天弘丰利分级债券型证券投资基金2013年年度报告

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：中国邮政储蓄银行股份有限公司

送出日期：2014年03月27日

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

§1 重要提示及目录

1.1 重要提示

基金管理人的董事会、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的法律责任。本年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意，并由董事长签发。

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2014年3月25日复核了本报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、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及其更新。

本报告期自2013年1月1日起至2013年12月31日止。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

1.2 目录

§1 重要提示及目录 2
1.1 重要提示 2
1.2 目录 3
§2 基金简介 5
2.1 基金基本情况 5
2.2 基金产品说明 5
2.3 基金管理人和基金托管人 6
2.4 信息披露方式 6
2.5 其他相关资料 7
§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况 8
3.1 主要会计数据和财务指标 8
3.2 基金净值表现 8
3.3 其他指标 10
3.4 过去三年基金的利润分配情况 10
§4 管理人报告 11
4.1 基金管理人及基金经理情况 11
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明 12
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明 12
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明 13
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望 14
4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况 14
4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明 15
4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明 16
§5 托管人报告 17
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明 17
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明 17
5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见 17
§6 审计报告 18
6.1 审计报告基本信息 18
6.2 审计报告的基本内容 18
§7 年度财务报表 20
7.1 资产负债表 20
7.2 利润表 21
7.3 所有者权益（基金净值）变动表 23
7.4 报表附注 24
§8 投资组合报告 49
8.1 期末基金资产组合情况 49
8.2 期末按行业分类的股票投资组合 49
8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细 49
8.4 报告期内股票投资组合的重大变动 49
8.5 期末按债券品种分类的债券投资组合 50
8.6 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 50
8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有资产支持证券投资明细 50
8.8 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贵金属投资明细 50
8.9 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 51

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明 51
8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细 51
8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明 51
8.11.1 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细 51
8.12 投资组合报告附注 51
§9 基金份额持有人信息 53
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构 53
9.2 期末上市基金前十名持有人 53
9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况 54
§10 开放式基金份额变动 55
§11 重大事件揭示 56
11.1 基金份额持有人大会决议 56
11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动 56
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼 56
11.4 基金投资策略的改变 56
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况 56
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况 56
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况 56
11.8 其他重大事件 57
§12 影响投资者决策的其他重要信息 61
§13 备查文件目录 62
13.1 备查文件目录 62
13.2 存放地点 62
13.3 查阅方式 62

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

§2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	天弘丰利分级债券型证券投资基金	
基金简称	天弘丰利分级债券，场内简称天弘丰利	
基金主代码	164208	
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3年内，丰利A自《基金合同》生效之日起每满6个月开放一次，丰利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，本基金转换为上市开放式基金（LOF）。	
基金合同生效日	2011年11月23日	
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	
报告期末基金份额总额	829,954,815.54份	
基金合同存续期	不定期	
基金份额上市的证券交易所	深圳证券交易所	
上市日期	2012年02月20日	
下属分级基金的基金简称	丰利A	丰利B
下属分级基金的交易代码	164209	150046
报告期末下属分级基金的份额总额	346,311,277.05份	483,643,538.49份

注：《基金合同》生效之日起3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丰利B。

2.2 基金产品说明

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、利率走势、资金供求、信用风险状况、证券市场走势等方面的分析和预测，采取自上而下和自下而上相结合的投资策略，构建和调整固定收益证券投资组合并适度参与新股投资，力求实现风险与收益的优化平衡。
业绩比较基准	中债综合指数
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

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

	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。 本基金在分级基金运作期内，经过基金份额分级后，丰利A为低风险、收益相对稳定的基金份额；丰利B为较高风险、较高收益的基金份额。	
下属两级基金的风险收益特征	风险较低、收益相对稳定	风险较高、收益较高

2.3 基金管理人和基金托管人

项目		基金管理人	基金托管人
名称		天弘基金管理有限公司	中国邮政储蓄银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	童建林	胡涛
	联系电话	022-83310208	010-68858112
	电子邮箱	service@thfund.com.cn	hutao@psbcoa.com.cn
客户服务电话		022-83310988、4007109999	95580
传真		022-83865569	010-68858120
注册地址		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	北京市西城区金融大街3号
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	北京市西城区金融大街3号A座
邮政编码		300203	100808
法定代表人		李琦	李国华

2.4 信息披露方式

本基金选定的信息披露报纸名称	中国证券报、上海证券报、证券时报
登载基金年度报告正文的管理人互联网网址	www.thfund.com.cn
基金年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公地址

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
会计师事务所	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）	中国上海市湖滨路 202 号普华永道中心11 楼
注册登记机构	中国证券登记结算有限责任公司	北京市西城区太平桥大街17号

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

§3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况

3.1 主要会计数据和财务指标

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2013年	2012年	2011年11月23日2011年12月31日
本期已实现收益	101,764,238.71	202,163,715.78	8,764,901.66
本期利润	31,762,944.12	211,443,199.79	16,240,843.24
加权平均基金份额本期利润	0.0245	0.1229	0.0097
本期基金加权平均净值利润率	2.13%	11.47%	0.97%
本期基金份额净值增长率	7.30%	16.70%	0.97%
3.1.2 期末数据和指标	2013年末	2012年末	2011年末
期末可供分配利润	193,095,381.70	184,495,261.49	8,764,901.66
期末可供分配基金份额利润	0.2327	0.1566	0.0053
期末基金资产净值	994,240,937.00	1,345,190,131.51	1,684,148,156.92
期末基金份额净值	1.1979	1.1416	1.0097
3.1.3 累计期末指标	2013年末	2012年末	2011年末
基金份额累计净值增长率	26.43%	17.83%	0.97%

注：1、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。

2、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。

3、期末可供分配利润采用期末资产负债表未分配利润与未分配利润中已实现部分的孰低数。

3.2 基金净值表现

3.2.1 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	份额净值增长率①	份额净值增长率标准差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

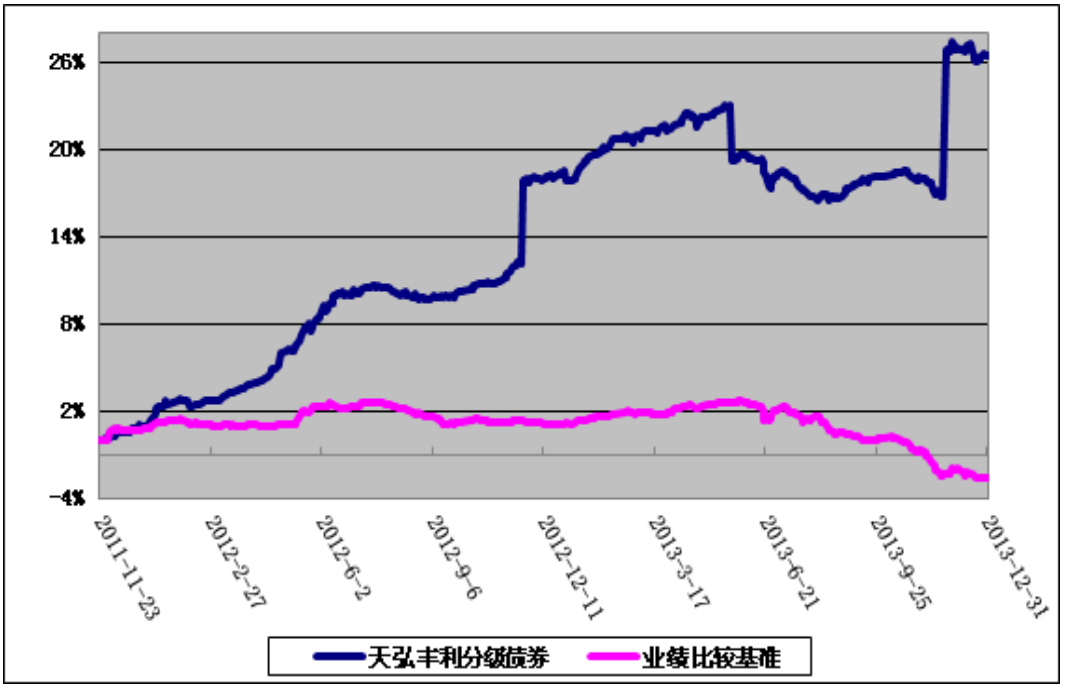
cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

过去三个月	6.98%	1.12%	-2.68%	0.10%	9.66%	1.02%
过去六个月	7.00%	0.78%	-4.54%	0.09%	11.54%	0.69%
过去一年	7.30%	0.61%	-3.75%	0.08%	11.05%	0.53%
自基金合同生效日起至今（2011年11月23日-2013年12月31日）	26.43%	0.48%	-2.55%	0.08%	28.98%	0.40%

注：天弘丰利分级债券基金业绩比较基准：中债综合指数。中债综合指数由中央国债登记结算有限责任公司编制并发布，该指数样本具有广泛的市场代表性，涵盖主要交易市场（银行间市场、交易所市场等）、不同发行主体（政府、企业等）和期限（长期、中期、短期等），是中国目前最权威，应用也最广的指数。中债综合指数的构成品种完全覆盖了本基金的投资范围，反映债券全市场的整体价格和投资回报情况，适合作为本基金的业绩比较基准。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额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

天弘丰利分级债券型证券投资基金
份额累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
（2011年11月23日至2013年12月31日）

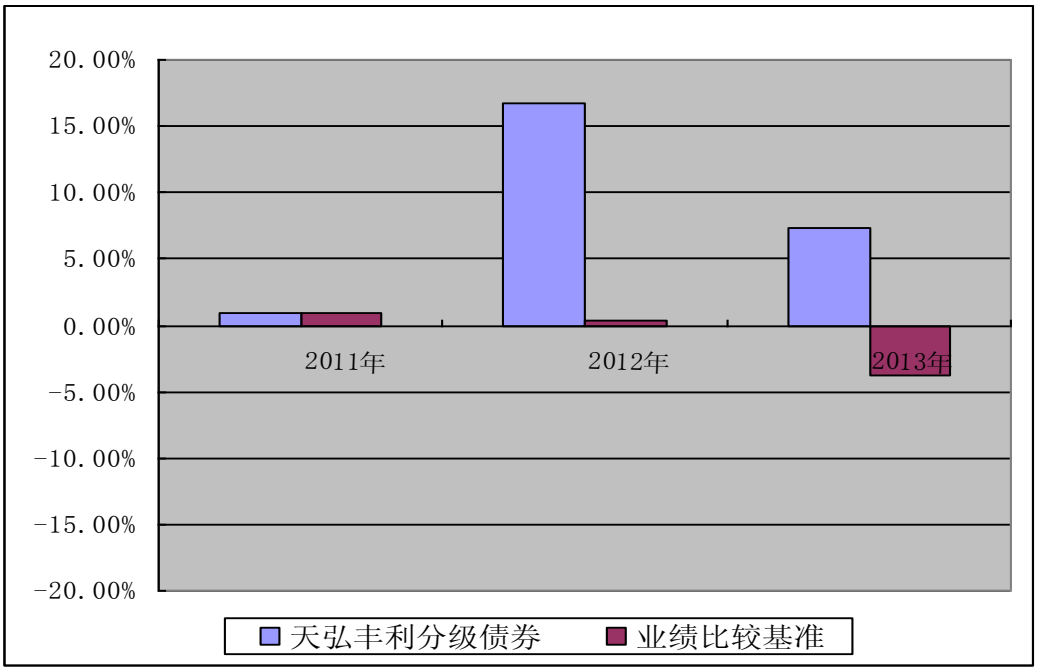


注：1、本基金合同于2011年11月23日生效。
2、本报告期内，本基金的各项投资比例达到基金合同约定的各项比例要求。

3.2.3 自基金合同生效以来基金每年净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

天弘丰利分级债券型证券投资基金
合同生效日以来净值增长率与业绩比较基准收益率的柱形对比图

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站



注：本基金合同于2011年11月23日生效。基金合同生效当年2011年的净值增长率按照基金合同生效后当年的实际存续期计算，不按整个自然年度进行折算。

3.3 其他指标

金额单位：人民币元

其他指标	报告期间：2013年01月01日至2013年12月31日
丰利A与丰利B基金份额配比	0.71604653:1
期末丰利A份额参考净值	95,160,865.69
期末丰利A份额累计参考净值	1.0043
丰利A累计折算份额	1.0954
期末丰利B份额参考净值	1.3366
期末丰利B份额累计参考净值	1.3366
丰利A年收益率（单利）	4.05%

注：1、根据《基金合同》的规定，丰利A的年收益率将在每次开放日设定一次并公告。
2、本报告期内（2013年1月1日至2013年12月31日期间），丰利A年收益率为4.05%。

3.4 过去三年基金的利润分配情况

根据《基金合同》的约定，本基金《基金合同》生效之日起3年内不进行收益分配。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

§4 管理人报告

4.1 基金管理人及基金经理情况

4.1.1 基金管理人及其管理基金的经验

天弘基金管理有限公司（以下简称"公司"或"本公司）经中国证监会证监基金字[2004]164号文批准，于2004 年11 月8 日正式成立。注册资本金为1.8亿元人民币，总部设在天津，在北京、上海、广州设有分公司。公司股东为天津信托有限责任公司（持股比例48%）、内蒙古君正能源化工股份有限公司（持股比例36%）、芜湖高新投资有限公司（持股比例16%）。截至2013年12月31日，本基金管理人共管理14只基金：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、天弘深证成份指数证券投资基金（LOF）、天弘添利分级债券型证券投资基金、天弘丰利分级债券型证券投资基金、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、天弘增利宝货币市场基金、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。

4.1.2 基金经理（或基金经理小组）及基金经理助理简介

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；天弘添利分级债券型证券投资基金基金经理；天弘永利分级债券型证券投资基金基金经理；天弘债券型发起式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；天弘同利分级债券型证券投资基金基	2011年11月	—	11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。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

	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。				
刘冬	天弘丰利分级债券型证券投资基金基金经理；天弘现金管家货币市场基金基金经理；天弘债券型发起式证券投资基金基金经理；股票投资部总经理助理。	2011年11月	2013年08月	7年	男，经济学硕士。历任长江证券股份有限公司宏观策略研究分析师。2008年加盟本公司，历任固定收益研究员、宏观策略研究员。

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。

本报告期内，本基金管理人严格遵守《证券投资基金法》及其配套规则和其他相关法律法规、基金合同的有关规定，勤勉尽责地管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金份额持有人谋求最大利益。

本报告期内，本基金运作合法合规，不存在损害基金份额持有人利益的行为。

4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明

4.3.1 公平交易制度和控制方法

基金管理人一直坚持公平对待旗下所有基金的原则，严格执行《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部公平交易制度，在研究分析、投资决策和交易执行等各个环节落实公平交易原则。公平交易范围包括各类投资组合、所有投资交易品种、以及一级市场申购、二级市场交易等所有投资交易管理活动及授权、研究分析、投资决策、交易执行、业绩评估等投资管理活动相关的各个环节。

针对公司旗下所有投资组合的交易所公开竞价交易，通过交易系统中的公平交易程序，对于不同投资组合同日同向买卖同一证券的指令自动进行比例分配。针对场外网下交易业务，依照《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》和公司内部场外、网下交易业务的相关规定，确保各投资组合享有公平的交易执行机会。对于以公司名义进行的交易严格按照发行分配的原则或价格优先、比例分配的原则在各投资组合间进行分配。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

4.3.2 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。

4.3.3 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 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

天弘丰利分级债券型证券投资基金在2013年1季度收益率下行过程中对于低评级的公司债进行了减持；2季度我们判断经济走弱、企业盈利改善不足、市场风险偏好下降，操作上对于前期涨幅较多的可转债进行了获利了结，5 月22日本基金A端打开申赎，净申购后规模增长，待市场调整后适度增持了有估值优势的信用债；3季度，在判断市场资金面中性偏紧的基础上，本基金操作偏向保守，减持了可转债，并卖出了部分低评级的公司债；4季度，市场形势未见好转，本基金A端于11月22日末打开申购赎回，为应对

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

赎回，本基金适度减持了较长久期，较低评级的公司债、企业债，兼顾收益的基础上保持了适度的流动性。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至2013年12月31日，本基金份额净值为1.1979元，本报告期本基金份额净值增长率7.30%，同期业绩比较基准增长率-3.75%。

4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望

展望2014年，我们判断经济整体走弱，物价温和可控，CPI中枢将维持在低位，经济去产能、去杠杆背景下，财政政策积极，货币政策中性；受利率市场化进程加快、影子银行体系快速发展等诸多因素影响，金融体系负债端成本上升，资产端风险加大，债券市场资金面大概率继续维持紧平衡状态，利率品收益率易上难下；年中信用债到期压力较大，在经济下行周期，偏紧的货币政策将催生信用风险事件的爆发，信用品收益率可能受风险事件影响出现脉冲式上行；2014年整体债券各品种收益率继续承压，最大的不确定性在于央行政策转向的方式以及时点，若经济过剩产能去化顺利，或中性偏紧货币政策导致经济失速下滑，则央行阶段性宽松将带来资金面的缓解，利好债市。

投资策略上，本基金将精选个券，减持部分低评级信用债，优化持仓结构，采取相对保守的策略继续降低组合久期和杠杆；同时本基金将密切关注本届政府的改革力度和效果，并视改革程度及时调整投资策略。

4.6 管理人内部有关本基金的监察稽核工作情况

本报告期内，本基金管理人监察稽核一切从合规运作、防范和控制风险、保障基金份额持有人利益出发，由独立的监察稽核部门按照规定的权限和程序，认真履行职责，对公司、基金运作及员工行为的合规性进行定期和不定期监督和检查。发现问题及时提出建议并督促相关部门改进完善，及时与有关人员沟通，并定期制作监察稽核报告报公司经理层。

公司经理层层面成立了风险管理委员会，根据公司总体风险控制目标，分配各业务和各环节风险控制目标和要求；落实公司重大风险管理的决定或决议；听取并讨论会议成员的报告；对会议成员提出的或发现的已经存在的风险点，在充分讨论、协调基础上形成具体的风险控制措施；对潜在风险点分析讨论，拟定应对措施；对发生的风险事件和重大差错，分析原因、总结经验教训、风险定级、划分责任，向总经理办公会报告。

同时，进一步完善公司内控机制和体系，不断推动和督促公司相关的内控制度、规章和业务流程的建立、健全。全面开展基金运作监察稽核工作，确保基金投资的合法合规。通过定期检查、不定期抽查等工作方法，完善内部控制，基金运作没有出现违规行

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

为。

本报告期内，本基金管理人有关本基金的监察稽核主要工作如下：

1、在研究环节，关注研究报告形式与内容的合法性基础上，跟踪检查投资备选库的入选、维护依据；进一步规范新股询价、申购流程；定期检查关联方关系以及关联交易的日常维护；定期评估研究对投资的支持程度，对投资业绩的贡献度；

2、在投资交易环节，对投资运作过程中的风险点进行识别和监控,预防和控制由内部或外部流程、人员和系统失控而造成的损失；根据法律法规要求、基金合同约定、投资决策委员会的决定，适时提出增加或优化交易系统风控指标的建议，通过投资交易系统控制投资风险；跟踪每日的交易行为和交易结果，发现预警信息通过电话、邮件及合规提示及时提醒，保障投资环节的合规运作；监督检查风险管理部参与各投资组合新股申购、一级债申购、银行间交易等场外交易，保证各投资组合场外交易的事中合规控制；

3、投资管理人员管理环节，加强对投资管理人员MSN、办公电话、移动电话、终端设备网上交易的合规监控，建立投资管理人员直系亲属账户及股票交易申报制度，采取各种有效方式杜绝老鼠仓、非公平交易及各种形式的利益输送行为；

4、基金募集与营销环节，对基金宣传推介材料及基金代销、定投、费率优惠等业务活动进行事前合规检查，做到事前防范风险，保障基金营销合法合规。在基金电子营销方面，对各类新兴业务的活动方案进行事前合规评估，保证业务开展同时的事前风险防范；

5、基金运营环节，加强对注册登记、基金会计、基金清算及基金估值业务的稽核力度，保证基金运营安全、准确；

6、信息披露环节，严格按照信息披露管理办法的规定，认真做好本基金的信息披露工作，保证信息披露的真实、准确、完整与及时。

本基金自成立以来，运作合法合规,内部控制和风险防范措施逐步完善，保障了基金份额持有人的利益。我们将继续加强监察稽核工作，不断完善内部控制和风险管理，保障基金合规运作。

4.7 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明

公司设立的基金估值委员会为公司基金估值决策机构，负责制定公司所管理基金的基本估值政策，对公司旗下基金已采用的估值政策、方法、流程的执行情况进行审核监督，对因经营环境或市场变化等导致需调整已实施的估值政策、方法和流程的，负责审查批准基金估值政策、方法和流程的变更和执行。确保基金估值工作符合相关法律法规和基金合同的规定，确保基金资产估值的公平、合理，有效维护投资人的利益。估值委员会由公司分管估值业务的高级管理人员、督察长、研究总监及监察稽核部负责人组成。

公司基金估值委员会下设基金估值工作小组，由具备丰富专业知识、两年以上基金

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

行业相关领域工作经历、熟悉基金投资品种定价及基金估值法律法规、具备较强专业胜任能力的基金经理、风险管理人员、监察稽核人员及基金运营人员组成。

基金经理作为估值工作小组的成员之一，在基金估值定价过程中，充分表达对相关问题及定价方案的意见或建议，参与估值方案提议的制定。但对估值政策和估值方案不具备最终表决权。

参与估值流程的各方还包括本基金托管银行和会计师事务所。托管人根据法律法规要求对基金估值及净值计算履行复核责任。会计师事务所对估值委员会采用的相关估值模型、假设及参数的适当性发表审核意见并出具报告。上述参与估值流程各方之间不存在任何重大利益冲突。

报告期内，本基金管理人未与任何第三方签定与估值相关的定价服务。

4.8 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

本基金本报告期未进行利润分配，符合相关法规及基金合同的规定。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

§5 托管人报告

5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明

本报告期内，本托管人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其他有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，诚信、尽责地履行了基金托管人义务，不存在损害本基金份额持有人利益的行为。

5.2 托管人对报告期内本基金投资运作遵规守信、净值计算、利润分配等情况的说明

本报告期内，本托管人根据国家有关法律法规、基金合同和托管协议的规定，对基金管理人在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金收益的计算、基金费用开支等方面进行了必要的监督、复核和审查，未发现其存在任何损害本基金份额持有人利益的行为。

本报告期内，本基金未进行利润分配。

5.3 托管人对本年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认真复核了本年度报告中的财务指标、净值表现、利润分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容，认为其真实、准确和完整，不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

§6 审计报告

6.1 审计报告基本信息

财务报表是否经过审计	是
审计意见类型	标准无保留意见
审计报告编号	普华永道中天审字(2014)第21006号

6.2 审计报告的基本内容

审计报告标题	审计报告
审计报告收件人	天弘丰利分级债券型证券投资基金全体基金份额持有人
引言段	我们审计了后附的 天弘丰利分级债券型证券投资基金 (以下简称"天弘丰利基金")的财务报表，包括2013年12月31日的资产负债表、2013年度的利润表和所有者权益(基金净值)变动表以及财务报表附注。
管理层对财务报表的责任段	编制和公允列报财务报表是天弘丰利基金 的基金管理人天弘基金管理有限公司管理层的责任。这种责任包括： (1)按照企业会计准则和中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制财务报表，并使其实现公允反映； (2)设计、执行和维护必要的内部控制，以使财务报表不存在由于舞弊或错误导致的重大错报。
注册会计师的责任段	我们的责任是在执行审计工作的基础上对财务报表发表审计意见。我们按照中国注册会计师审计准则的规定执行了审计工作。中国注册会计师审计准则要求我们遵守中国注册会计师职业道德守则，计划和执行审计工作以对财务报表是否不存在重大错报获取合理保证。 审计工作涉及实施审计程序，以获取有关财务报表金额和披露的审计证据。选择的审计程序取决于注册会计师的判断，包括对由于舞弊或错误导致的财

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

	务报表重大错报风险的评估。在进行风险评估时，注册会计师考虑与财务报表编制和公允列报相关的内部控制，以设计恰当的审计程序，但目的并非对内部控制的有效性发表意见。审计工作还包括评价管理层选用会计政策的恰当性和作出会计估计的合理性，以及评价财务报表的总体列报。 我们相信，我们获取的审计证据是充分、适当的，为发表审计意见提供了基础。
审计意见段	我们认为，上述天弘丰利基金的财务报表在所有重大方面按照企业会计准则和在财务报表附注中所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制，公允反映了天弘丰利基金2013年12月31日的财务状况以及 2013年度的经营成果和基金净值变动情况。
注册会计师的姓名	
单峰	
魏佳亮	
会计师事务所的名称	普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）
会计师事务所的地址	中国上海市湖滨路 202 号普华永道中心11 楼
审计报告日期	2014-03-26

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：天弘丰利分级债券型证券投资基金

报告截止日：2013年12月31日

单位：人民币元

资 产	附注号	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
资 产：			
银行存款	7.4.7.1	1,994,654.61	20,174,670.27
结算备付金		28,483,076.39	65,004,438.03
存出保证金		16,923.58	250,000.00
交易性金融资产	7.4.7.2	1,785,581,811.00	1,713,592,552.04
其中：股票投资		—	—
基金投资		—	—
债券投资		1,785,581,811.00	1,713,592,552.04
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
衍生金融资产	7.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	7.4.7.4	—	—
应收证券清算款		—	—
应收利息	7.4.7.5	38,328,020.16	31,785,344.52
应收股利		—	—
应收申购款		—	—
递延所得税资产		—	—
其他资产	7.4.7.6	—	—
资产总计		1,854,404,485.74	1,830,807,004.86
负债和所有者权益	**附注号**	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
负 债：			
短期借款		—	—

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

交易性金融负债		—	—
衍生金融负债	7.4.7.3	—	—
卖出回购金融资产款		857,946,473.38	468,100,000.00
应付证券清算款		838,779.26	15,512,167.68
应付赎回款		—	—
应付管理人报酬		592,444.96	799,705.52
应付托管费		169,269.97	228,487.30
应付销售服务费		296,222.49	399,852.80
应付交易费用	7.4.7.7	1,308.96	7,660.05
应交税费		—	—
应付利息		4,662.22	—
应付利润		—	—
递延所得税负债		—	—
其他负债	7.4.7.8	314,387.50	569,000.00
负债合计		860,163,548.74	485,616,873.35
所有者权益：			
实收基金	7.4.7.9	801,145,555.30	1,146,563,328.10
未分配利润	7.4.7.10	193,095,381.70	198,626,803.41
所有者权益合计		994,240,937.00	1,345,190,131.51
负债和所有者权益总计		1,854,404,485.74	1,830,807,004.86

注：报告截止日 2013 年 12 月 31 日，天弘丰利分级债券型证券投资基金的份额净值 1.1979 元，天弘丰利分级债券型证券投资基金 A 类基金份额参考净值 1.0043 元，天弘丰利分级债券型证券投资基金 B 类基金份额参考净值 1.3366 元；基金份额总额 829,954,815.54 份，其中天弘丰利分级债券型证券投资基金 A 类基金份额 346,311,277.05 份，天弘丰利分级债券型证券投资基金 B 类基金份额 483,643,538.49 份。

7.2 利润表

会计主体：天弘丰利分级债券型证券投资基金

本报告期：2013年01月01日至2013年12月31日

单位：人民币元

项 目	附注号	本期2013年01月01日至2013年12月31日	上年度可比期间2012年01月01日至2012年12月31日
一、收入		62,317,485.36	257,729,788.15

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

1.利息收入		102,223,596.97	135,815,465.56
其中：存款利息收入	7.4.7.11	563,141.81	1,309,756.77
债券利息收入		101,423,295.76	134,348,050.23
资产支持证券利息收入		—	—
买入返售金融资产收入		237,159.40	157,658.56
其他利息收入		—	—
2.投资收益(损失以“-”填列)		30,095,182.98	112,582,338.58
其中：股票投资收益	7.4.7.12	—	—
基金投资收益		—	—
债券投资收益	7.4.7.13	30,095,182.98	112,582,338.58
资产支持证券投资收益		—	—
贵金属投资收益		—	—
衍生工具收益	7.4.7.14	—	—
股利收益	7.4.7.15	—	—
3.公允价值变动收益（损失以“-”号填列）	7.4.7.16	-70,001,294.59	9,279,484.01
4.汇兑收益（损失以“—”号填列）		—	—
5.其他收入（损失以“-”号填列）	7.4.7.17	—	52,500.00
减：二、费用		30,554,541.24	46,286,588.36
1．管理人报酬	7.4.10.2.	10,463,375.66	12,870,704.96
2．托管费	7.4.10.2.	2,989,535.92	3,677,344.31
3．销售服务费	7.4.10.2.	5,231,687.84	6,435,352.45
4．交易费用	7.4.7.18	14,666.07	61,667.43
5．利息支出		11,258,555.75	22,739,741.10
其中：卖出回购金融资产支出		11,258,555.75	22,739,741.10
6．其他费用	7.4.7.19	596,720.00	501,778.11
三、利润总额（亏损总额以“-”号填列）		31,762,944.12	211,443,199.79
减：所得税费用		—	—

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

四、净利润（净亏损以“-”号填列）		31,762,944.12	211,443,199.79

7.3 所有者权益（基金净值）变动表

会计主体：天弘丰利分级债券型证券投资基金

本报告期：2013年01月01日至2013年12月31日

单位：人民币元

项 目	本期 2013年01月01日至2013年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,146,563,328.10	198,626,803.41	1,345,190,131.51
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）		31,762,944.12	31,762,944.12
三、本期基金份额交易产生的基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）	-345,417,772.80	-37,294,365.83	-382,712,138.63
其中：1.基金申购款	620,892,369.95	43,079,633.04	663,972,002.99
2.基金赎回款	-966,310,142.75	-80,373,998.87	-1,046,684,141.62
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	—	—	—
五、期末所有者权益（基金净值）	801,145,555.30	193,095,381.70	994,240,937.00
项 目	上年度可比期间2012年01月01日至2012年12月31日		
	实收基金	未分配利润	所有者权益合计
一、期初所有者权益（基金净值）	1,667,907,313.68	16,240,843.24	1,684,148,156.92
二、本期经营活动产生的基金净值变动数（本期利润）	—	211,443,199.79	211,443,199.79
三、本期基金份额交易产生的	-521,343,985.58	-29,057,239.62	-550,401,225.20

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

基金净值变动数（净值减少以“-”号填列）			
其中：1.基金申购款	1,056,464,540.75	29,447,167.39	1,085,911,708.14
2.基金赎回款	-1,577,808,526.33	-58,504,407.01	-1,636,312,933.34
四、本期向基金份额持有人分配利润产生的基金净值变动（净值减少以“-”号填列）	—	—	—
五、期末所有者权益（基金净值）	1,146,563,328.10	198,626,803.41	1,345,190,131.51

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告7.1至7.4财务报表由下列负责人签署:

郭树强	韩海潮	薄贺龙
_____	_____	_____
基金管理公司负责人	主管会计工作负责人	会计机构负责人

7.4 报表附注

7.4.1 基金基本情况

天弘丰利分级债券型证券投资基金(以下简称"本基金")经中国证券监督管理委员会(以下简称"中国证监会")证监许可[2011]第1210号《关于核准天弘丰利分级债券型证券投资基金募集的批复》核准，由天弘基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘丰利分级债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型证券投资基金，首次设立募集不包括认购资金利息共募集1,667,336,466.82元，业经普华永道中天会计师事务所有限公司普华永道中天验字(2011)第428号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《天弘丰利分级债券型证券投资基金基金合同》于2011年11月23日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为1,667,907,313.68份基金份额，其中天弘丰利分级债券型证券投资基金A类份额(以下简称"丰利A") 1,184,263,775.19份，天弘丰利分级债券型证券投资基金B类份额(以下简称"丰利B") 483,643,538.49份；认购资金利息折合570,846.86份基金份额，其中丰利A为501,308.37份，丰利B为69,538.49份。募集结束时，丰利A与丰利B的份额配比为2.44862937：1。本基金的基金管理人为天弘基金管理有限公司，基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。

根据《天弘丰利分级债券型证券投资基金基金合同》(以下简称"基金合同")和《天弘丰利分级债券型证券投资基金招募说明书》(以下简称"招募说明书")的有关规定，自基金合同生效之日起3年内，丰利A每满6个月开放一次，丰利B封闭运作并上市交易。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

在丰利A的每次开放日，基金管理人将对丰利A进行基金份额折算，丰利A的基金份额净值调整为1.0000元，基金份额持有人持有的丰利A份额数按折算比例相应增减。自基金合同生效之日起3年内，丰利A的份额余额原则上不得超过3倍丰利B的份额余额。丰利B封闭运作，封闭期为基金合同生效之日起至3年后对应日止，封闭期内不接受申购与赎回。本基金在扣除丰利A的应计收益后的全部剩余收益归丰利B享有，亏损以丰利B的资产净值为限由丰利B承担。丰利A根据基金合同的规定获取约定收益，其收益率将在每个开放日设定一次并公告，计算公式为：丰利A的年收益率(单利)＝1.35×1年期银行定期存款利率，年收益率计算按照四舍五入的方法保留到小数点后第2位。自基金合同生效之日起，基金管理人将根据届时中国人民银行公布并执行的金融机构人民币1年期银行定期存款基准利率设定丰利A的首次年收益率；在丰利A的每个开放日，基金管理人将根据该日中国人民银行公布并执行的金融机构人民币1年期银行定期存款基准利率重新设定丰利A的年收益率。

基金合同生效后，在丰利A的开放日计算丰利A的基金份额净值，在丰利B的封闭期届满日分别计算丰利A和丰利B的基金份额净值；基金管理人在计算基金资产净值的基础上，采用"虚拟清算"原则分别计算并公告丰利A和丰利B的基金份额参考净值，其中，丰利A的基金份额参考净值计算日不包括丰利A的开放日。自基金合同生效后3年期届满，本基金转换为上市开放式基金(LOF)，本基金将不再进行基金份额分级，丰利A和丰利B的基金份额将以各自的基金份额净值为基准转换为上市开放式基金(LOF)份额，并办理基金的申购与赎回业务。

经深圳证券交易所(以下简称"深交所")深证上字[2012]第26号文审核同意，本基金丰利B(150046)138,589,034.00份基金份额于2012年2月20日在深交所挂牌交易。未上市交易的基金份额托管在场外，基金份额持有人可通过跨系统转托管业务将其转至深交所场内后即可上市流通。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《天弘丰利分级债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资对象是具有良好流动性的金融工具，主要投资于国内依法发行上市的国债、央行票据、金融债、企业债、公司债、次级债、地方政府债券、可转换债券(含分离交易可转债)、短期融资券、资产支持证券、债券回购、银行存款以及法律、法规或监管机构允许基金投资的其它固定收益类金融工具及其衍生工具。本基金对债券等固定收益类证券品种的投资比例不低于基金资产的80%，其中，投资于信用债券的资产占基金固定收益类资产的比例不低于40%，持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金对非债券类资产的投资比例不超过基金资产的20%。本基金业绩比较基准：中债综合指数。

本财务报表由本基金的基金管理人天弘基金管理有限公司于2014年3月26日批准报出。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

7.4.2 会计报表的编制基础

本基金的财务报表按照财政部于2006年2月15日颁布的《企业会计准则－基本准则》和38项具体会计准则、其后颁布的企业会计准则应用指南、企业会计准则解释以及其他相关规定(以下合称"企业会计准则")、中国证监会颁布的《证券投资基金信息披露XBRL模板第3号<年度报告和半年度报告>》、中国证券投资基金业协会颁布的《证券投资基金会计核算业务指引》、《天弘丰利分级债券型证券投资基金投资基金基金合同》和在财务报表附注7.4.4所列示的中国证监会发布的有关规定及允许的基金行业实务操作编制。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

7.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2013年度的财务报表符合企业会计准则的要求，真实、完整地反映了本基金2013年12月31日的财务状况以及2013年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

7.4.4 重要会计政策和会计估计

7.4.4.1 会计年度

本基金会计年度为公历1月1日起至12月31日止。

7.4.4.2 记账本位币

本基金的记账本位币为人民币。

7.4.4.3 金融资产和金融负债的分类

(1) 金融资产的分类

金融资产于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产、应收款项、可供出售金融资产及持有至到期投资。金融资产的分类取决于本基金对金融资产的持有意图和持有能力。本基金现无金融资产分类为可供出售金融资产及持有至到期投资。

本基金目前以交易目的持有的债券投资分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产。以公允价值计量且其公允价值变动计入损益的金融资产在资产负债表中以交易性金融资产列示。

本基金持有的其他金融资产分类为应收款项，包括银行存款、买入返售金融资产和其他各类应收款项等。应收款项是指在活跃市场中没有报价、回收金额固定或可确定的非衍生金融资产。

(2) 金融负债的分类

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

金融负债于初始确认时分类为：以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债及其他金融负债。本基金目前暂无金融负债分类为以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融负债。本基金持有的其他金融负债包括卖出回购金融资产款和其他各类应付款项等。

7.4.4.4 金融资产和金融负债的初始确认、后续计量和终止确认

金融资产或金融负债于本基金成为金融工具合同的一方时，按公允价值在资产负债表内确认。以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，取得时发生的相关交易费用计入当期损益；对于支付的价款中包含的债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，单独确认为应收项目。应收款项和其他金融负债的相关交易费用计入初始确认金额。

对于以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产，按照公允价值进行后续计量；对于应收款项和其他金融负债采用实际利率法，以摊余成本进行后续计量。

金融资产满足下列条件之一的，予以终止确认：(1)收取该金融资产现金流量的合同权利终止；(2)该金融资产已转移，且本基金将金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬转移给转入方；或者(3)该金融资产已转移，虽然本基金既没有转移也没有保留金融资产所有权上几乎所有的风险和报酬，但是放弃了对该金融资产控制。

金融资产终止确认时，其账面价值与收到的对价的差额，计入当期损益。

当金融负债的现时义务全部或部分已经解除时，终止确认该金融负债或义务已解除的部分。终止确认部分的账面价值与支付的对价之间的差额，计入当期损益。

7.4.4.5 金融资产和金融负债的估值原则

本基金持有的债券投资按如下原则确定公允价值并进行估值：

(1) 存在活跃市场的金融工具按其估值日的市场交易价格确定公允价值；估值日无交易，但最近交易日后经济环境未发生重大变化且证券发行机构未发生影响证券价格的重大事件的，按最近交易日的市场交易价格确定公允价值。

(2) 存在活跃市场的金融工具，如估值日无交易且最近交易日后经济环境发生了重大变化，参考类似投资品种的现行市价及重大变化等因素，调整最近交易市价以确定公允价值。

(3) 当金融工具不存在活跃市场，采用市场参与者普遍认同且被以往市场实际交易价格验证具有可靠性的估值技术确定公允价值。估值技术包括参考熟悉情况并自愿交易的各方最近进行的市场交易中使用的价格、参照实质上相同的其他金融工具的当前公允价值、现金流量折现法和期权定价模型等。采用估值技术时，尽可能最大程度使用市场参数，减少使用与本基金特定相关的参数。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

7.4.4.6 金融资产和金融负债的抵销

本基金持有的资产和承担的负债基本为金融资产和金融负债。当本基金1)具有抵销已确认金额的法定权利且该种法定权利现在是可执行的；且2)交易双方准备按净额结算时，金融资产与金融负债按抵销后的净额在资产负债表中列示。

7.4.4.7 实收基金

实收基金为对外发行基金份额所募集的总金额在扣除损益平准金分摊部分后的余额。由于基金份额折算引起的实收基金份额变动于基金份额折算日根据折算前的基金份额数及确定的折算比例计算认列。由于申购和赎回引起的实收基金变动分别于基金申购确认日及基金赎回确认日认列。

7.4.4.8 损益平准金

损益平准金包括已实现平准金和未实现平准金。已实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未分配的已实现损益占基金净值比例计算的金额。未实现平准金指在申购或赎回基金份额时，申购或赎回款项中包含的按累计未实现损益占基金净值比例计算的金额。损益平准金于基金申购确认日或基金赎回确认日认列，并于期末全额转入未分配利润/(累计亏损)。

7.4.4.9 收入/(损失)的确认和计量

债券投资在持有期间应取得的按票面利率或者发行价计算的利息扣除在适用情况下由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认为利息收入。

以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产在持有期间的公允价值变动确认为公允价值变动损益；于处置时，其处置价格与初始确认金额之间的差额确认为投资收益，其中包括从公允价值变动损益结转的公允价值累计变动额。

应收款项在持有期间确认的利息收入按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的则按直线法计算。

7.4.4.10 费用的确认和计量

本基金的管理人报酬、托管费和销售服务费在费用涵盖期间按基金合同约定的费率和计算方法逐日确认。

其他金融负债在持有期间确认的利息支出按实际利率法计算，实际利率法与直线法差异较小的也可按直线法计算。

7.4.4.11 基金的收益分配政策

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

本基金《基金合同》生效之日起3年内不进行收益分配。本基金转换为上市开放式基金(LOF)后，每一基金份额享有同等分配权。本基金收益以现金形式分配，其中场外基金份额持有人可选择现金红利或将现金红利按分红除权日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资，场内基金份额持有人只能选择现金分红。若期末未分配利润中的未实现部分为正数，包括基金经营活动产生的未实现损益以及基金份额交易产生的未实现平准金等，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润中的已实现部分；若期末未分配利润的未实现部分为负数，则期末可供分配利润的金额为期末未分配利润，即已实现部分相抵未实现部分后的余额。

经宣告的拟分配基金收益于分红除权日从所有者权益转出。

7.4.4.12 分部报告

本基金以内部组织结构、管理要求、内部报告制度为依据确定经营分部，以经营分部为基础确定报告分部并披露分部信息。经营分部是指本基金内同时满足下列条件的组成部分：(1) 该组成部分能够在日常活动中产生收入、发生费用；(2) 本基金管理人能够定期评价该组成部分的经营成果，以决定向其配置资源、评价其业绩；(3) 本基金能够取得该组成部分的财务状况、经营成果和现金流量等有关会计信息。如果两个或多个经营分部具有相似的经济特征，并且满足一定条件的，则合并为一个经营分部。

本基金目前以一个单一的经营分部运作，不需要披露分部信息。

7.4.4.13 其他重要的会计政策和会计估计

根据本基金的估值原则和中国证监会允许的基金行业估值实务操作，本基金确定以下类别债券投资的公允价值时采用的估值方法及其关键假设如下：

在银行间同业市场交易的债券品种，根据中国证监会证监会计字[2007]21号《关于证券投资基金执行<企业会计准则>估值业务及份额净值计价有关事项的通知》采用估值技术确定公允价值。本基金持有的银行间同业市场债券按现金流量折现法估值，具体估值模型、参数及结果由中央国债登记结算有限责任公司独立提供。

7.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

7.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本期及上年度可比期间未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本期及上年度可比期间未发生会计估计变更。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

7.4.5.3 差错更正的说明

本基金本期及上年度可比期间无须说明的会计差错更正。

7.4.6 税项

根据财政部、国家税务总局财税[2002]128号《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》、财税[2008]1号《关于企业所得税若干优惠政策的通知》及其他相关财税法规和实务操作，主要税项列示如下：

(1) 以发行基金方式募集资金不属于营业税征收范围，不征收营业税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入，包括买卖债券的差价收入，债券的利息收入及其他收入，暂不征收企业所得税。

(3) 对基金取得的企业债券利息收入，应由发行债券的企业在向基金支付利息时代扣代缴20%的个人所得税。

7.4.7 重要财务报表项目的说明

7.4.7.1 银行存款

单位：人民币元

项目	本期末 2013年12月31日	上年度末 2012年12月31日
活期存款	1,994,654.61	20,174,670.27
定期存款	—	—
其他存款	—	—
合计	1,994,654.61	20,174,670.27

7.4.7.2 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末2013年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		—	—	—
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—
债券	交易所市场	1,286,669,711.22	1,253,531,811.00	-33,137,900.22
	银行间市场	552,157,968.78	532,050,000.00	-20,107,968.78

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

	合计	1,838,827,680.00	1,785,581,811.00	-53,245,869.00
资产支持证券		—	—	—
基金		—	—	—
其他		—	—	—
合计		1,838,827,680.00	1,785,581,811.00	-53,245,869.00
项目		上年度末2012年12月31日		
		成本	公允价值	公允价值变动
股票		—	—	—
贵金属投资-金交所黄金合约		—	—	—
债券	交易所市场	1,216,851,126.45	1,224,855,552.04	8,004,425.59
	银行间市场	479,986,000.00	488,737,000.00	8,751,000.00
	合计	1,696,837,126.45	1,713,592,552.04	16,755,425.59
资产支持证券		—	—	—
基金		—	—	—
其他		—	—	—
合计		1,696,837,126.45	1,713,592,552.04	16,755,425.59

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本期末及上年度末未持有衍生金融资产/负债。

7.4.7.4 买入返售金融资产

7.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本期末及上年度末未持有买入返售金融资产。

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本期末及上年度末未持有因买断式逆回购交易中取得的债券。

7.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末2013年12月31日	上年度末2012年12月31日
应收活期存款利息	365.00	6,569.42
应收定期存款利息	—	—

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

应收其他存款利息	—	—
应收结算备付金利息	14,112.78	32,177.20
应收债券利息	38,313,534.02	31,746,597.90
应收买入返售证券利息	—	—
应收申购款利息	—	—
应收黄金合约拆借孳息	—	—
其他	8.36	—
合计	38,328,020.16	31,785,344.52

7.4.7.6 其他资产

本基金本期末及上年度末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末2013年12月31日	上年度末2012年12月31日
交易所市场应付交易费用	—	—
银行间市场应付交易费用	1,308.96	7,660.05
合计	1,308.96	7,660.05

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末2013年12月31日	上年度末2012年12月31日
应付券商交易单元保证金	—	250,000.00
应付赎回费	—	—
预提费用	309,000.00	319,000.00
其他应付	5,387.50	—
合计	314,387.50	569,000.00

7.4.7.9 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期:2013年01月01日至2013年12月31日	
(丰利A)	基金份额（份）	账面金额

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

上年度末	694,690,401.01	662,919,789.61
本期申购	663,972,002.99	620,892,369.95
本期赎回（以“-”号填列）	-1,046,684,141.62	-966,310,142.75
基金拆分/份额折算前	—	—
基金拆分/份额折算变动份额	34,333,014.67	—
本期末	346,311,277.05	317,502,016.81
项目 (丰利B)	基金份额（份）	账面金额
上年度末	483,643,538.49	483,643,538.49
本期申购	—	—
本期赎回（以“-”号填列）	—	—
本期末	483,643,538.49	483,643,538.49

注：1、截至 2013 年 12 月 31 日止，本基金于深交所上市的基金份额为 381,440,958.00 份，均为丰利 B 份额，托管在场外未上市交易的基金份额为 448,513,857.54 份，其中丰利 A 份额为 346,311,277.05 份，丰利 B 份额为 102,202,580.49 份。上市的基金份额登记在证券登记结算系统，可选择按市价流通；未上市的基金份额登记在注册登记系统，按基金份额净值申购或赎回。通过跨系统转登记可实现基金份额在两个系统之间的转换。

2、丰利 A 分别与 2013 年 5 月 22 日和 2013 年 11 月 22 日开放申购和赎回业务。丰利 B 封闭运作，封闭期内不接受申购与赎回。丰利 B 的封闭期为《基金合同》生效之日起至 3 年后对应日止。如该对应日为非工作日，则顺延至下一个工作日。

3、自基金合同生效之日起每满 6 个月的最后一个工作日，本基金的基金管理人对丰利 A 进行基金份额折算，丰利 A 的基金份额净值调整为 1.0000 元，基金份额持有人持有的丰利 A 份额数按招募说明书规定的折算方式进行折算，折算后丰利 A 的份额余额原则上不得超过 3 倍丰利 B 的份额余额。

7.4.7.10 未分配利润

单位：人民币元

项目	已实现部分	未实现部分	未分配利润合计
上年度末	184,495,261.49	14,131,541.92	198,626,803.41
本期利润	101,764,238.71	-70,001,294.59	31,762,944.12
本期基金份额交易产生的变动数	-50,039,321.39	12,744,955.56	-37,294,365.83
其中：基金申购款	40,565,740.12	2,513,892.92	43,079,633.04
基金赎回款	-90,605,061.51	10,231,062.64	-80,373,998.87
本期已分配利润	—	—	—
本期末	236,220,178.81	-43,124,797.11	193,095,381.70

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期 2013年01月01日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年01月01日至2012年12月31日
活期存款利息收入	101,889.22	193,033.22
定期存款利息收入	—	—
其他存款利息收入	—	—
结算备付金利息收入	457,624.75	1,116,723.55
其他	3,627.84	—
合计	563,141.81	1,309,756.77

7.4.7.12 股票投资收益

7.4.7.12.1 股票投资收益——买卖股票差价收入

本基金本期及上年度可比期间未取得股票投资收益。

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期 2013年01月01日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年01月01日至2012年12月31日
卖出债券（债转股及债券到期兑付）成交总额	1,340,537,539.92	5,333,470,520.16
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,264,291,530.88	5,094,732,158.72
减：应收利息总额	46,150,826.06	126,156,022.86
债券投资收益	30,095,182.98	112,582,338.58

7.4.7.14 衍生工具收益

本基金本期及上年度可比期间未取得衍生工具收益。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

7.4.7.15 股利收益

本基金本期及上年度可比期间未取得股利收益。

7.4.7.16 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期 2013年01月01日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年01月01日至2012年12月31日
1.交易性金融资产	-70,001,294.59	9,279,484.01
——股票投资	—	—
——债券投资	-70,001,294.59	9,279,484.01
——资产支持证券投资	—	—
——基金投资	—	—
——贵金属投资	—	—
2.衍生工具	—	—
——权证投资	—	—
3.其他	—	—
合计	-70,001,294.59	9,279,484.01

7.4.7.17 其他收入

单位：人民币元

项目	本期 2013年01月01日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年01月01日至2012年12月31日
基金赎回费收入	—	—
其他收入	—	52,500.00
合计	—	52,500.00

注：根据《天弘丰利分级债券型证券投资基金基金合同》，在基金合同生效之日起的 3 年内，丰利 A 不收取赎回费，丰利 B 不进行申购赎回。

7.4.7.18 交易费用

单位：人民币元

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

项目	本期 2013年01月01日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年01月01日至2012年12月31日
交易所市场交易费用	8,141.07	17,674.93
银行间市场交易费用	6,525.00	43,992.50
合计	14,666.07	61,667.43

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期 2013年01月01日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年01月01日至2012年12月31日
审计费用	90,000.00	99,407.60
信息披露费	400,000.00	290,370.51
其他	10,720.00	—
上市费	60,000.00	85,000.00
银行间帐户维护费	36,000.00	27,000.00
合计	596,720.00	501,778.11

7.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

7.4.8.1 或有事项

截至资产负债表日，本基金并无须作披露的或有事项。

7.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报告日，本基金并无须作披露的资产负债表日后事项。

7.4.9 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
天弘基金管理有限公司	基金管理人、基金销售机构
中国邮政储蓄银行股份有限公司("中国邮政储蓄银行")	基金托管人、基金代销机构
天津信托有限责任公司	基金管理人的股东
内蒙古君正能源化工股份有限公司	基金管理人的股东

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

芜湖高新投资有限公司	基金管理人的股东
北京天地方中资产管理有限公司	基金管理人的子公司

注：下述关联交易均在正常业务范围内按一般商业条款订立。

7.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

7.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本期及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

7.4.10.2 关联方报酬

7.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期 2013年01月01日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年01月01日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	10,463,375.66	12,870,704.96
其中：支付销售机构的客户维护费	2,636,792.81	3,947,336.10

注：1、支付基金管理人天弘基金管理有限公司 的管理人报酬按前一日基金资产净值 0.70%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日管理人报酬＝前一日基金资产净值 X 0.70% / 当年天数。

2、客户维护费是指基金管理人与基金销售机构在基金销售协议中约定的依据销售机构销售基金的保有量提取一定比例的客户维护费，用以向基金销售机构支付客户服务及销售活动中产生的相关费用，该费用从基金管理人收取的基金管理费中列支，不属于从基金资产中列支的费用项目。

7.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期 2013年01月01日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年01月01日至2012年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	2,989,535.92	3,677,344.31

注：支付基金托管人 中国邮政储蓄银行 的托管费按前一日基金资产净值 0.20%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付。其计算公式为：日托管费＝前一日基金资产净值 X 0.20% / 当年天数。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

7.4.10.2.3 销售服务费

单位：人民币元

获得销售服务费的各关联方名称	本期 2013年01月01日至2013年12月31日		
	丰利A	丰利B	合计
天弘基金管理有限公司	6,963.10	2,150,280.90	2,157,244.00
中国邮政储蓄银行	2,412,455.09	—	2,412,455.09
合计	2,419,418.19	2,150,280.90	4,569,699.09
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间2012年01月01日至2012年12月31日		
	丰利A	丰利B	合计
天弘基金管理有限公司	1,918.80	746,772.18	748,690.98
中国邮政储蓄银行	3,471,258.24	—	3,471,258.24
合计	3,473,177.04	746,772.18	4,219,949.22

注：支付基金销售机构的销售服务费按前一日基金资产净值 0.35%的年费率计提，逐日累计至每月月底，按月支付给天弘基金管理有限公司 ，再由 天弘基金管理有限公司 计算并支付给各基金销售机构。其计算公式为：日销售服务费＝前一日基金资产净值 X 0.35%/ 当年天数。

7.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本期及上年度可比期间本基金基金管理人未与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

7.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

7.4.10.4.1 报告期内基金管理人运用固有资金投资本基金的情况

份额单位：份

项目 (丰利B)	本期 2013年01月01日至2013年12月31日	上年度可比期间 2012年01月01日至2012年12月31日
期初持有的基金份额	30,831,600.00	—
期间申购/买入总份额	—	30,831,600.00
期间因拆分变动份额	—	—

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

减：期间赎回/卖出总份额	—	—
期末持有的基金份额	30,831,600.00	30,831,600.00
期末持有的基金份额占基金总份额比例	6.37%	6.37%

注：1、本基金本报告期内无基金管理人运用固有资金投资天弘丰利分级债券型证券投资基金 A 类基金的情况。
2、本表格中期末持有的基金份额占基金总份额比例中的“基金总份额”为丰利 B 类基金的总份额。

7.4.10.4.2 报告期末除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况

本基金本期末及上年度末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

7.4.10.5 由关联方保管的银行存款余额及当期产生的利息收入

单位：人民币元

关联方名称	本期2013年01月01日至2013年12月31日		上年度可比期间 2012年01月01日至2012年12月31日	
	期末余额	当期利息收入	期末余额	当期利息收入
中国邮政储蓄银行	1,994,654.61	101,889.22	20,174,670.27	193,033.22

注：本基金的银行存款由基金托管人中国邮政储蓄银行保管，按银行同业利率计息。

7.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本期及上年度可比期间未在承销期内参与关联方承销证券交易。

7.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本期及上年度可比期间无须作说明的其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

7.4.11.1 利润分配情况——非货币市场基金

本基金本期及上年度可比期间无利润分配事项。

7.4.12 期末（2013年12月31日）本基金持有的流通受限证券

7.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

本基金本报告期末未持有因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

本基金本报告期末未持有暂时停牌等流通受限股票。

7.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

7.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2013年12月31日，本基金从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额53,046,773.48元，是以如下债券作为抵押：

金额单位：人民币元

债券代码	债券名称	回购到期日	期末估值单价	数量（张）	期末估值总额
1382228	13雨润MTN1	2014-01-02	96.14	400,000	38,456,000.00
1282401	12雨润MTN1	2014-01-02	97.14	100,000	9,714,000.00
1280173	12绍新城债	2014-01-02	96.99	51,000	4,946,490.00
合计				551,000	53,116,490.00

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2013年12月31日止，基金从事证券交易所债券正回购交易形成的卖出回购证券款余额804,899,699.90元，于2014年1月2日到期。该类交易要求本基金转入质押库的债券，按证券交易所规定的比例折算为标准券后，不低于债券回购交易的余额。

7.4.13 金融工具风险及管理

7.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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。本基金基金合同生效之日起3年内，本基金的基金份额划分为丰利A、丰利B两级份额，丰利A为低风险、收益相对稳定的基金份额，丰利B为较高风险、较高收益的基金份额。本基金投资的金融工具主要包括固定收益证券品种及非债券类金融工具等。本基金在日常经营活动中面临的与这些金融工具相关的风险主要包括信用风险、流动性风险及市场风险。本基金的基金管理人从事风险管理的主要目标是争取在严格控制风险的前提下，谋求实现基金财产的长期稳定增长。

本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，建立了以审计与风险控制委员

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

会为核心的、由督察长、风险管理委员会、监察稽核部、风险管理部和相关业务部门构成的风险管理架构体系。本基金的基金管理人奉行全面风险管理体系的建设，董事会负责监督检查公司的合法合规运营、内部控制、风险管理，从而控制公司的整体运营风险。在董事会下设立审计与风险控制委员会，负责制定风险管理的宏观政策，审议通过风险控制的总体措施等；在管理层层面设立风险管理委员会，根据公司总体风险控制目标，分配各业务和各环节风险控制目标和要求；落实公司重大风险管理的决定或决议；听取并讨论会议成员的报告；对会议成员提出的或发现的已经存在的风险点，在充分讨论、协调基础上形成具体的风险控制措施；对潜在风险点分析讨论，拟定应对措施；对发生的风险事件和重大差错，分析原因、总结经验教训、风险定级、划分责任，向总经理办公会报告。在业务操作层面风险管理职责主要由监察稽核部负责，对公司风险管理政策和措施的执行情况进行监察，并为每一个部门的风险管理提供合规控制标准，使公司在一种风险管理和控制的环境中实现业务目标；监察稽核部对公司总经理负责，并由督察长分管。风险管理部通过投资交易系统的风控参数设置，保证各投资组合的投资比例合规；参与各投资组合新股申购、一级债申购、银行间交易等场外交易的风险识别与评估，保证各投资组合场外交易的事中合规控制；负责各投资组合投资绩效、风险的计量和控制。

本基金的基金管理人对于金融工具的风险管理方法主要是通过定性分析和定量分析的方法去估测各种风险产生的可能损失。从定性分析的角度出发，判断风险损失的严重程度和出现同类风险损失的频度。而从定量分析的角度出发，根据本基金的投资目标，结合基金资产所运用金融工具特征通过特定的风险量化指标、模型，日常的量化报告，确定风险损失的限度和相应置信程度，及时可靠地对各种风险进行监督、检查和评估，并通过相应决策，将风险控制在可承受的范围内。

7.4.13.2 信用风险

信用风险是指基金在交易过程中因交易对手未履行合约责任，或者基金所投资证券之发行人出现违约、拒绝支付到期本息等情况，导致基金资产损失和收益变化的风险。

本基金的基金管理人在交易前对交易对手的资信状况进行了充分的评估。本基金的银行存款存放在本基金的托管行中国邮政储蓄银行，与该银行存款相关的信用风险不重大。本基金在交易所进行的交易均以中国证券登记结算有限责任公司为交易对手完成证券交收和款项清算，违约风险可能性很小；在银行间同业市场进行交易前均对交易对手进行信用评估并对证券交割方式进行限制以控制相应的信用风险。

本基金的基金管理人建立了信用风险管理流程，通过对投资品种信用等级评估来控制证券发行人的信用风险，且通过分散化投资以分散信用风险。

本基金债券投资的信用评级情况按《中国人民银行信用评级管理指导意见》设定的

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

标准统计及汇总。

7.4.13.2.1 按短期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

短期信用评级	本期末	上年度末
A-1	69,761,000.00	—
A-1以下	—	—
未评级	69,586,000.00	19,972,000.00
合计	139,347,000.00	19,972,000.00

注：未评级债券主要为国债及政策性金融债。

7.4.13.2.2 按长期信用评级列示的债券投资

单位：人民币元

长期信用评级	本期末	上年度末
AAA	2,295,641.00	40,542,124.00
AAA以下	1,643,939,170.00	1,653,078,428.04
未评级	—	—
合计	1,646,234,811.00	1,693,620,552.04

7.4.13.3 流动性风险

流动性风险是指基金在履行与金融负债有关的义务时遇到资金短缺的风险。本基金的流动性风险一方面来自于基金份额持有人可随时要求赎回其持有的基金份额，另一方面来自于投资品种所处的交易市场不活跃而带来的变现困难或因投资集中而无法在市场出现剧烈波动的情况下以合理的价格变现。

针对兑付赎回资金的流动性风险，本基金的基金管理人定期对本基金的申购赎回情况进行严密监控并预测流动性需求，保持基金投资组合中的可用现金头寸与之相匹配。本基金的基金管理人在基金合同中设计了巨额赎回条款，约定在非常情况下赎回申请的处理方式，控制因开放申购赎回模式带来的流动性风险，有效保障基金持有人利益。

针对投资品种变现的流动性风险，本基金的基金管理人通过独立的风险管理部门设定流动性比例要求，对流动性指标进行持续的监测和分析，包括组合持仓集中度指标、组合在短时间内变现能力的综合指标、组合中变现能力较差的投资品种比例以及流通受限制的投资品种比例等。本基金投资于一家公司发行的股票市值不超过基金资产净值的10%，且本基金与由本基金的基金管理人管理的其他基金共同持有一家公司发行的证券

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

不得超过该证券的10%。本基金所持大部分证券在银行间同业市场交易，其余亦可在证券交易所上市交易，因此除附注7.4.12中列示的部分基金资产流通暂时受限制不能自由转让的情况外，其余均能以合理价格适时变现。此外，本基金可通过卖出回购金融资产方式借入短期资金应对流动性需求，其上限一般不超过基金持有的债券投资的公允价值。

于2013年12月31日，除卖出回购金融资产款余额中有857,946,473.38元将在一个月以内到期且计息(该利息金额不重大)外，本基金所承担的其他金融负债的合约约定到期日均为一个月以内且不计息，可赎回基金份额净值(所有者权益)无固定到期日且不计息，因此账面余额约为未折现的合约到期现金流量。

7.4.13.4 市场风险

市场风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因所处市场各类价格因素的变动而发生波动的风险，包括利率风险、外汇风险和其他价格风险。

7.4.13.4.1 利率风险

利率风险是指金融工具的公允价值或现金流量受市场利率变动而发生波动的风险。利率敏感性金融工具均面临由于市场利率上升而导致公允价值下降的风险，其中浮动利率类金融工具还面临每个付息期间结束根据市场利率重新定价时对于未来现金流影响的风险。

本基金的基金管理人定期对本基金面临的利率敏感性缺口进行监控，并通过调整投资组合的久期等方法对上述利率风险进行管理。

本基金主要投资于交易所及银行间市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2013年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	1,994,654.61	—	—	—	1,994,654.61
结算备付金	28,483,076.39	—	—	—	28,483,076.39
存出保证金	16,923.58	—	—	—	16,923.58

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

交易性金融资产	482,922,500.00	977,415,323.00	325,243,988.00	—	1,785,581,811.00
应收利息	—	—	—	38,328,020.16	38,328,020.16
资产总计	513,417,154.58	977,415,323.00	325,243,988.00	38,328,020.16	1,854,404,485.74
负债					
卖出回购金融资产款	857,946,473.38	—	—	—	857,946,473.38
应付证券清算款	—	—	—	838,779.26	838,779.26
应付管理人报酬	—	—	—	592,444.96	592,444.96
应付托管费	—	—	—	169,269.97	169,269.97
应付销售服务费	—	—	—	296,222.49	296,222.49
应付交易费用	—	—	—	1,308.96	1,308.96
应付利息	—	—	—	4,662.22	4,662.22
其他负债	—	—	—	314,387.50	314,387.50
负债总计	857,946,473.38	—	—	2,217,075.36	860,163,548.74
利率敏感度缺口	-344,529,318.80	977,415,323.00	325,243,988.00	36,110,944.80	994,240,937.00
上年度末2012年12月31日	1年以内	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	20,174,670.27	—	—	—	20,174,670.27
结算备付金	65,004,438.03	—	—	—	65,004,438.03
存出保证金	—	—	—	250,000.00	250,000.00
交易性金融资产	59,874,235.62	1,311,660,209.92	342,058,106.50	—	1,713,592,552.04

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

应收利息	—	—	—	31,785,344.52	31,785,344.52
资产总计	145,053,343.92	1,311,660,209.92	342,058,106.50	32,035,344.52	1,830,807,004.86
负债					
卖出回购金融资产款	468,100,000.00	—	—	—	468,100,000.00
应付证券清算款	—	—	—	15,512,167.68	15,512,167.68
应付管理人报酬	—	—	—	799,705.52	799,705.52
应付托管费	—	—	—	228,487.30	228,487.30
应付销售服务费	—	—	—	399,852.80	399,852.80
应付交易费用	—	—	—	7,660.05	7,660.05
其他负债	—	—	—	569,000.00	569,000.00
负债总计	468,100,000.00	—	—	17,516,873.35	485,616,873.35
利率敏感度缺口	-323,046,656.08	1,311,660,209.92	342,058,106.50	14,518,471.17	1,345,190,131.51

注：表中所示为本基金资产及负债的账面价值，并按照合约规定的利率重新定价日或到期日孰早者予以分类。

7.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

假设	除市场利率以外的其他市场变量保持不变		
分析	相关风险变量的变动	对资产负债表日基金资产净值的影响金额（单位：人民币元）	
		本期末	上年度末
	市场利率下降25个基点	9,217,800.00	15,114,400.00
	市场利率上升25个基点	-9,130,000.00	-14,920,700.00

7.4.13.4.2 外汇风险

外汇风险是指金融工具的公允价值或未来现金流量因外汇汇率变动而发生波动的风险。本基金的所有资产及负债以人民币计价，因此无重大外汇风险。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

7.4.13.4.3 其他价格风险

其他价格风险是指基金所持金融工具的公允价值或未来现金流量因除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素变动而发生波动的风险。本基金主要投资于证券交易所上市或银行间同业市场交易的股票和债券，所面临的其他价格风险来源于单个证券发行主体自身经营情况或特殊事项的影响，也可能来源于证券市场整体波动的影响。

本基金的基金管理人在构建和管理投资组合的过程中，采用"自上而下"的策略，通过对宏观经济情况及政策的分析，结合证券市场运行情况，做出资产配置及组合构建的决定；通过对单个证券的定性分析及定量分析，选择符合基金合同约定范围的投资品种进行投资。本基金的基金管理人定期结合宏观及微观环境的变化，对投资策略、资产配置、投资组合进行修正，来主动应对可能发生的市场价格风险。

本基金通过投资组合的分散化降低其他价格风险。本基金对债券等固定收益类证券品种的投资比例不低于基金资产的80%，其中，持有现金或到期日在一年以内的政府债券不低于基金资产净值的5%。本基金对非债券类资产的投资比例不超过基金资产的20%。此外，本基金的基金管理人每日对本基金所持有的证券价格实施监控，定期运用多种定量方法对基金进行风险度量，包括VaR(Value at Risk)指标等来测试本基金面临的潜在价格风险，及时可靠地对风险进行跟踪和控制。

7.4.13.4.3.1 其他价格风险敞口

金额单位：人民币元

项目	本期末 2013年12月31日		上年度末 2012年12月31日	
	公允价值	占基金资产净值比例（%）	公允价值	占基金资产净值比例（%）
交易性金融资产-股票投资	—	—	—	—
交易性金融资产-债券投资	—	—	—	—
交易性金融资产-贵金属投资	—	—	—	—
衍生金融资产－权证投资	—	—	—	—
其他	—	—	—	—

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

合计	—	—	—	—

7.4.13.4.3.2 其他价格风险的敏感性分析

于2013年12月31日，本基金未持有交易性权益类投资(2012年12月31日：未持有)，因此除市场利率和外汇汇率以外的市场价格因素的变动对于本基金资产净值无重大影响(2012年12月31日：同)。

7.4.14 有助于理解和分析会计报表需要说明的其他事项

(1) 公允价值

(a)不以公允价值计量的金融工具

不以公允价值计量的金融资产和负债主要包括应收款项和其他金融负债，其账面价值与公允价值相差很小。

(b)以公允价值计量的金融工具

(i)金融工具公允价值计量的方法

根据在公允价值计量中对计量整体具有重大意义的最低层级的输入值，公允价值层级可分为：

第一层级：相同资产或负债在活跃市场上(未经调整)的报价。

第二层级：直接(比如取自价格)或间接(比如根据价格推算的)可观察到的、除第一层级中的市场报价以外的资产或负债的输入值。

第三层级：以可观察到的市场数据以外的变量为基础确定的资产或负债的输入值(不可观察输入值)。

(ii)各层级金融工具公允价值

于2013年12月31日，本基金持有的以公允价值计量且其变动计入当期损益的金融资产中属于第一层级的余额为1,243,531,811.00元，属于第二层级的余额为542,050,000.00元，无属于第三层级的余额(2012年12月31日：第一层级1,184,953,316.42元，第二层级528,639,235.62元，无属于第三层级的余额)。

(iii)公允价值所属层级间的重大变动

对于证券交易所上市的债券，若出现重大事项停牌、交易不活跃(包括涨跌停时的交易不活跃)、或属于非公开发行等情况，本基金不会于停牌日至交易恢复活跃日期间、交易不活跃期间及限售期间将相关债券的公允价值列入第一层级；并根据估值调整中采用的不可观察输入值对于公允价值的影响程度，确定相关债券公允价值应属第二层级还是第三层级。

(iv)第三层级公允价值余额和本期变动金额

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

无。

(2)除公允价值外，截至资产负债表日本基金无需要说明的其他重要事项。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

§8 投资组合报告

8.1 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	1,785,581,811.00	96.29
	其中：债券	1,785,581,811.00	96.29
	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	30,477,731.00	1.64
7	其他各项资产	38,344,943.74	2.07
8	合计	1,854,404,485.74	100.00

8.2 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。

8.3 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的所有股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

8.4 报告期内股票投资组合的重大变动

8.4.1 累计买入金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期末未持有股票。

8.4.2 累计卖出金额超出期初基金资产净值2%或前20名的股票明细

本基金本报告期末有卖出股票。

8.4.3 买入股票的成本总额及卖出股票的收入总额

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

本基金报告期末未有买入股票

8.5 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	59,586,000.00	5.99
	其中：政策性金融债	59,586,000.00	5.99
4	企业债券	1,590,914,980.00	160.01
5	企业短期融资券	69,761,000.00	7.02
6	中期票据	48,170,000.00	4.84
7	可转债	17,149,831.00	1.72
8	其他	—	—
9	合计	1,785,581,811.00	179.59

8.6 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	占基金资产净值比例(%)
1	122126	11庞大02	1,200,000	121,032,000.00	12.17
2	122766	11宜建投	1,000,000	108,200,000.00	10.88
3	122776	11新光债	1,000,000	99,800,000.00	10.04
4	112048	11凯迪债	860,020	84,797,972.00	8.53
5	122110	11众和债	802,160	78,611,680.00	7.91

8.7 期末按公允价值占基金资产净值比例大小排名的所有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。

8.8 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贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

8.9 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。

8.10 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

8.10.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

8.11 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

8.11.1 报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

8.12 投资组合报告附注

8.12.1 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。

8.12.2 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。

8.12.3 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	16,923.58
2	应收证券清算款	—
3	应收股利	—
4	应收利息	38,328,020.16
5	应收申购款	—
6	其他应收款	—
7	待摊费用	—
8	其他	—
9	合计	38,344,943.74

8.12.4 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

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

序号	债券代码	债券名称	公允价值	占基金资产净值比例(%)
1	110020	南山转债	14,854,190.00	1.49
2	113003	重工转债	2,295,641.00	0.23

8.12.5 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。

8.12.6 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。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

§9 基金份额持有人信息

9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构

份额单位：份

份额级别	持有人户数(户)	户均持有的基金份额	持有人结构			
			机构投资者		个人投资者	
			持有份额	占总份额比例	持有份额	占总份额比例
丰利A	9,878	35,058.85	2,747,854.68	0.79%	343,563,422.37	99.21%
丰利B	1,080	447,818.09	392,521,842.00	81.16%	91,121,696.49	18.84%
合计	10,958	75,739.63	395,269,696.68	47.63%	434,685,118.86	52.37%

注：机构/个人投资者持有基金份额占总份额比例的计算中，针对 A、B 类分级基金，比例的分母采用 A、B 类各自级别的份额；对合计数，比例的分母采用 A、B 类分级基金份额的合计数（即期末基金份额总额）。

9.2 期末上市基金前十名持有人

序号	持有人名称	持有份额（份）	占上市总份额比例
1	中国对外经济贸易信托有限公司－汇鑫1号（三宝2期）结构化	31,473,905.00	8.25%
2	天弘基金管理有限公司	30,831,600.00	8.08%
3	北京鸿运通泰投资发展有限公司	29,397,000.00	7.71%
4	全国社保基金二零二组合	21,189,041.00	5.55%
5	全国社保基金二零三组合	18,651,635.00	4.89%
6	中国大唐集团财务有限公司	15,638,300.00	4.10%
7	嘉实基金公司－农行－中国农业银行企业年金理事会	11,066,767.00	2.90%
8	东证资管－招行－东方红	10,650,500.00	2.79%

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

	－新睿5号集合资产管理计划		
9	全国社保基金二零七组合	10,446,545.00	2.74%
10	中行淮北矿业（集团）有限责任公司企业年金计划南方组合	10,000,450.00	2.62%

9.3 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况

项目	份额级别	持有份额总数（份）	占基金总份额比例
基金管理人所有从业人员持有本基金	丰利A	－	－
	丰利B	5,003.15	0.00%
	合计	5,003.15	0.00%

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

§10 开放式基金份额变动

单位：份

基金合同生效日(2011年11月23日)基金份额总额	丰利A	丰利B
	1,184,263,775.19	483,643,538.49
本报告期期初基金份额总额	694,690,401.01	483,643,538.49
本报告期期间基金总申购份额	663,972,002.99	—
减：本报告期期间基金总赎回份额	1,046,684,141.62	—
本报告期期间基金拆分变动份额	34,333,014.67	—
本报告期期末基金份额总额	346,311,277.05	483,643,538.49

注：1、本基金合同生效日为 2011 年 11 月 23 日。
2、丰利 B 在《基金合同》生效后封闭运作封闭期为 3 年，封闭期内不接受申购与赎回

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

§11 重大事件揭示

11.1 基金份额持有人大会决议

本报告期内本基金未召开基金份额持有人大会决议。

11.2 基金管理人、基金托管人的专门基金托管部门的重大人事变动

本报告期内，经天弘基金管理有限公司第三届董事会2013年第3次会议审议通过以下事项：任命宁辰先生、陈钢先生、周晓明先生和张磊先生为本公司副总经理，以上事宜已经依照相关规定履行备案程序。

本报告期内，基金托管人中国邮政储蓄银行托管业务部总经理变更为胡涛先生，并已完成监管报备程序。

11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼

本报告期内没有发生涉及本基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

11.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略没有发生改变。

11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

报告期内应向普华永道中天会计师事务所（特殊普通合伙）支付服务费9万元整。截至本报告期末，普华永道中天会计师事务所有限公司已为天弘丰利分级债券型证券投资基金提供审计服务2年零2个月。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受监管部门稽查或处罚的情况

本报告期内本基金管理人、托管人及其高级管理人员没有发生受稽查或处罚的情况。

11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况

金额单位：人民币元

券商名称	交易单元数量	股票交易		债券交易		债券回购交易		权证交易		应支付该券商的佣金		备注
		成交金额	占股票成交总额比例	成交金额	占债券成交总额比例	成交金额	占债券回购成交总额	成交金额	占权证成交总额比例	佣金	占当期佣金总量的比	

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

							比例				例	
华融证券	1	—	—	606,459,239.67	51.08%	9,476,100,000.00	14.17%	—	—	—	—	
中信证券	1	—	—	370,094,394.00	31.17%	4,660,339,000.00	6.97%	—	—	—	—	
民生证券	1	—	—	106,096,295.51	8.94%	52,180,900,000.00	78.04%	—	—	—	—	
西藏同信证券	1	—	—	104,672,117.80	8.82%	549,974,000.00	0.82%	—	—	—	—	

注：1、基金专用交易单元的选择标准为：该证券经营机构财务状况良好，各项财务指标显示公司经营状况稳定。经营行为规范，内控制度健全，最近两年未因重大违规行为受到监管机关的处罚；研究实力较强，能及时、全面、定期向基金管理人提供高质量的咨询服务，包括宏观经济报告、市场分析报告、行业研究报告、个股分析报告及全面的信息服务。

2、基金专用交易单元的选择程序：本基金管理人根据上述标准进行考察后，确定选用交易席位的证券经营机构。然后基金管理人和被选用的证券经营机构签订交易席位租用协议。

3、报告期内新租用的证券公司交易单元情况：

序号	证券公司名称	所属市场	数量
1	民生证券	上海	1
2	中信证券	深圳	1

4、本基金报告期内停止租用交易单元：

序号	证券公司名称	所属市场	数量
1	西藏同信证券	深圳	1

11.8 其他重大事件

序号	公告事项	信息披露方式	披露日期
1	天弘基金管理有限公司关于成立北京天地方中资产管理有限公司的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站www.thfund.com.cn	2013-01-07
2	天弘丰利分级债券型证券投资基金招募说明书（更新）	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站www.thfund.com.cn	2013-01-07
3	天弘丰利分级债券型证券投资基金招募说明书（更新）摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站www.thfund.com.cn	2013-01-07
4	天弘丰利分级债券型证券投资基金2012年年度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站www.thfund.com.cn	2013-03-29
5	天弘丰利分级债券型证券投资基	中国证券报、上海证券报、	2013-03-29

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

	金2012年年度报告摘要	证券时报及公司网站 www.thfund.com.cn	
6	天弘基金管理有限公司关于旗下基金继续参加中国工商银行股份有限公司网上交易申购费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站 www.thfund.com.cn	2013-03-29
7	天弘基金管理有限公司关于在上海天天基金销售有限公司开通旗下基金基金转换业务并实施费率优惠活动的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站 www.thfund.com.cn	2013-03-29
8	天弘基金管理有限公司关于增加北京展恒基金销售有限公司为旗下基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站 www.thfund.com.cn	2013-04-18
9	天弘丰利分级债券型证券投资基金2013年第1季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站 www.thfund.com.cn	2013-04-19
10	天弘基金管理有限公司关于副总经理变更公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站 www.thfund.com.cn	2013-05-08
11	天弘基金管理有限公司关于增加和讯信息科技有限公司为旗下基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站 www.thfund.com.cn	2013-05-20
12	天弘基金管理有限公司关于天弘丰利分级债券型证券投资基金之丰利A份额开放申购与赎回业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站 www.thfund.com.cn	2013-05-20
13	天弘丰利分级债券型证券投资基金之丰利A份额折算方案的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站 www.thfund.com.cn	2013-05-20
14	天弘丰利分级债券型证券投资基金之丰利B份额（150046）交易风险提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站 www.thfund.com.cn	2013-05-20
15	天弘丰利分级债券型证券投资基金之丰利B份额（150046）暂停	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站	2013-05-22

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

	交易公告	www.thfund.com.cn	
16	天弘丰利分级债券型证券投资基金之丰利A基金份额折算和申购与赎回结果的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站 www.thfund.com.cn	2013-05-24
17	天弘基金管理有限公司旗下基金2013年6月30日基金资产净值公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站 www.thfund.com.cn	2013-06-30
18	天弘丰利分级债券型证券投资基金招募说明书（更新）	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站 www.thfund.com.cn	2013-07-05
19	天弘丰利分级债券型证券投资基金招募说明书（更新）摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站 www.thfund.com.cn	2013-07-05
20	天弘丰利分级债券型证券投资基金2013年第2季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站 www.thfund.com.cn	2013-07-17
21	天弘基金管理有限公司关于增加兴业证券股份有限公司为旗下基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站 www.thfund.com.cn	2013-08-05
22	天弘基金管理有限公司关于旗下基金基金经理变更公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站 www.thfund.com.cn	2013-08-08
23	天弘基金管理有限公司关于增加杭州银行股份有限公司为旗下部分基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站 www.thfund.com.cn	2013-08-22
24	天弘丰利分级债券型证券投资基金2013年半年度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站 www.thfund.com.cn	2013-08-27
25	天弘丰利分级债券型证券投资基金2013年半年度报告摘要	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站 www.thfund.com.cn	2013-08-27
26	天弘基金管理有限公司关于增加威海市商业银行股份有限公司为旗下基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站 www.thfund.com.cn	2013-08-27

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

27	天弘基金管理有限公司关于增加宁波银行股份有限公司为旗下基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站www.thfund.com.cn	2013-08-28
28	天弘基金管理有限公司关于增加北京银行股份有限公司为旗下基金代销机构的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站www.thfund.com.cn	2013-08-28
29	天弘丰利分级债券型证券投资基金2013年第3季度报告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站www.thfund.com.cn	2013-10-25
30	天弘丰利分级债券型证券投资基金之丰利A份额折算方案的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站www.thfund.com.cn	2013-11-20
31	天弘丰利分级债券型证券投资基金之丰利B份额（150046）交易风险提示公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站www.thfund.com.cn	2013-11-20
32	天弘基金管理有限公司关于天弘丰利分级债券型证券投资基金之丰利A份额开放申购与赎回业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站www.thfund.com.cn	2013-11-20
33	天弘丰利分级债券型证券投资基金之丰利B份额（150046）暂停交易公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站www.thfund.com.cn	2013-11-22
34	天弘丰利分级债券型证券投资基金之丰利A基金份额折算和申购与赎回结果的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站www.thfund.com.cn	2013-11-26
35	天弘基金管理有限公司关于增加嘉实财富管理有限公司为旗下基金代销机构及开通基金转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站www.thfund.com.cn	2013-12-05
36	天弘基金管理有限公司旗下基金2013年12月31日基金资产净值公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站www.thfund.com.cn	2013-12-31

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

§12 影响投资者决策的其他重要信息

根据本基金管理人2013年1月7日发布的公告，经中国证监会证监许可[2012]1709号文核准，本基金管理人设立全资子公司北京天地方中资产管理有限公司，业务范围为特定客户资产管理业务以及中国证监会许可的其他业务。

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站

§13 备查文件目录

13.1 备查文件目录

1、中国证监会批准设立天弘丰利分级债券型证券投资基金的文件

2、天弘丰利分级债券型证券投资基金基金合同

3、天弘丰利分级债券型证券投资基金托管协议

4、中国证监会批准设立天弘基金管理有限公司的文件

5、天弘丰利分级债券型证券投资基金财务报表及报表附注

6、报告期内在指定报刊上披露的各项公告

13.2 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

13.3 查阅方式

投资者可到基金管理人的住所及网站或基金托管人的住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

二〇一四年三月二十七日

cninf 巨潮资讯 www.cninfo.com.cn 中国证监会指定信息披露网站