理。

韩海潮先生，监事，硕士研究生。历任三峡证券天津白堤路营业部、勤俭道营业部信息技术部经理，亚洲证券天津勤俭道营业部营运总监。现任本公司运营总监、信息技术总监兼信息技术部总经理，证通股份有限公司监事。

张牡霞女士，监事，硕士研究生。历任新华社上海证券报财经要闻部记者，本公司市场部电子商务专员、电子商务部业务拓展主管、总经理助理。现任本公司互联网金融业务部副总经理。

付颖女士，监事，硕士研究生。历任本公司监察稽核部信息披露专员、法务专员、合规专员、高级合规经理、部门主管。现任本公司监察稽核部副总经理。

### 3、高级管理人员基本情况

郭树强先生，董事，总经理，简历参见董事会成员基本情况。

陈钢先生，副总经理，硕士研究生。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7月份加盟本公司，现任公司副总经理、资深基金经理、固定收益总监兼固定收益部总经理，分管公司固定收益投资业务。

周晓明先生，副总经理，硕士研究生。历任中国证券市场研究院设计中心及其下属北京标准股份制咨询公司经理，万通企业集团总裁助理，中工信托有限公司投资部副总，国信证券北京投资银行一部经理，北京证券投资银行部副总，嘉实基金市场部副总监、渠道部总监，香港汇富集团高级副总裁，工银瑞信基金市场部副总监，嘉实基金产品和营销总监，盛世基金拟任总经理。

2011年8月加盟本公司，同月被任命为公司首席市场官，现任公司副总经理，分管公司电子商务业务。

宁辰先生，副总经理，硕士研究生。历任三峡证券投资分析师，亚洲证券天津勤俭道营业部部门经理和营销总监，亚洲证券天津管理总部总经理助理。2006年8月加盟本公司任市场部总经理，2011年4月任命为公司总经理助理，



现任公司副总经理，分管分公司渠道销售业务。

张磊先生，副总经理，硕士研究生。历任清华兴业投资管理公司证券分析师，嘉实基金基金直销经理，泰信基金北京理财中心经理，华夏基金机构理财部总经理，九鼎投资管理有限公司副总经理和合伙人，北京杰思汉能资产管理公司执行总裁。2012年10月加盟本公司，2012年11月任命为公司总经理助理，现任公司副总经理，分管公司机构业务。

童建林先生，督察长，大学本科，高级会计师。历任当阳市产权证券交易中心财务部经理、副总经理，亚洲证券有限责任公司宜昌总部财务主管、宜昌营业部财务部经理、公司财务会计总部财务主管，华泰证券有限责任公司上海总部财务项目主管，本公司基金会计、监察稽核部副总经理、监察稽核部总经理。现任本公司督察长。

#### 4、本基金基金经理

王登峰先生，男，经济学硕士。历任中信建投证券股份有限公司固定收益部高级经理。2012年加盟本公司，历任固定收益研究员。现任天弘现金管家货币市场基金基金经理；天弘余额宝货币市场基金基金经理；天弘季加利理财债券型证券投资基金基金经理；天弘增益宝货币市场基金基金经理。

#### 5、基金管理人投资决策委员会成员的姓名和职务

郭树强先生，董事、总经理，投资决策委员会主席、投资总监。

陈钢先生，本公司副总经理、固定收益总监兼固定收益部总经理，天弘添利 分级债券型证券投资基金基金经理、天弘丰利债券型证券投资基金（LOF）基金 经理、天弘债券型发起式证券投资基金基金经理、天弘同利分级债券型证券投资 基金基金经理、天弘稳利定期开放债券型证券投资基金基金经理、天弘弘利债券 型证券投资基金基金经理、天弘普惠养老保本混合型证券投资基金基金 基金经理。

钱文成先生，天弘精选混合型证券投资基金基金经理、天弘周期策略股票型 证券投资基金基金经理、天弘安康养老混合型证券投资基金基金经理、天弘通利 混合型证券投资基金基金经理、天弘新活力灵活配置混合型发起式证券投资 基金 基金经理、天弘普惠养老保本混合型证券投资基金基金经理。 招募说



明书

刘冬先生，宏观策略分析师。

肖志刚先生，投资研究部总经理，天弘精选混合型证券投资基金基金经理、天弘永定价值成长股票型证券投资基金基金经理、天弘周期策略股票型证券投资 基金基金经理、天弘云端生活优选灵活配置混合型证券投资基金基金经理、天弘 互联网灵活配置混合型证券投资基金基金经理。

李蕴炜先生，天弘鑫动力灵活配置混合型证券投资基金基金经理、天弘沪深 300 指数型发起式证券投资基金基金经理、天弘中证 500 指数型发起式证券投资 基金基金经理；

王登峰先生，天弘现金管家货币市场基金基金经理、天弘余额宝货币市场基金基金经理、天弘季加利理财债券型证券投资基金基金经理、天弘增益宝货币市场基金基金经理。

姜晓丽女士，天弘永利债券型证券投资基金基金经理、天弘安康养老混合型证券投资基金基金经理、天弘稳利定期开放债券型证券投资基金基金经理、天弘 通利混合型证券投资基金基金经理、天弘瑞利分级债券型证券投资基金基金经理、天弘新活力灵活配置混合型发起式证券投资基金基金经理。

上述人员之间不存在近亲属关系。

## 二、基金托管人

### (一) 托管人基本情况

#### 1、基本情况

名称：中国农业银行股份有限公司（简称中国农业银行）

住所：北京市东城区建国门内大街 69 号

办公地址：北京市西城区复兴门内大街 28 号凯晨世贸中心东座

法定代表人：刘士余

成立日期：2009 年 1 月 15 日

批准设立机关和批准设立文号：中国银监会银监复[2009]13 号

基金托管业务批准文号：中国证监会证监基字[1998]23 号

注册资本：32,479,411.7 万元人民币

存续期间：持续经营

联系电话：010-66060069

传真：010-68121816

联系人：林葛

中国农业银行股份有限公司是中国金融体系的重要组成部分，总行设在北京。经国务院批准，中国农业银行整体改制为中国农业银行股份有限公司并于 2009 年 1 月 15 日依法成立。中国农业银行股份有限公司承继原中国农业银行全部资产、负债、业务、机构网点和员工。中国农业银行网点遍布中国城乡，成为国内网点最多、业务辐射范围最广，服务领域最广，服务对象最多，业务功能齐全的大型国有商业银行之一。在海外，中国农业银行同样通过自己的努力赢得了良好的信誉，每年位居《财富》世界 500 强企业之列。作为一家城乡并举、联通国际、功能齐备的大型国有商业银行，中国农业银行一贯秉承以客户为中心的经营理念，坚持审慎稳健经营、可持续发展，立足县域和城市两大市场，实施差异化竞争策略，着力打造“伴你成长”服务品牌，依托覆盖全国的分支机构、庞大的电子化网络和多元化的金融产品，致力为广大客户提供优质的金融服务，与广大客户共创价值、共同成长。

中国农业银行是中国第一批开展托管业务的国内商业银行，经验丰富，服务优质，业绩突出，2004 年被英国《全球托管人》评为中国“最佳托管银行”

。2007年中国农业银行通过了美国 SAS70 内部控制审计，并获得无保留意见的 SAS70 审计报告，表明了独立公正第三方对中国农业银行托管服务运作流程的风险管理、内部控制的健全有效性的全面认可。中国农业银行着力加强能力建设，品牌声誉进一步提升，在 2010 年首届“‘金牌理财’ TOP10 颁奖盛典”中成绩突出，获“最佳托管银行”奖。2010 年再次荣获《首席财务官》杂志颁发的“最佳资产托管奖”。

中国农业银行证券投资基金托管部于 1998 年 5 月经中国证监会和中国人民银行批准成立，2004 年 9 月更名为托管业务部，内设养老金管理中心、技术保障处、营运中心、委托资产托管处、保险资产托管处、证券投资基金托管处、境外资产托管处、综合管理处、风险管理处，拥有先进的安全防范设施和基金托管业务系统。

## 2、主要人员情况

中国农业银行托管业务部现有员工 140 余名，其中高级会计师、高级经济师、高级工程师、律师等专家 10 余名，服务团队成员专业水平高、业务素质好、服务能力强，高级管理层均有 20 年以上金融从业经验和高级技术职称，精通国内外证券市场的运作。

## 3、基金托管业务经营情况

截止 2015 年 3 月 31 日，中国农业银行托管的封闭式证券投资基金和开放式证券投资基金共 254 只，包括富国天源平衡混合型证券投资基金、华夏平稳增长混合型证券投资基金、大成积极成长股票型证券投资基金、大成景阳领先股票型证券投资基金、大成创新成长混合型证券投资基金、长盛同德主题增长股票型证券投资基金、博时内需增长灵活配置混合型证券投资基金、汉盛证券投资基金、裕隆证券投资基金、景福证券投资基金、鸿阳证券投资基金、丰和价值证券投资基金、久嘉证券投资基金、长盛成长价值证券投资基金、宝盈鸿利收益证券投资基金、大成价值增长证券投资基金、大成债券投资基金、银河稳健证券投资基金、银河收益证券投资基金、长盛中信全债指数增强型债券投资基金、长信利息收益开放式证券投资基金、长盛动态精选证券投资基金、景顺长城内需增长开放式证券投资基金、万家增强收益债券型证券投资基金、大成精选增值混合型证券投资基金、长信银利精选开放式证券投资基金、富国天

瑞强势地区精选混合型证券投资基金、鹏华货币市场证券投资基金、中海分红增利混合型证券投资基金、国泰货币市场证券投资基金、新华优选分红混合型证券投资基金、交银施罗德精选股票证券投资基金、泰达宏利货币市场基金、交银施罗德货币市场证券投资基金、景顺长城资源垄断股票型证券投资基金、大成沪深 300 指数证券投资基金、信诚四季红混合型证券投资基金、富国天时货币市场基金、富兰克林国海弹性市值股票型证券投资基金、益民货币市场基金、长城安心回报混合型证券投资基金、中邮核心优选股票型证券投资基金、景顺长城内需增长贰号股票型证券投资基金、交银施罗德成长股票证券投资基金、长盛中证 100 指数证券投资基金、泰达宏利首选企业股票型证券投资基金、东吴价值成长双动力股票型证券投资基金、鹏华动力增长混合型证券投资基金、宝盈策略增长股票型证券投资基金、国泰金牛创新成长股票型证券投资基金、益民创新优势混合型证券投资基金、中邮核心成长股票型证券投资基金、华夏复兴股票型证券投资基金、富国天成红利灵活配置混合型证券投资基金、长信双利优选灵活配置混合型证券投资基金、富兰克林国海深化价值股票型证券投资基金、申万巴黎竞争优势股票型证券投资基金、新华优选成长股票型证券投资基金、金元惠理成长动力灵活配置混合型证券投资基金、天治稳健双盈债券型证券投资基金、中海蓝筹灵活配置混合型证券投资基金、长信利丰债券型证券投资基金、金元惠理丰利债券型证券投资基金、交银施罗德先锋股票证券投资基金、东吴进取策略灵活配置混合型开放式证券投资基金、建信收益增强债券型证券投资基金、银华内需精选股票型证券投资基金(LOF)、大成行业轮动股票型证券投资基金、交银施罗德上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金联接基金、上证 180 公司治理交易型开放式指数证券投资基金、富兰克林国海沪深 300 指数增强型证券投资基金、南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金联接基金(LOF)、景顺长城能源基建股票型证券投资基金、中邮核心优势灵活配置混合型证券投资基金、工银瑞信中小盘成长股票型证券投资基金、东吴货币市场证券投资基金、博时创业成长股票型证券投资基金、招商信用添利债券型证券投资基金、易方达消费行业股票型证券投资基金、富国汇利分级债券型证券投资基金、大成景丰分级债券型证券投资基金、兴全沪深 300 指数增强型证券投资基金(LOF)、工银瑞信深证红利交易型开放式指数证券投资基金、

工银瑞信深证红利交易型开放式指数证券投资基金联接基金、富国可转换债券证券投资基金、大成深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金、大成深证成长 40 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、泰达宏利领先中小盘股票型证券投资基金、交银施罗德信用添利债券证券投资基金(LOF)、东吴中证新兴产业指数证券投资基金、工银瑞信四季收益债券型证券投资基金、招商安瑞进取债券型证券投资基金、汇添富社会责任股票型证券投资基金、工银瑞信消费服务行业股票型证券投资基金、易方达黄金主题证券投资基金(LOF)、中邮中小盘灵活配置混合型证券投资基金、浙商聚潮产业成长股票型证券投资基金、嘉实领先成长股票型证券投资基金、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金、广发中小板 300 交易型开放式指数证券投资基金联接基金、南方保本混合型证券投资基金、交银施罗德先进制造股票证券投资基金、上投摩根新兴动力股票型证券投资基金、富兰克林国海策略回报灵活配置混合型证券投资基金、金元惠理保本混合型证券投资基金、招商安达保本混合型证券投资基金、深证 300 价值交易型开放式指数证券投资基金、南方中国中小盘股票指数证券投资基金(LOF)、交银施罗德深证 300 价值交易型开放式指数证券投资基金联接基金、富国中证 500 指数增强型证券投资基金(LOF)、长信内需成长股票型证券投资基金、大成中证内地消费主题指数证券投资基金、中海消费主题精选股票型证券投资基金、长盛同瑞中证 200 指数分级证券投资基金、景顺长城核心竞争力股票型证券投资基金、汇添富信用债债券型证券投资基金、光大保德信行业轮动股票型证券投资基金、富兰克林国海亚洲(除日本)机会股票型证券投资基金、汇添富逆向投资股票型证券投资基金、大成新锐产业股票型证券投资基金、申万菱信中小板指数分级证券投资基金、广发消费品精选股票型证券投资基金、鹏华金刚保本混合型证券投资基金、汇添富理财 14 天债券型证券投资基金、嘉实全球房地产证券投资基金、金元惠理新经济主题股票型证券投资基金、东吴保本混合型证券投资基金、建新社会责任股票型证券投资基金、嘉实理财宝 7 天债券型证券投资基金、富兰克林国海恒久信用债券型证券投资基金、大成月添利理财债券型证券投资基金、安信目标收益债券型证券投资基金、富国 7 天理财宝债券型证券投资基金、交银施罗德理财 21 天债券型证券投资基金、易方达中债新综合指数发起式证券投资基金(LOF)、工银瑞信信用纯债债券型



证券投资基金、大成现金增利货币市场基金、景顺长城支柱产业股票型证券投资基金、易方达月月利理财债券型证券投资基金、摩根士丹利华鑫量化配置股票型证券投资基金、东方央视财经 50 指数增强型证券投资基金、交银施罗德纯债债券型发起式证券投资基金、鹏华理财 21 天债券型证券投资基金、国泰民安增利债券型发起式证券投资基金、万家 14 天理财债券型证券投资基金、华安纯债债券型发起式证券投资基金、金元惠理惠利保本混合型证券投资基金、南方中证 500 交易型开放式指数证券投资基金、招商双债增强分级债券型证券投资基金、景顺长城品质投资股票型证券投资基金、中海可转换债券债券型证券投资基金、融通标普中国可转债指数增强型证券投资基金、大成现金宝场内实时申赎货币市场基金、交银施罗德荣祥保本混合型证券投资基金、国泰中国企业境外高收益债券型证券投资基金、富兰克林国海焦点驱动灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城沪深 300 等权重交易型开放式指数证券投资基金、广发聚源定期开放债券型证券投资基金、大成景安短融债券型证券投资基金、嘉实研究阿尔法股票型证券投资基金、新华行业轮换灵活配置混合型证券投资基金、富国目标收益一年期纯债债券型证券投资基金、汇添富高息债债券型证券投资基金、东方利群混合型发起式证券投资基金、南方稳利一年定期开放债券型证券投资基金、景顺长城四季金利纯债债券型证券投资基金、华夏永福养老理财混合型证券投资基金、嘉实丰益信用定期开放债券型证券投资基金、国泰国证医药卫生行业指数分级证券投资基金、交银施罗德定期支付双息平衡混合型证券投资基金、光大保德信现金宝货币市场基金、易方达投资级信用债债券型证券投资基金、广发趋势优选灵活配置混合型证券投资基金、华润元大保本混合型证券投资基金、长盛双月红一年期定期开放债券型证券投资基金、富国国有企业债债券型证券投资基金、富安达信用主题轮动纯债债券型发起式证券投资基金、景顺长城沪深 300 指数增强型证券投资基金、中邮定期开放债券型证券投资基金、安信永利信用定期开放债券型证券投资基金、工银瑞信信息产业股票型证券投资基金、大成景祥分级债券型证券投资基金、富兰克林国海岁岁恒丰定期开放债券型证券投资基金、景顺长城景益货币市场基金、万家市政纯债定期开放债券型证券投资基金、建信稳定添利债券型证券投资基金、上投摩根双债增利债券型证券投资基金、嘉实活期宝货币市场基金、融通通源一年目标

触发式灵活配置混合型证券投资基金、大成信用增利一年定期开放债券型证券投资基金、鹏华品牌传承灵活配置混合型证券投资基金、国泰浓益灵活配置混合型证券投资基金、汇添富恒生指数分级证券投资基金、长盛航天海工装备灵活配置混合型证券投资基金、广发新动力股票型证券投资基金、东吴阿尔法灵活配置混合型证券投资基金、诺安天天宝货币市场基金、前海开源可转债债券型发起式证券投资基金、新华鑫利灵活配置混合型证券投资基金、富国天盛灵活配置混合型证券投资基金、景顺长城中小板创业板精选股票型证券投资基金、中邮双动力混合型证券投资基金、建信改革红利股票型证券投资基金、交银施罗德周期回报灵活配置混合型证券投资基金、中海积极收益灵活配置混合型证券投资基金、申万菱信中证环保产业指数分级证券投资基金、博时裕隆灵活配置混合型证券投资基金、国寿安保沪深 300 指数型证券投资基金、前海开源沪深 300 指数型证券投资基金、天弘季加利理财债券型证券投资基金、新华鑫安保本一号混合型证券投资基金、诺安永鑫收益一年定期开放债券型证券投资基金、大成景益平稳收益混合型证券投资基金、南方稳利 1 年定期开放债券型证券投资基金、申万菱信中证军工指数分级证券投资基金、招商可转债分级债券型证券投资基金、泰达宏利货币市场基金、宝盈科技 30 灵活配置混合型证券投资基金、华润元大医疗保健量化股票型证券投资基金、融通月月添利定期开放债券型证券投资基金、中海惠祥分级债券型证券投资基金、建信稳定添利债券型证券投资基金、东方新兴成长混合型证券投资基金、银华双月定期理财债券型证券投资基金、嘉实新兴产业股票型证券投资基金、诺安天天宝货币市场基金、招商招利 1 个月期理财债券型证券投资基金、工银瑞信高端制造行业股票型证券投资基金、工银瑞信添益快线货币市场基金、国泰国证食品饮料行业指数分级证券投资基金、中证 500 医药卫生指数交易型开放式指数证券投资基金、富国天时货币市场基金、鹏华先进制造股票型证券投资基金、大成纳斯达克 100 指数证券投资基金、银华惠增利货币市场基金、华润元大富时中国 A50 指数型证券投资基金、安信现金增利货币市场基金、南方理财金交易型货币市场基金、工银瑞信创新动力股票型证券投资基金、东方添益债券型证券投资基金、富国中证国有企业改革指数分级证券投资基金、华夏沪港通恒生交易型开放式指数证券投资基金、大成产业升级股票型证券投资基金(LOF)、华夏沪港通恒生



交易型开放式指数证券投资基金联接基金、前海开源股息率 100 强等权重股票型证券投资基金、国开泰富货币市场证券投资基金、大成高新技术产业股票型证券投资基金、富兰克林国海大中华精选混合型证券投资基金、鹏华可转债债券型证券投资基金、华夏沪深 300 指数增强型证券投资基金、工银瑞信战略转型主题股票型证券投资基金、天弘云端生活优选灵活配置混合型证券投资基金、安信消费医药主题股票型证券投资基金、国泰深证 TMT50 指数分级证券投资基金。

## (二) 基金托管人的内部风险控制制度说明

### 1、内部控制目标

严格遵守国家有关托管业务的法律法规、行业监管规章和行内有关管理规定,守法经营、规范运作、严格监察,确保业务的稳健运行,保证基金财产的安全完整,确保有关信息的真实、准确、完整、及时,保护基金份额持有人的合法权益。

### 2、内部控制组织结构

风险管理委员会总体负责中国农业银行的风险管理与内部控制工作,对托管业务风险管理和内部控制工作进行监督和评价。托管业务部专门设置了风险管理处,配备了专职内控监督人员负责托管业务的内控监督工作,独立行使监督稽核职权。

### 3、内部控制制度及措施

具备系统、完善的制度控制体系,建立了管理制度、控制制度、岗位职责、业务操作流程,可以保证托管业务的规范操作和顺利进行;业务人员具备从业资格;业务管理实行严格的复核、审核、检查制度,授权工作实行集中控制,业务印章按规程保管、存放、使用,账户资料严格保管,制约机制严格有效;业务操作区专门设置,封闭管理,实施音像监控;业务信息由专职信息披露人负责,防止泄密;业务实现自动化操作,防止人为事故的发生,技术系统完整、独立。

## (三) 基金托管人对基金管理人运作基金进行监督的方法和程序

基金托管人通过参数设置将《基金法》、《运作办法》、基金合同、托管协议规定的投资比例和禁止投资品种输入监控系统,每日登录监控系统监督基

基金管理人的投资运作，并通过基金资金账户、基金管理人的投资指令等监督基金管理人的其他行为。

当基金出现异常交易行为时，基金托管人应当针对不同情况进行以下方式的处理：

- 1、电话提示。对媒体和舆论反映集中的问题，电话提示基金管理人；
- 2、书面警示。对本基金投资比例接近超标、资金头寸不足等问题，以书面方式对基金管理人进行提示；
- 3、书面报告。对投资比例超标、清算资金透支以及其他涉嫌违规交易等行为，书面提示有关基金管理人并报中国证监会。

### 三、相关服务机构

#### （一）基金销售机构

##### 1、直销机构

###### （1）天弘基金管理有限公司直销中心

住所：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

办公地址：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

法定代表人：井贤栋

电话：（022）83865560

传真：（022）83865563

联系人：司媛

客服电话：400-710-9999（免长途话费）

网址：[www.thfund.com.cn](http://www.thfund.com.cn)

###### （2）天弘基金管理有限公司网上直销平台

办公地址：北京市西城区月坛北街 2 号月坛大厦 A 座 20 层

电话：（010）83571941

传真：（010）83571800

联系人：李冰心

###### （3）天弘基金管理有限公司北京分公司

办公地址：北京市西城区月坛北街2号月坛大厦A座20层

电话：（010）83571789

传真：（010）83571900

联系人：申向阳

（4）天弘基金管理有限公司上海分公司

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路166号30层E-F单元

电话：（021）50128808

传真：（021）50128801

联系人：涂远宏

（5）天弘基金管理有限公司广州分公司

办公地址：广州市天河区珠江新城华夏路10号富力中心写字楼第10层

08单元

电话：（020）38927920

传真：（020）38927985

联系人：袁宇鹏

2、代销机构：

1）中国农业银行股份有限公司

住所：北京市东城区建国门内大街69号

办公地址：北京市东城区建国门内大街69号

法定代表人：蒋超良

电话：010-85108206

传真：010-85109219

联系人：唐文勇

客户服务热线：95599

网址：[www.abchina.com](http://www.abchina.com)

2）中信银行股份有限公司

住所：北京市东城区朝阳门大街8号富华大厦C座

办公地址：北京市东城区朝阳门大街8号富华大厦C座

法定代表人：常振明

电话：010-65557046

传真：010-65550827

联系人：方爽

客户服务热线：95558

网址：[www.bank.ecitic.com](http://www.bank.ecitic.com)

3) 中国邮政储蓄银行股份有限公司

住所：北京市西城区金融大街3号

办公地址：北京市西城区金融大街3号

法定代表人：李国华

电话：010-68858095

传真：010-68858117

联系人：杨涓

客户服务热线：95580

网址：[www.psbc.com](http://www.psbc.com)

4) 平安银行股份有限公司

住所：深圳市深南东路5047号

办公地址：上海市浦东新区陆家嘴环路1333号平安金融大厦9楼

法定代表人：孙建一

电话：021-38637673

传真：021-50979507

联系人：张莉

客户服务热线：95511-3

网址：[bank.pingan.com](http://bank.pingan.com)

5) 浙江稠州商业银行股份有限公司

住所：浙江省义乌市江滨路义乌乐园东侧

办公地址：浙江省杭州市延安路128号耀江广厦1-125

法定代表人：金子军

电话：0571-87117616

传真：0571-87117607

联系人：邵利兵

客户服务热线：4008096527、0571-96527

网址：www.sdns.czcb.com.cn

6) 长安银行股份有限公司

住所：陕西省西安市高新四路13号1栋1单元10101室

办公地址：陕西省西安市高新四路朗臣大厦1101

法定代表人：孙宗宽

电话：029-88609563

传真：029-88609566

联系人：闫石

客户服务热线：029-96669、40005-96669

网址：www.ccabchina.com

7) 东莞农村商业银行股份有限公司

住所：广东省东莞市城区南城路2号

办公地址：广东省东莞市城区南城路2号

法定代表人：何沛良

电话：0769-961122

传真：0769-22320896

联系人：杨亢

客户服务热线：0769-961122

网址：www.drcbank.com

8) 江苏吴江农村商业银行股份有限公司

住所：江苏省苏州市吴江区中山南路1777号

办公地址：江苏省苏州市吴江区中山南路1777号

法定代表人：陆玉根

电话：0512-63969063

传真：

联系人：王健

客户服务热线：400-86-96068

网址: [www.wjrbc.com](http://www.wjrbc.com)

9) 哈尔滨银行股份有限公司

住所: 哈尔滨市道里区尚志大街 160 号

办公地址: 哈尔滨市道里区西八道街 2 号 1003 室

法定代表人: 郭志文

电话: 0451-86779018

传真: 0451-86779218

联系人: 遇玺

客户服务热线: 95537

网址: [www.hrbb.com.cn](http://www.hrbb.com.cn)

10) 齐鲁证券有限公司

住所: 山东省济南市经七路 86 号

办公地址: 山东省济南市市中区经七路 86 号 23 层

法定代表人: 李玮

电话: 0531-68889155

传真: 0531-68889752

联系人: 马晓男

客户服务热线: 95538

网址: [www.qlzq.com.cn](http://www.qlzq.com.cn)

11) 光大证券股份有限公司

住所: 上海市静安区新闸路 1508 号

办公地址: 上海市静安区新闸路 1508 号

法定代表人: 徐浩明

电话: 021-22169999

传真: 021-22169134

联系人: 刘晨

客户服务热线: 400-888-8788、10108998

网址: [www.ebscn.com](http://www.ebscn.com)

12) 中航证券有限公司

住所：江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A 座  
41 楼

办公地址：江西省南昌市红谷滩新区红谷中大道 1619 号国际金融大厦 A  
座

法定代表人：杜航

电话：0791-86768681

传真：0791-86770178

联系人：戴蕾

客户服务热线：400-886-6567

网址：www.avicsec.com

13) 世纪证券有限责任公司

住所：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 41-42 层

办公地址：深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦 41-42 层

法定代表人：卢长才

电话：0755-83199599

传真：0755-83199545

联系人：袁媛

客户服务热线：0755-83199511

网址：www.cscoco.com.cn

14) 中银国际证券有限责任公司

住所：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层

办公地址：上海市浦东新区银城中路 200 号中银大厦 39 层

法定代表人：许刚

电话：021-20328704

传真：021-50372474

联系人：王炜哲

客户服务热线：400-620-8888

网址：www.bocichina.com.cn

15) 新时代证券有限责任公司



住所：北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501

办公地址：北京市海淀区北三环西路 99 号院 1 号楼 15 层 1501

法定代表人：刘汝军

电话：010-83561146

传真：010-83561094

联系人：卢珊

客户服务热线：400-698-9898

网址：www.xsdzq.cn

16) 中信建投证券股份有限公司

住所：北京市朝阳区安立路 66 号 4 号楼

办公地址：北京市朝阳区门内大街 188 号

法定代表人：王常青

电话：010-65183880

传真：010-65182261

联系人：张颢

客户服务热线：400-888-8108

网址：www.csc108.com

17) 长江证券股份有限公司

住所：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

办公地址：武汉市新华路特 8 号长江证券大厦

法定代表人：胡运钊

电话：027-65799999

传真：027-85481900

联系人：奚博宇

客户服务热线：400-888-8999

网址：www.95579.com

18) 申万宏源证券有限公司

住所：上海市常熟路 171 号

办公地址：上海市长乐路 989 号 40F

法定代表人：储晓明

电话：021-54041654

传真：021-33388217

联系人：钱达琛

客户服务热线：95523、400-889-5523

网址：www.sywg.com.cn

19) 国泰君安证券股份有限公司

住所：上海市浦东新区商城路 618 号

办公地址：上海市浦东新区银城中路 168 号上海银行大厦 29 楼

法定代表人：万建华

电话：021-38676666

传真：021-38670666

联系人：芮敏祺

客户服务热线：400-888-8666

网址：www.gtja.com

20) 广州证券有限责任公司

住所：广州市先烈中路 69 号东山广场主楼 17 楼

办公地址：广州市天河区珠江新城珠江西路 5 号广州国际金融中心 19、

20 楼

法定代表人：吴志明

电话：020-87322668

传真：020-87325036

联系人：林洁茹

客户服务热线：020-961303

网址：www.gzs.com.cn

21) 信达证券股份有限公司

住所：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

办公地址：北京市西城区闹市口大街 9 号院 1 号楼

法定代表人：高冠江

电话：010-63081000

传真：010-63080978

联系人：唐静

客户服务热线：400-800-8899

网址：www.cindasc.com

22) 华安证券有限责任公司

住所：安徽省合肥市长江中路 357 号

办公地址：安徽省合肥市阜南路 166 号润安大厦 A 座 24 层-32 层

法定代表人：李工

电话：0551-5161666

传真：0551-5161600

联系人：汪燕

客户服务热线：96518、400-809-6518

网址：www.hazq.com

23) 天相投资顾问有限公司

住所：北京市西城区金融街 19 号富凯大厦 B 座 701

办公地址：北京市西城区金融大街 5 号新盛大厦 B 座 4 层

法定代表人：林义相

电话：010-66045608

传真：010-66045500

联系人：林爽

客户服务热线：010-66045678

网址：www.txsec.com

24) 国金证券股份有限公司

住所：成都市东城根上街 95 号

办公地址：成都市东城根上街 95 号

法定代表人：冉云

电话：028-86690126

传真：028-86690126

联系人：刘一宏

客户服务热线：400-660-0109

网址：www.gjzq.com.cn

25) 东海证券股份有限公司

住所：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18、19 号楼

办公地址：江苏省常州市延陵西路 23 号投资广场 18、19 号楼

法定代表人：朱科敏

电话：0519-88157761

传真：0519-88157761

联系人：王一彦

客户服务热线：400-888-8588、95531

网址：www.longone.com.cn

26) 华宝证券有限责任公司

住所：上海市浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 57 层

办公地址：上海市浦东新区世纪大道 100 号环球金融中心 57 层

法定代表人：陈林

电话：021- 68777222

传真：021- 68777723

联系人：刘闻川

客户服务热线：400-820-9898

网址：www.cnhbstock.com

27) 西藏同信证券有限责任公司

住所：西藏自治区拉萨市北京中路 101 号

办公地址：上海市永和路 118 弄 24 号楼

法定代表人：贾绍君

电话：021-36533016

传真：021-36533017

联系人：曹亦思

客户服务热线：400-881-1177

网址: [www.xzsec.com](http://www.xzsec.com)

28) 爱建证券有限责任公司

住所: 上海市浦东新区世纪大道 1600 号 32 楼

办公地址: 上海市浦东新区世纪大道 1600 号 32 楼

法定代表人: 宫龙云

电话: 021-32229888

传真: 021-62878783

联系人: 戴莉丽

客户服务热线: 021-63340678

网址: [www.ajzq.com](http://www.ajzq.com)

29) 中信证券股份有限公司

住所: 深圳市福田区深南大道 7088 号招商银行大厦第 A 层

办公地址: 北京市朝阳区亮马桥路 48 号中信证券大厦 20 层

法定代表人: 王东明

电话: 010-60838888

传真: 010-60833739

联系人: 侯艳红

客户服务热线: 95558

网址: [www.cs.ecitic.com](http://www.cs.ecitic.com)

30) 东莞证券有限责任公司

住所: 广东省东莞市莞城区可园南路一号

办公地址: 广东省东莞市莞城区可园南路一号金源中心 30 楼

法定代表人: 张运勇

电话: 0769-22116557

传真: 0769-22119423

联系人: 柯天池

客户服务热线: 0769-961130

网址: [www.dgzq.com.cn](http://www.dgzq.com.cn)

31) 中信证券(山东)有限责任公司

住所：山东省青岛市崂山区苗岭路 29 号澳柯玛大厦 15 层（1507-1510 室）

办公地址：青岛市崂山区深圳路 222 号青岛国际金融广场 1 号楼第 20 层

法定代表人：杨宝林

电话：0532-85022326

传真：0532-85022605

联系人：吴忠超

客户服务热线：0532-95548

网址：[www.zxwt.com.cn](http://www.zxwt.com.cn)

32) 中邮证券有限责任公司

住所：西安市碑林区太白北路 320 号

办公地址：西安市高新区唐延路 5 号陕西邮政大厦 9-11 层

法定代表人：李春太

电话：029-88602147

传真：029-88602138

联系人：杨壹淋

客户服务热线：4008-888-005

网址：[www.cnpsec.com.cn](http://www.cnpsec.com.cn)

33) 中信证券（浙江）有限责任公司

住所：：浙江省杭州市解放东路 29 号迪凯银座 22 层

办公地址：浙江省杭州市解放东路 29 号迪凯银座 22 层

法定代表人：沈强

电话：0571-85783737

传真：0571-85106383

联系人：王佳苗

客户服务热线：95548

网址：[www.bigsun.com.cn](http://www.bigsun.com.cn)

34) 华龙证券有限责任公司

住所：甘肃省兰州市静宁路 308 号

办公地址：甘肃省兰州市东岗西路 638 号兰州财富中心财富大厦

法定代表人：李晓安

电话：0931-8784656

传真：0931-4890118

联系人：邓鹏怡

客户服务热线：400-689-8888

网址：www.hlzqgs.com

35) 东北证券股份有限公司

住所：长春市自由大路 1138 号

办公地址：长春市自由大路 1138 号

法定代表人：矫正中

电话：0431-85096517

传真：0431-85096795

联系人：安岩岩

客户服务热线：400-600-0686

网址：www.nesc.cn

36) 兴业证券股份有限公司

住所：福州市湖东路 268 号

办公地址：福州市湖东路 268 号证券大厦 16F

法定代表人：兰荣

电话：0591-38162212

传真：0591-38507538

联系人：夏中苏

客户服务热线：95562

网址：www.xyzq.com.cn

37) 大同证券经纪有限责任公司

住所：山西省太原市长治路 111 号山西世贸中心 A 座 12 层

办公地址：山西省太原市长治路 111 号山西世贸中心 A 座 12 层

法定代表人：董祥



电话：0351-7219303

联系人：张冠

客户服务热线：4007121212

网址：www.dtsbc.com.cn

3、基金管理人可根据有关法律法规的要求，选择其他符合要求的机构新增为本基金的发售机构，并及时公告。

(二) 注册登记机构

名称：天弘基金管理有限公司

住所：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

办公地址：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

法定代表人：井贤栋

电话：(022) 83865560

传真：(022) 83865563

联系人：薄贺龙

(三) 律师事务所和经办律师

名称：天津嘉德恒时律师事务所

住所：天津市河西区马场道 59 号天津国际经济贸易中心 A 座 1009-1010

办公地址：天津市河西区马场道 59 号天津国际经济贸易中心 A 座 1009-

1010

法定代表人：孟卫民

电话：(022) 83865255

传真：(022) 83865266

经办律师：续宏帆、徐岩

联系人：续宏帆

(四) 会计师事务所和经办注册会计师

名称：普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)

住所：上海市浦东新区陆家嘴环路 1318 号星展银行大厦 6 楼

办公地址：上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼

执行事务合伙人：杨绍信

电话：（021）23238888

经办注册会计师：薛竞、魏佳亮

联系人：魏佳亮

#### 四、基金的名称

本基金名称：天弘季加利理财债券型证券投资基金

#### 五、基金的类型

本基金类型：债券型基金

#### 六、基金的投资目标

在追求本金安全的基础上，力求获取较高的当期收益。

#### 七、基金的投资方向

本基金投资于法律法规及监管机构允许投资的金融工具，具体包括现金，协议存款、通知存款、银行定期存款、大额存单，债券回购，短期融资券、超短期融资券、企业债、公司债、国债、央行票据、金融债、地方政府债、次级债、中小企业私募债、中期票据等债券，资产支持证券，以及法律法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具，但需符合中国证监会的相关规定。

本基金不从二级市场买入股票或权证，也不参与一级市场新股申购或股票增发。本基金不投资可转换债券，但可以投资分离交易可转债上市后分离出来的债券。在封闭期内，本基金投资各类金融工具的到期日应不晚于封闭期的最后一日。

如法律法规或监管机构以后允许基金投资其他品种，基金管理人在履行适当程序后，可以将其纳入投资范围。

#### 八、基金的投资策略

在封闭期内，本基金将在坚持组合久期与封闭期基本匹配的原则下，采用持有到期策略构建投资组合，基本保持大类品种配置的比例恒定。如果需要，在封闭期之间的短暂开放期内，本基金将采用流动性管理与组合调整相结合的策略。

本基金主要投资于银行定期存款、协议存款及大额存单、债券回购和短期债券（包括短期融资券、即将到期的中期票据等）三类利率市场化程度较高的金融工具。在封闭期，根据市场情况和可投资品种的容量，在严谨深入的研究分析基础上，综合考量市场资金面走向、信用债券的信用评级、协议存款交易对手的信用资质以及各类资产的收益率水平等，确定各类货币市场工具的配置比例，主要采取持有到期的投资策略。

#### 1、资产配置策略

每个封闭期初，本基金首先对回购利率与短债收益率、协议存款利率进行比较，并在对封闭期资金面进行判断的基础上，判断是否存在利差套利空间，以确定是否进行杠杆操作；其次对各类金融工具在封闭期内的持有期收益进行比较，确定优先配置的资产类别，并结合各类金融工具的市场容量，确定配置比例。

#### 2、银行定期存款、协议存款及大额存单投资策略

封闭期初，本基金在向交易对手银行进行询价的基础上，选取利率报价较高的几家银行进行协议存款投资，注重分散投资，降低交易对手风险。

#### 3、债券回购投资策略

首先，基于对封闭期内资金面走势的判断，确定回购期限的选择。在组合进行杠杆操作时，若判断资金面趋于宽松，则在封闭期初进行短期限正回购操作；反之，则进行长期限正回购操作，锁定融资成本。若期初资产配置有逆回购比例，则在判断资金面趋于宽松的情况下，优先进行长期限逆回购配置；反之，则进行短期限逆回购操作。

其次，本基金在封闭期内，根据资金头寸，安排相应期限的回购操作。

#### 4、短期信用债券投资策略

在封闭期，基金管理人根据各短期信用债的信用评级、到期收益率、剩余期限与封闭期的匹配程度，挑选适当的短期债券进行配置，并持有到期。

## 5、中小企业私募债券投资策略

中小企业私募债券采取非公开方式发行和交易，并限制投资者数量上限，整体流动性相对较差。同时，受到发债主体资产规模较小、经营波动性较高、信用基本面稳定性较差的影响，整体的信用风险相对较高。本基金将采取谨慎投资策略进行中小企业私募债券的投资，在重点分析和跟踪发债主体的信用基本面基础上，综合考虑信用基本面、债券收益率和流动性等要素，确定具体个券的投资策略。

## 九、业绩比较基准

本基金的业绩比较基准为：3个月银行定期存款利率（税后）

如果今后法律法规发生变化，或者有其他代表性更强、更科学客观的业绩比较基准适用于本基金时，经基金管理人和基金托管人协商一致后，本基金可以在报中国证监会备案后变更业绩比较基准并及时公告。

## 十、风险收益特征

本基金为采用固定组合策略的短期理财债券型基金，属于证券投资基金中较低风险、预期收益较为稳定的品种，其预期的风险水平低于股票型基金、混合型基金和普通债券型基金。

## 十一、基金投资组合报告

基金管理人的董事会及董事保证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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年7月16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、误导性陈述或者重大遗漏。

本投资组合报告所载数据截至2015年3月26日，本报告中所列财务数据未经审计。

### 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	固定收益投资	—	—

	其中：债券	—	—
	资产支持证券	—	—
2	买入返售金融资产	—	—
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	—	—
3	银行存款和结算备付金合计	257,397.33	99.39
4	其他资产	1,592.74	0.61
5	合计	258,990.07	100.00

## 2、报告期债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值比例（%）	
1	报告期内债券回购融资余额	—	
	其中：买断式回购融资	—	
序号	项目	金额	占基金资产净值比例（%）
2	报告期末债券回购融资余额	—	—
	其中：买断式回购融资	—	—

注：报告期内债券回购融资余额占基金资产净值比例应取报告期内每个交易日融资余额占基金资产净值比例的简单平均值；对于理财债券型基金，只要其投资的市场（如银行间市场）可交易，即可视为交易日。

### 债券正回购的资金余额超过基金资产净值的20%的说明

本基金合同约定：“本基金进入全国银行间同业市场进行债券回购的资金余额不得超过基金资产净值的40%；”，本报告期内，本基金未发生超标情况。

## 3、基金投资组合平均剩余期限

### (1) 投资组合平均剩余期限基本情况

不适用。

### 报告期内投资组合平均剩余期限超过180天情况说明

不适用。

### (2) 报告期末投资组合平均剩余期限分布比例

不适用。

## 4、报告期末按债券品种分类的债券投资组合

本报告期末，本基金已暂停运作，资产负债均已清算。

### 5、 报告期末按摊余成本占基金资产净值比例大小排名的前十名债券投资明细

本报告期末，本基金已暂停运作，资产负债均已清算。

### 6、 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离

项目	偏离情况
报告期内偏离度的绝对值在0.25(含)-0.5%间的次数	0
报告期内偏离度的最高值	0.1472%
报告期内偏离度的最低值	0.0000%
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0649%

注：表内各项数据均按报告期内的交易日统计。

### 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。

### 8、 投资组合报告附注

#### (1) 基金计价方法说明。

本基金估值采用“摊余成本法”，即估值对象以买入成本列示，按照票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价，在剩余存续期内平均摊销，每日计提损益。本基金不采用市场利率和上市交易的债券和票据的市价计算基金资产净值。

#### (2) 本报告期内，本基金持有的剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券的说明。

不适用。

#### (3) 本基金本报告期内不存在投资的前十名证券的发行主体被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

#### (4) 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名称	金额
1	存出保证金	—
2	应收证券清算款	—
3	应收利息	1,592.74
4	应收申购款	—
5	其他应收款	—
6	待摊费用	—

7	其他	—
8	合计	1,592.74

**(5) 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。

## 十二、基金的业绩

基金管理人依照恪尽职守、诚实信用、谨慎勤勉的原则管理和运用基金财产，但不保证基金一定盈利，也不保证最低收益。基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在做出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本基金合同生效日 2014 年 6 月 18 日，基金业绩数据截至 2015 年 3 月 26 日。

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

### 1、天弘季加利理财 A

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
2014/6/18- 2014/12/31	2.2178 %	0.0195 %	1.3950 %	0.0003 %	0.8228 %	0.0192 %
2015/1/1- 2015/3/26	0.8129 %	0.0121 %	0.5368 %	0.0003%	0.2761 %	0.0118 %
自基金合同 生效日 (2014/6/18- 2015/3/26)	3.0485%	0.0176%	1.9318%	0.0005%	1.1167%	0.0171%

### 2、天弘季加利理财B

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
2014/6/18- 2014/12/31	2.3511 %	0.0195 %	1.3950 %	0.0003 %	0.9561 %	0.0192 %
2015/1/1- 2015/3/26	0.8695 %	0.0121 %	0.5368 %	0.0003%	0.3327 %	0.0118 %
自基金合同 生效日 (2014/6/18- 2015/3/26)	3.2408%	0.0176%	1.9318%	0.0005%	1.3090%	0.0171%

注：1、本基金业绩比较基准为 3 个月银行定期存款利率（税后），即中国



人民银行公布并执行的 3 个月金融机构人民币存款基准利率（税后）。

2、2015 年 3 月 26 日，本基金第三期运作期到期后暂停下一运作期运作。

### 十三、基金费用与税收

#### （一）基金费用的种类

- 1、基金管理人的管理费；
- 2、基金托管人的托管费；
- 3、基金销售服务费
- 4、《基金合同》生效后与基金相关的信息披露费用；
- 5、《基金合同》生效后与基金相关的会计师费、律师费和诉讼费；
- 6、基金份额持有人大会费用；
- 7、基金的证券交易费用；
- 8、基金的银行汇划费用；
- 9、证券账户开户费用和银行账户维护费；
- 10、按照国家有关规定和《基金合同》约定，可以在基金财产中列支的其他费用。

#### （二）基金费用计提方法、计提标准和支付方式

##### 1、基金管理人的管理费

本基金的管理费按前一日基金资产净值的 0.27%年费率计提。管理费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.27\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、公休假等，支付日期顺延。

##### 2、基金托管人的托管费

本基金的托管费按前一日基金资产净值的 0.08% 的年费率计提。托管费的计算方法如下：

$$H = E \times 0.08\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应计提的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计算，逐日累计至每月月末，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划款指令，基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中一次性支取。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

### 3、基金销售服务费

本基金 A 类基金份额的销售服务费年费率为 0.25%，对于由 B 类降级为 A 类的基金份额持有人，年基金销售服务费率应自其降级后的下一个工作日起适用 A 类基金份额持有人的费率。

B 类基金份额的销售服务费年费率为 0.01%，对于由 A 类升级为 B 类的基金份额持有人，年基金销售服务费率应自其升级后的下一个工作日起适用 B 类基金份额持有人的费率。各类基金份额的销售服务费计提的计算公式如下：

$$H = E \times \text{各类基金份额的销售服务费年费率} \div \text{当年天数}$$

H 为每日各类基金份额应计提的销售服务费

E 为前一日的各类基金份额的基金资产净值

销售服务费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送销售服务费划付指令，经基金托管人复核后于次月前 3 个工作日内从基金财产中划出，由基金管理人按相关合同规定支付给基金销售机构等。若遇法定节假日、公休日等，支付日期顺延。

上述“（一）、基金费用的种类中第 4—10 项费用”，根据有关法规及相应协议规定，按费用实际支出金额列入当期费用，由基金托管人从基金财产中支付。

### （三）不列入基金费用的项目

下列费用不列入基金费用：

1、基金管理人和基金托管人因未履行或未完全履行义务导致的费用支出或基金财产的损失；

- 2、基金管理人和基金托管人处理与基金运作无关的事项发生的费用；
- 3、《基金合同》生效前的相关费用；
- 4、其他根据相关法律法规及中国证监会的有关规定不得列入基金费用的项目。

(四) 基金管理费、基金托管费、基金销售服务费的调整

基金管理人和基金托管人可协商一致，调低基金管理费率、基金托管费率、基金销售服务费率，无须召开基金份额持有人大会。

(五) 基金税收

本基金运作过程中涉及的各纳税主体，其纳税义务按国家税收法律、法规执行。

## 十四、对招募说明书更新部分的说明

本基金管理人依据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》、《证券投资基金销售管理办法》、《证券投资基金信息披露管理办法》及其它有关法律法规的要求，结合本基金管理人对本基金实施的投资管理活动，对本基金管理人于2015年1月30日公告的《天弘季加利理财债券型证券投资基金招募说明书》进行了更新,主要更新的内容如下：

- 1、在“三、基金管理人”部分，对管理人概况、管理人管理基金的基本信息及公司部门设置、主要人员、投资决策委员会等情况进行了更新；
- 2、在“四、基金托管人”部分，根据基金托管人提供的内容做了相应的更新；
- 3、在“五、相关服务机构”部分，增加了新的代销机构；
- 4、在“十二、基金投资组合报告”部分，按有关规定补充了本基金近一期投资组合报告的内容；
- 5、在“十三、基金的业绩”部分，更新了基金业绩数据，并经基金托管人复核；
- 6、在“二十五、其他应披露的事项”部分，对本次更新内容期间的历次公告进行了补充。

天弘基金管理有限公司  
二〇一五年七月三十一日