

天弘季加利理财债券型证券投资基金2015年半年度报告

2015年6月30日

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

送出日期：2015年8月25日

§ 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。本半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。

基金托管人中国农业银行股份有限公司根据本基金合同规定，于2015年8月23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。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自2015年1月1日起至2015年6月30日止。

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.....	6
§3 主要财务指标和基金净值表现.....	7
3.1 主要会计数据和财务指标.....	7
3.2 基金净值表现.....	7
§4 管理人报告.....	9
4.1 基金管理人及基金经理情况.....	9
4.2 管理人对报告期内本基金运作遵规守信情况的说明.....	11
4.3 管理人对报告期内公平交易情况的专项说明.....	11
4.4 管理人对报告期内基金的投资策略和业绩表现的说明.....	12
4.5 管理人对宏观经济、证券市场及行业走势的简要展望.....	13
4.6 管理人对报告期内基金估值程序等事项的说明.....	13
4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明.....	14
4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明.....	14
§5 托管人报告.....	14
5.1 报告期内本基金托管人遵规守信情况声明.....	14
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.....	14
5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见.....	14
§6 半年度财务会计报告（未经审计）.....	14
6.1 资产负债表.....	14
6.2 利润表.....	16
6.3 所有者权益（基金净值）变动表.....	17
6.4 报表附注.....	19
§7 投资组合报告.....	37
7.1 期末基金资产组合情况.....	37
7.2 债券回购融资情况.....	37
7.3 基金投资组合平均剩余期限.....	38
7.4 期末按债券品种分类的债券投资组合.....	39
7.5 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.....	39
7.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离.....	39
7.7 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.....	40
7.8 投资组合报告附注.....	40
§8 基金份额持有人信息.....	41
8.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构.....	41
8.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况.....	41
8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况.....	41
§9 开放式基金份额变动.....	42
§10 重大事件揭示.....	42
10.1 基金份额持有人大会决议.....	42
10.2 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.....	42
10.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼.....	43
10.4 基金投资策略的改变.....	43
10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况.....	43

10.6	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	43
10.7	本期基金租用证券公司交易单元的有关情况	43
10.8	偏离度绝对值超过 0.5% 的情况	43
10.9	其他重大事件	44
§11	影响投资者决策的其他重要信息	46
§12	备查文件目录	47
12.1	备查文件目录	47
12.2	存放地点	47
12.3	查阅方式	47

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	天弘季加利理财债券型证券投资基金	
基金简称	天弘季加利理财	
基金主代码	000670	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2014年6月18日	
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	
报告期末基金份额总额	一份	
基金合同存续期	不定期	
下属两级基金的基金简称	天弘季加利理财A	天弘季加利理财B
下属两级基金的交易代码	000670	000671
报告期末下属两级基金的份 额总额	一份	一份

2.2 基金产品说明

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。
投资策略	<p>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。</p> <p>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。</p>
业绩比较基准	3个月银行定期存款利率(税后)

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。
--------	---

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	中国农业银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	童建林	林葛
	联系电话	022-83310208	010-66060069
	电子邮箱	service@thfund.com.cn	tgxxpl@abchina.com
客户服务电话		4007109999	95599
传真		022-83865569	010-68121816
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	北京东城区建国门内大街69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	北京复兴门内大街28号凯晨世贸中心东座9层
邮政编码		300203	100031
法定代表人		井贤栋	刘士余

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
登载基金半年度报告正文的管理人互联网网址	www.thfund.com.cn
基金半年度报告备置地点	基金管理人及基金托管人的办公地址

2.5 其他相关资料

项目	名称	办公地址
----	----	------

注册登记机构	天弘基金管理有限公司	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
--------	------------	-----------------------------

§ 3 主要财务指标和基金净值表现

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	报告期（2015年1月1日-2015年6月30日）	
	天弘季加利理财A	天弘季加利理财B
本期已实现收益	365,176.04	216,402.19
本期利润	365,176.04	216,402.19
本期净值收益率	0.8129%	0.8695%
3.1.2 期末数据和指标	报告期末(2015年6月30日)	
期末基金资产净值	1,053.48	—
期末基金份额净值	—	—
3.1.3 累计期末指标	报告期末(2015年6月30日)	
累计净值收益率	3.0485%	3.2408%

注：1、本基金无持有人认购或交易基金的各项费用。

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，由于短期理财债券基金采用摊余成本法核算，因此，公允价值变动收益为零，本期已实现收益和本期利润的金额相等。

3、本基金的收益分配是按月结转份额。

4、本基金合同自2014年6月18日起生效。

5、截至本报告期末，本基金已暂停运作。

3.2 基金净值表现

3.2.1 基金份额净值收益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基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段(A级)	份额净值收益率①	份额净值收益率标准差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

过去一个月	0.0000 %	0.0000 %	0.0000 %	0.0000 %	0.0000 %	0.0000 %
过去三个月	0.0000 %	0.0000 %	0.0000 %	0.0000 %	0.0000 %	0.0000 %
过去六个月	0.8129 %	0.0121 %	0.5368 %	0.0003 %	0.2761 %	0.0118 %
过去一年	2.8979 %	0.0179 %	1.8379 %	0.0005 %	1.0600 %	0.0174 %
自基金合同生效日起 至今（2014年06月18 日-2015年06月30日）	3.0485 %	0.0176 %	1.9318 %	0.0005 %	1.1167 %	0.0171 %

(2) 天弘季加利理财B基金份额净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

阶段(B级)	份额净 值收益 率①	份额净 值收益 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
过去一个月	0.0000 %	0.0000 %	0.0000 %	0.0000 %	0.0000 %	0.0000 %
过去三个月	0.0000 %	0.0000 %	0.0000 %	0.0000 %	0.0000 %	0.0000 %
过去六个月	0.8695 %	0.0121 %	0.5368 %	0.0003 %	0.3327 %	0.0118 %
过去一年	3.0818 %	0.0179 %	1.8379 %	0.0005 %	1.2439 %	0.0174 %
自基金合同生效日起 至今（2014年06月18 日-2015年06月30日）	3.2408 %	0.0176 %	1.9318 %	0.0005 %	1.3090 %	0.0171 %

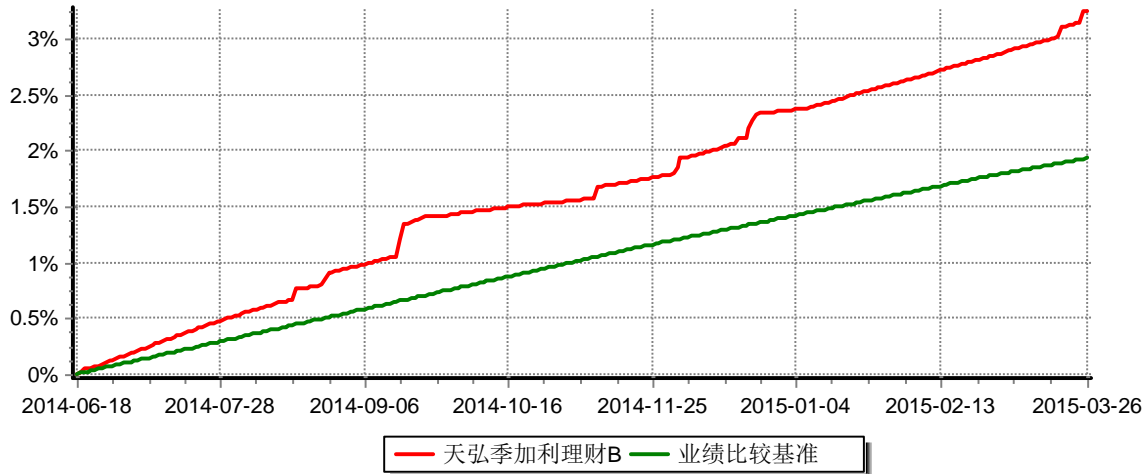
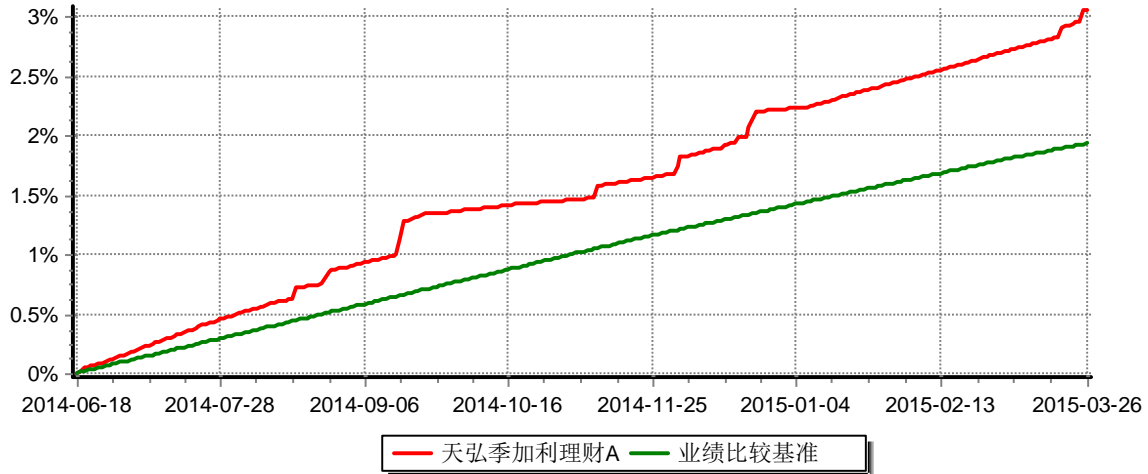
注：天弘季加利理财债券型证券投资基金业绩比较基准：3个月银行定期存款利率（税后），即中国人民银行公布并执行的3月期金融机构人民币存款基准利率（税后）。

3.2.2 自基金合同生效以来基金份额累计净值收益率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

天弘季加利理财债券型证券投资基金

份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率历史走势对比图

(2014年6月18日-2015年6月30日)



注：1、本基金合同于2014年6月18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、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。

§ 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“本基金管理人”）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5.143亿元人民币，总部设在天津，在北京、上海、广州、天津设有分公司。公司股权结构为：

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%

截至2015年6月30日，本基金管理人共管理33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、天弘通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、天弘云商宝货币市场基金、天弘中证大宗商品股票指数型发起式证券投资基金、天弘中证医药100指数型发起式证券投资基金、天弘中证全指房地产指数型发起式证券投资基金、天弘中证全指运输指数型发起式证券投资基金、天弘中证移动互联网指数型发起式证券投资基金、天弘中证证券保险指数型发起式证券投资基金。

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		
王登峰	本基金	2014年6月	—	6	男，经济学硕士。历任中

	基金经 理;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 弘增益 宝货币 市场基 金基金 经理;天 弘云商 宝货币 市场基 金基金 经理。				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。
--	--	--	--	--	--

注：注：1、上述任职日期为基金合同生效日。

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合规守信情况的说明

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的说明

4.4.1 报告期内基金投资策略和运作分析

2015年上半年经济基本面继续处于弱势状态，物价水平处于通缩边缘，宏观政策进入放松周期，人民银行多次下调存贷款基准利率，降低存款准备金率，除了货币政策外房地产政策也出现了放松。资金面方面，1季度在外汇流出压力加大、IPO集中冲击的影响下，资金利率相对偏高，3月中下旬开始，资金利率在央行积极的公开市场操作引导下重新出现下行，整个2季度资金面处于极度宽松的状态，3个月SHIBOR利率从1季度的4.8%附近下降至2季度3.2%附近，7天回购利率中枢更降到3%以下。在资金面宽松的带动下，2季度短端利率出现了明显下行，但是长端利率受制于地方债供给压力的冲击，

同时叠加股市走强对于资金分流的影响，因此呈现区间波动的行情，期限利差急剧扩大。

本基金在报告期内暂停操作。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

本基金第三期运作期为2015年1月7日至2015年3月26日。截至2015年3月26日，本基金A级份额本报告期净值收益率为0.8129%，B级份额净值收益率为0.8695%，同期业绩比较基准收益率为0.5368%。

截至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。

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2015年下半年，在宽松政策的刺激下，经济基本面将呈现弱平稳，由于美国经济增长势头较好，年内美联储启动加息的概率较高，在国内经济弱势下，外汇流出的压力加大，需要国内货币政策继续维持宽松，资金利率将维持在较低水平，债券市场方面由于边际上利好减弱，利率品种又面临持续的供给压力，长端利率品种大概率保持区间震荡的态势，由于股市财富效应减弱、IPO暂停，股市衍生的类固收产品资金回流将对信用债的需求有一定支撑，边际上利好信用债的走势。

投资策略上，本基金暂停操作。

4.6 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。

4.7 管理人对报告期内基金利润分配情况的说明

根据本基金合同及招募说明书（更新）等有关规定，本基金根据每日基金收益情况，以每万份基金净收益为基准，为投资者每日计算当日收益并分配，每月集中支付至持有人的基金账户。

4.8 报告期内管理人对本基金持有人数或基金资产净值预警情形的说明

本报告期内本基金管理人无应说明预警信息。

§ 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

在托管本基金的过程中，本基金托管人中国农业银行股份有限公司严格遵守《证券投资基金法》相关法律法规的规定以及基金合同、托管协议的约定，对本基金基金管理人-天弘基金管理有限公司2015年1月1日至2015年6月30日基金的投资运作，进行了认真、独立的会计核算和必要的投资监督，认真履行了托管人的义务，没有从事任何损害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

本托管人认为，天弘基金管理有限公司在本基金的投资运作、基金资产净值的计算、基金份额申购赎回价格的计算、基金费用开支及利润分配等问题上，不存在损害基金份额持有人利益的行为；在报告期内，严格遵守了《证券投资基金法》等有关法律法规，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

5.3 托管人对本半年度报告中财务信息等内容的真实、准确和完整发表意见

本托管人认为，天弘基金管理有限公司的信息披露事务符合《证券投资基金信息披露管理办法》及其他相关法律法规的规定，基金管理人所编制和披露的本基金年度报告中的财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等信息真实、准确、完整，未发现有损害基金持有人利益的行为。

§ 6 半年度财务会计报告（未经审计）

6.1 资产负债表

会计主体：天弘季加利理财债券型证券投资基金

报告截止日：2015年6月30日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
资产：			
银行存款	6.4.7.1	134,861.19	60,032,881.45
结算备付金			52,500.00
存出保证金		—	14,766.95
交易性金融资产	6.4.7.2	—	—
其中：股票投资		—	—
基金投资		—	—
债券投资		—	—
资产支持证券投资		—	—
贵金属投资		—	—
衍生金融资产	6.4.7.3	—	—
买入返售金融资产	6.4.7.4	—	30,000,165.00
应收证券清算款		—	—
应收利息	6.4.7.5	26.94	15,141.69
应收股利		—	—
应收申购款		—	46,000.00
递延所得税资产		—	—
其他资产	6.4.7.6	—	—
资产总计		134,888.13	90,161,455.09
负债和所有者权益	附注号	本期末 2015年6月30日	上年度末 2014年12月31日
负债：			
短期借款		—	—
交易性金融负债		—	—
衍生金融负债	6.4.7.3	—	—
卖出回购金融资产款		—	—
应付证券清算款		—	—
应付赎回款		—	—

应付管理人报酬		—	32,768.07
应付托管费		—	9,709.12
应付销售服务费		—	26,266.03
应付交易费用	6.4.7.7	—	8,875.10
应交税费		—	—
应付利息		—	—
应付利润		—	288,202.44
递延所得税负债		—	—
其他负债	6.4.7.8	133,834.65	149,000.00
负债合计		133,834.65	514,820.76
所有者权益：			
实收基金	6.4.7.9	—	89,646,634.33
未分配利润	6.4.7.10	—	—
所有者权益合计		1,053.48	89,646,634.33
负债和所有者权益总计		134,888.13	90,161,455.09

注：根据暂停运作公告，赎回申请已被自动发起，基金份额持有人的相应全部赎回款从托管账户划出。基金份额净值0.00元，基金份额总额0.00份。下同。

6.2 利润表

会计主体：天弘季加利理财债券型证券投资基金

本报告期：2015年1月1日-2015年6月30日

单位：人民币元

项目	附注号	本期2015年1月1日 -2015年6月30日	上年度可比期间2014 年6月18日合同生效日 -2014年06月30日
一、收入		760,974.52	1,198,721.73
1.利息收入		654,274.52	1,198,721.73
其中：存款利息收入	6.4.7.11	627,860.45	529,075.73
债券利息收入		2,500.48	90,542.39
资产支持证券利息收入		—	—
买入返售金融资产收		23,913.59	579,103.61

入			
其他利息收入		—	—
2.投资收益(损失以“-”填列)		106,700.00	—
其中: 股票投资收益		—	—
基金投资收益		—	—
债券投资收益	6.4.7.12	106,700.00	—
资产支持证券投资收 益	6.4.7.12. 3	—	—
贵金属投资收益	6.4.7.13	—	—
衍生工具收益	6.4.7.14	—	—
股利收益		—	—
3.公允价值变动收益(损失以 “-”号填列)	6.4.7.15	—	—
4.汇兑收益(损失以“-”号 填列)		—	—
5.其他收入(损失以“-”号填 列)	6.4.7.16	—	—
减: 二、费用		179,396.29	148,501.74
1. 管理人报酬		43,900.04	63,181.68
2. 托管费		13,154.05	18,720.48
3. 销售服务费		27,629.02	51,794.28
4. 交易费用	6.4.7.17	—	—
5. 利息支出		—	282.40
其中: 卖出回购金融资产支出		—	282.40
6. 其他费用	6.4.7.18	94,713.18	14,522.90
三、利润总额(亏损总额以“-” 号填列)		581,578.23	1,050,219.99
减: 所得税费用		—	—
四、净利润(净亏损以“-” 号填列)		581,578.23	1,050,219.99

6.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：天弘季加利理财债券型证券投资基金

本报告期：2015年1月1日-2015年6月30日

单位：人民币元

项 目	本期 2015年1月1日-2015年6月30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)	89,646,634.33	—	89,646,634.33
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	581,578.23	581,578.23
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)	-89,646,634.33	—	-89,646,634.33
其中：1.基金申购款	20,839,548.73	—	20,839,548.73
2.基金赎回款	-110,486,183.06	—	-110,486,183.06
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)	—	-580,524.75	-580,524.75
五、期末所有者权益(基金净值)	—	1,053.48	1,053.48
项 目	上年度可比期间 2014年6月18日合同生效日-2014年06月30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)	711,768,460.58	—	711,768,460.58
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	—	1,050,219.99	1,050,219.99
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)	—	—	—
其中：1.基金申购款	—	—	—

2.基金赎回款	—	—	—
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）	—	-1,050,219.99	-1,050,219.99
五、期末所有者权益（基金净值）	711,768,460.58	—	711,768,460.58

报表附注为财务报表的组成部分。

本报告6.1至6.4财务报表由下列负责人签署：

郭树强

韩海潮

薄贺龙

基金管理人负责人

主管会计工作负责人

会计机构负责人

6.4 报表附注

6.4.1 基金基本情况

天弘季加利理财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[2014]514号《关于核准天弘季加利理财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《天弘季加利理财债券型证券投资基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型开放式，存续期限不定，首次募集期间为2014年6月3日至2014年6月16日，首次设立募集不包括认购资金利息共募集711,715,541.85元，业经普华永道中天会计师事务所(特殊普通合伙)普华永道中天验字(2014)第315号验资报告予以验证。经向中国证监会备案，《天弘季加利理财债券型证券投资基金基金合同》于2014年6月18日正式生效，基金合同生效日的基金份额总额为711,768,460.58份基金份额，其中认购资金利息折合52,918.73份基金份额。本基金的基金管理人为天弘基金管理有限公司，基金托管人为中国农业银行股份有限公司。

根据《天弘季加利理财债券型证券投资基金招募说明书》的规定，本基金根据销售服务费收取方式的不同，将基金份额分为不同的类别。按照0.25%年费计提销售服务费的基金份额类别称为A类基金份额；按照0.01%年费计提销售服务费的基金份额类别称为B类基金份额。由于基金费用的不同，本基金A类基金份额和B类基金份额将分别计算基金份额净值并分别公告，计算公式为计算日各类别基金资产净值除以计算日发售在外的该类别基金份额总数。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘季加利理财债券型证券投资基金基金合同》的有关规定，本基金的投资范围为法律法规及监管机构允许投资的金融工具，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，但须符合中国证监会相关规定。本基金的业绩比较基准为3个月银行定期存款利率(税后)。

6.4.2 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日及以后期间颁布的《企业会计准则—基本准则》、各项具体会计准则及相关规定(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》、《天弘季加利理财债券型证券投资基金基金合同》和在财务报表附注6.4.4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。

6.4.3 遵循企业会计准则及其他有关规定的声明

本基金2015年上半年度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截止2015年6月30日的财务状况以及2015年上半年度的经营成果和基金净值变动情况等有关信息。

本财务报表以本基金持续经营为基础列报。

6.4.4 重要会计政策和会计估计

本基金本报告期会计报表所采用的会计政策与最近一期年度会计报表所采用的会计政策一致，但会计估计（附注6.4.4.1）发生了变更。

6.4.4.1 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：

(1) 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。

(2) 对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，按照中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的债券估值结果确定公允价值。

6.4.5 会计政策和会计估计变更以及差错更正的说明

6.4.5.1 会计政策变更的说明

本基金本报告期未发生会计政策变更。

6.4.5.2 会计估计变更的说明

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外), 鉴于其交易量和交易频率不足以提供持续的定价信息, 本基金本报告期改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值。

6.4.5.3 差错更正的说明

本基金在本报告期间无须说明的会计差错更正。

6.4.6 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。基金买卖债券的差价收入不予征收营业税。

(2) 对基金从证券市场中取得的收入, 包括买卖股票、债券的差价收入, 股权的股息、红利收入, 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。自2013年1月1日起, 对基金从上市公司取得的股息红利所得, 持股期限在1个月以内(含1个月)的, 其股息红利所得全额计入应纳税所得额; 持股期限在1个月以上至1年(含1年)的, 暂减按50%计入应纳税所得额; 持股期限超过1年的, 暂减按25%计入应纳税所得额。对基金持有的上市公司限售股, 解禁后取得的股息、红利收入, 按照上述规定计算纳税, 持股时间自解禁日起计算; 解禁前取得的股息、红利收入继续暂减按50%计入应纳税所得额。上述所得统一适用20%的税率计征个人所得税。

(4) 基金卖出股票按0.1%的税率缴纳股票交易印花税, 买入股票不征收股票交易印花税。

6.4.7 重要财务报表项目的说明

6.4.7.1 银行存款

单位: 人民币元

项目	本期末
----	-----

	2015年6月30日
活期存款	134,861.19
合计	134,861.19

6.4.7.2 交易性金融资产

本基金本报告期末未持有交易性金融资产。

6.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本报告期末未持有衍生金融资产/负债。

6.4.7.4 买入返售金融资产

6.4.7.4.1 各项买入返售金融资产期末余额

本基金本期末未持有买入返售金融资产。

6.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本报告期末未持有买断式逆回购交易中取得的债券。

6.4.7.5 应收利息

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应收活期存款利息	26.94
应收其他存款利息	—
应收结算备付金利息	—
应收债券利息	—
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	—
合计	26.94

6.4.7.6 其他资产

本基金本报告期末未持有其他资产。

6.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
交易所市场应付交易费用	—
银行间市场应付交易费用	—
合计	—

本基金本报告期末未持有应付交易费用。

6.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2015年6月30日
应付券商交易单元保证金	—
应付赎回费	—
预提费用	133,834.65
合计	133,834.65

6.4.7.9 实收基金

6.4.7.9.1 天弘季加利理财A

金额单位：人民币元

项目(A级)	本期2015年1月1日-2015年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	74,491,769.40	74,491,769.40
本期申购	607,735.13	607,735.13
本期赎回(以“-”号填列)	-75,099,504.53	-75,099,504.53
本期末	—	—

6.4.7.9.2 天弘季加利理财B

金额单位：人民币元

项目(B级)	本期2015年1月1日-2015年6月30日	
	基金份额(份)	账面金额
上年度末	15,154,864.93	15,154,864.93
本期申购	20,231,813.60	20,231,813.60
本期赎回(以“-”号填列)	-35,386,678.53	-35,386,678.53

本期末	—	—
-----	---	---

注：根据基金合同约定，基于对下一运作期的投资市场环境的判断，基金管理人决定本基金第三期运作期到期后暂停下一运作期运作、不接受申购。本基金管理人在运作期赎回日（2015年3月26日）自动为各类基金份额持有人发起全部赎回申请。

6.4.7.10 未分配利润

6.4.7.10.1 天弘季加利理财A

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	—	—	—
本期利润	365,176.04	—	365,176.04
本期基金份额交易产生的变动数	—	—	—
其中：基金申购款	—	—	—
基金赎回款	—	—	—
本期已分配利润	-364,122.56	—	-364,122.56
本期末	1,053.48	—	1,053.48

6.4.7.10.2 天弘季加利理财B

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	—	—	—
本期利润	216,402.19	—	216,402.19
本期基金份额交易产生的变动数	—	—	—
其中：基金申购款	—	—	—
基金赎回款	—	—	—
本期已分配利润	-216,402.19	—	-216,402.19
本期末	—	—	—

6.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2015年1月1日-2015年6月30日
----	------------------------

活期存款利息收入	8,830.82
定期存款利息收入	618,586.08
其他存款利息收入	—
结算备付金利息收入	14.20
其他	429.35
合计	627,860.45

6.4.7.12 股票投资收益

本基金本报告期内未取得股票投资收益。

6.4.7.13 债券投资收益

6.4.7.13.1 债券投资收益项目构成

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日-2015年6月30日
债券投资收益——买卖债券 (、债转股及债券到期兑付) 差价收入	106,700.00
债券投资收益——赎回差价 收入	—
债券投资收益——申购差价 收入	—
合计	106,700.00

6.4.7.13.2 债券投资收益——买卖债券差价收入

单位：人民币元

项目	本期 2015年1月1日-2015年6月30日
卖出债券(、债转股及债券到 期兑付)成交总额	10,533,500.00
减：卖出债券(、债转股及债 券到期兑付)成本总额	10,000,000.00
减：应收利息总额	426,800.00

买卖债券差价收入	106,700.00
----------	------------

6.4.7.13.3 资产支持证券投资收益

本基金本报告期内未取得资产支持证券投资收益。

6.4.7.14 贵金属投资收益

本基金本报告期内未取得贵金属投资收益。

6.4.7.15 衍生工具收益

本基金本报告期内未取得衍生工具收益。

6.4.7.16 股利收益

本基金本报告期内未取得股利收益。

6.4.7.17 公允价值变动收益

单位：人民币元

项目名称	本期2015年1月1日-2015年6月30日
1.交易性金融资产	—
——股票投资	—
——债券投资	—
——资产支持证券投资	—
——贵金属投资	—
——其他	—
2.衍生工具	—
——权证投资	—
3.其他	—
合计	—

注：本基金本报告期未取得公允价值变动收益。

6.4.7.18 其他收入

单位：人民币元

项目	本期2015年1月1日-2015年6月30日
基金赎回费收入	—

合计	—
----	---

注：本基金本报告期未取得其他收入。

6.4.7.19 交易费用

单位：人民币元

项目	本期2015年1月1日-2015年6月30日
交易所市场交易费用	—
银行间市场交易费用	—
合计	—

本基金本报告期未发生交易费用。

6.4.7.20 其他费用

单位：人民币元

项目	本期2015年1月1日-2015年6月30日
审计费用	13,972.30
信息披露费	69,862.35
其他费用	200.00
帐户维护费	7,590.00
汇划手续费	3,088.53
合计	94,713.18

6.4.8 或有事项、资产负债表日后事项的说明

6.4.8.1 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。

6.4.8.2 资产负债表日后事项

截至财务报表报出日，本基金无须作披露的资产负债表日后事项。

6.4.9 关联方关系

6.4.9.1 本报告期存在控制关系或其他重大利害关系的关联方发生变化的情况

根据本基金的基金管理人于2015年2月26日披露的关于增资扩股工商变更登记的相关公告，基金管理人变更前股东名单为：

关联方名称	与本基金的关系
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集团股份有限公司	基金管理人的股东
芜湖高新投资有限公司	基金管理人的股东

变更后股东名单为：

关联方名称	与本基金的关系
浙江蚂蚁小微金融服务集团有限公司	基金管理人的股东
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集团股份有限公司	基金管理人的股东
芜湖高新投资有限公司	基金管理人的股东
新疆天瑞博丰股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
新疆天惠新盟股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
新疆天阜恒基股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东
新疆天聚宸兴股权投资合伙企业（有限合伙）	基金管理人的股东

6.4.9.2 本报告期与基金发生关联交易的各关联方

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、注册登记机构
中国农业银行股份有限公司（“农业银行”）	基金托管人、基金代销机构

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。

6.4.10 本报告期及上年度可比期间的关联方交易

6.4.10.1 通过关联方交易单元进行的交易

本基金本报告期内及上年度可比期间未通过关联方交易单元进行交易。

6.4.10.2 关联方报酬

6.4.10.2.1 基金管理费

单位：人民币元

项目	本期2015年1月1日-2015年6月30日	上年度可比期间2014年6月18日合同生效日-2014年06月30日

当期发生的基金应支付的管理费	43,900.04	63,181.68
其中：应支付销售机构的客户维护费	18,109.97	31,749.85

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0.27%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 0.27% / 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。

6.4.10.2.2 基金托管费

单位：人民币元

项目	本期2015年1月1日-2015年6月30日	上年度可比期间2014年6月18日合同生效日-2014年06月30日
当期发生的基金应支付的托管费	13,154.05	18,720.48

注：支付基金托管人中国农业银行的托管费按前一日基金资产净值0.08%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 0.08% / 当年天数。

6.4.10.2.3 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 2015年1月1日-2015年6月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	天弘季加利理财A	天弘季加利理财B	合计
中国农业银行	25,954.98	133.13	26,088.11
天弘基金管理有限公司	31.99	428.62	460.61
合计	25,986.97	561.75	26,548.72
获得销售服务费的各关联方名称	上年度可比期间2014年6月18日合同生效日-2014年06月30日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		

	天弘季加利理财A	天弘季加利理财B	合计
中国农业银行	50,682.17	279.48	50,961.65
天弘基金管理有限公司	—	—	—
合计	50,682.17	279.48	50,961.65

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的约定年费率计提，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。A类基金份额和B类基金份额约定的销售服务费年费率分别为0.25%和0.01%。销售服务费的计算公式为：日销售服务费=前一日基金资产净值 X约定年费率 / 当年天数。

6.4.10.3 与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易

本基金本报告期末与关联方进行银行间同业市场的债券(含回购)交易。

6.4.10.4 各关联方投资本基金的情况

6.4.10.4.1 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	本期2015年1月1日-2015年6月30日		上年度可比期间2014年6月18日合同生效日-2014年06月30日	
	天弘季加利理财A	天弘季加利理财B	天弘季加利理财A	天弘季加利理财B
期初持有的基金份额	—	—	—	—
期间申购/买入总份额	20,170,489.27	—	—	—
期间因拆分变动份额	—	—	—	—
减：期间赎回/卖出总份额	-20,170,489.27	—	—	—
期末持有的基金份额	—	—	—	—
期末持有的基金份额占基金总份额比例	—	—	—	—

6.4.10.4.2 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

本基金本报告期末无除基金管理人之外的其他关联方投资本基金的情况。

6.4.10.5 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2015年1月1日-2015年6月30日		上年度可比期间2014年6月18日合同生效日-2014年06月30日	
	期末余额	当期存款利息收入	期末余额	当期存款利息收入
中国农业银行活期存款	134,861.19	8,830.82	635,601.02	28,509.00

注：本基金的银行存款由基金托管人中国农业银行保管，按银行同业利率计息。

6.4.10.6 本基金在承销期内参与关联方承销证券的情况

本基金本报告期内及上年度可比期间内未在承销期内参与关联方承销证券。

6.4.10.7 其他关联交易事项的说明

本基金本报告期内及上年度可比期间内无其他关联交易事项。

6.4.11 利润分配情况

单位：人民币元

已按再投资形式转实收基金(A级)	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	本期利润分配合计	备注
263,669.18	100,453.38	—	364,122.56	
已按再投资形式转实收基金(B级)	直接通过应付赎回款转出金额	应付利润本年变动	本期利润分配合计	备注
181,777.11	34,625.08	—	216,402.19	

注：本基金在本年度累计分配收益580,524.75元，其中以红利再投资方式结转入实收基金445,446.29元，包含于赎回款的已分配未支付收益135,078.46元，计入应付收益科目0元。

6.4.12 期末（2015年6月30日）本基金持有的流通受限证券

6.4.12.1 因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券

截至本报告期末(2015年6月30日)，本基金无因认购新发/增发证券而流通受限的证券。

6.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末(2015年6月30日)，本基金未持有暂时停牌等流通受限的股票。

6.4.12.3 期末债券正回购交易中作为抵押的债券

6.4.12.3.1 银行间市场债券正回购

截至本报告期末2015年12月31日，本基金未持有银行间市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末2015年12月31日，本基金未持有交易所市场债券正回购交易中作为抵押的债券。

6.4.13 金融工具风险及管理

6.4.13.1 风险管理政策和组织架构

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。本基金的投资范围为固定收益类金融工具，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在保持基金资产的低风险和良好流动性的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报。

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。公司经理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。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。

6.4.13.2 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农业银行，因而与银行存款相关的信用风险不重大。本基金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；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。

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。

于2015年6月30日，本基金未持有债券。

6.4.13.3 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于开放期内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的证券不得超过该证券的10%。本基金所持大部分证券在证券交易所上市，其余亦可在银行间同业市场交易，因此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2015年6月30日，本基金所持有的全部金融负债的合同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，因此账面余额即为未折现的合约到期现金流量。

6.4.13.4 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。

6.4.13.4.1 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。

本基金部分投资于交易所和银行间同业市场交易的固定收益品种，因此存在相应的利率风险。本基金的基金管理人每日通过“影子定价”对本基金面临的市场风险进行监控，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。

6.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末2015年6月30日	6个月以内	6个月-1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	134,861.19	—	—	—	—	134,861.19
应收利息	—	—	—	—	26.94	26.94
资产总计	134,861.19	—	—	—	26.94	134,888.13
负债						
其他负债	—	—	—	—	133,834.65	133,834.65
负债总计	—	—	—	—	133,834.65	133,834.65

利率敏感度 缺口	134,861.1 9	—	—	—	-133,807. 71	1,053.48
上年度末 2014年12月 31日	6个月以 内	6个月 -1年	1-5年	5年以上	不计息	合计
资产						
银行存款	60,032,88 1.45	—	—	—	—	60,032,88 1.45
结算备付金	52,500.00	—	—	—	—	52,500.00
存出保证金	14,766.95	—	—	—	—	14,766.95
买入返售金 融资产	30,000,16 5.00	—	—	—	—	30,000,16 5.00
应收利息	—	—	—	—	15,141.69	15,141.69
应收申购款	20,000.00	—	—	—	26,000.00	46,000.00
资产总计	90,120,31 3.40	—	—	—	41,141.69	90,161,45 5.09
负债						
应付管理人 报酬	—	—	—	—	32,768.07	32,768.07
应付托管费	—	—	—	—	9,709.12	9,709.12
应付销售服 务费	—	—	—	—	26,266.03	26,266.03
应付交易费 用	—	—	—	—	8,875.10	8,875.10
应付利润	—	—	—	—	288,202.4 4	288,202.4 4
其他负债	—	—	—	—	149,000.0 0	149,000.0 0
负债总计	—	—	—	—	514,820.7 6	514,820.7 6
利率敏感度 缺口	90,120,31 3.40	—	—	—	-473,679. 07	89,646,63 4.33

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。

6.4.13.4.1.2 利率风险的敏感性分析

于2015年6月30日，本基金未持有交易性债券投资，因此市场利率的变动对于本基金资产净值无重大影响。

6.4.13.4.2 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。

6.4.13.4.3 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。本基金主要投资于银行定期存款、协议存款及大额存单、债券回购和短期债券等固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

6.4.14 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) 金融工具公允价值计量的方法

公允价值计量结果所属的层次，由对公允价值计量整体而言具有重要意义的输入值所属的最低层次决定：

第一层次：相同资产或负债在活跃市场上未经调整的报价。

第二层次：除第一层次输入值外相关资产或负债直接或间接可观察的输入值。

第三层次：相关资产或负债的不可观察输入值。

(b) 持续的以公允价值计量的金融工具

(i) 各层次金融工具公允价值

于2015年12月31日，本基金未持有持续的以公允价值计量的金融资产。(于2014年12月31日，本基金未持有持续的以公允价值计量的金融资产。)

于2014年12月31日，本基金未持有持续的以公允价值计量的金融资产。

(ii) 公允价值所属层次间的重大变动

对于在证券交易所上市或挂牌转让的固定收益品种(可转换债券、资产支持证券和私募债券除外)，本基金于2015年3月26日起改为采用中证指数有限公司根据《中国证券投资基金业协会估值核算工作小组关于2015年1季度固定收益品种的估值处理标准》所独立提供的估值结果确定公允价值（附注6.4.5.2），并将相关债券的公允价值从第一层次调整至第二层次。

(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。

§ 7 投资组合报告

7.1 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	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	134,861.19	99.98
4	其他各项资产	26.94	0.02
5	合计	134,888.13	100.00

7.2 债券回购融资情况

金额单位：人民币元

序号	项目	占基金资产净值的比例 (%)	
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

			值的比例 (%)
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。

7.3 基金投资组合平均剩余期限

7.3.1 投资组合平均剩余期限基本情况

项目	天数
报告期末投资组合平均剩余期限	0
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	0
报告期内投资组合平均剩余期限最低值	0

注：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

注：不适用。

7.3.2 期末投资组合平均剩余期限分布比例

序号	平均剩余期限	各期限资产占基金资产净值的比例 (%)	各期限负债占基金资产净值的比例 (%)
1	30天以内	—	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
2	30天(含)—60天	—	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
3	60天(含)—90天	—	—
	其中：剩余存续期超过397天	—	—

	的浮动利率债		
4	90天(含)—180天	—	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
5	180天(含)—397天(含)	—	—
	其中：剩余存续期超过397天的浮动利率债	—	—
	合计	—	—

注：不适用。

7.4 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	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	—	—
2	央行票据	—	—
3	金融债券	—	—
	其中：政策性金融债	—	—
4	企业债券	—	—
5	企业短期融资券	—	—
6	中期票据	—	—
7	其他	—	—
8	合计	—	—
9	剩余存续期超过397天的浮动利率债券	—	—

本报告期末，本基金已暂停运作。

7.5 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。

7.6 “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	

报告期内偏离度的最高值	—
报告期内偏离度的最低值	—
报告期内每个工作日偏离度的绝对值的简单平均值	—

本报告期末，本基金已暂停运作。

7.7 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。

7.8 投资组合报告附注

7.8.1 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。

7.8.2 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。

7.8.3 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。

7.8.4 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	26.94
4	应收申购款	—
5	其他应收款	—
6	待摊费用	—
7	其他	—
8	合计	26.94

7.8.5 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。

§ 8 基金份额持有人信息

8.1 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
天弘季加利理财A	—	—	—	—	—	—
天弘季加利理财B	—	—	—	—	—	—
合计	—	—	—	—	—	—

根据暂停运作公告，赎回申请已被自动发起，基金份额持有人的相应全部赎回款从托管账户划出。本基金份额为零，无基金持有人。下同

8.2 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
基金管理公司所有从业人员持有本基金	天弘季加利理财A	—	—
	天弘季加利理财B	—	—
	合计	—	—

8.3 期末基金管理人的从业人员持有本开放式基金份额总量区间情况

项目	份额级别	持有基金份额总量的数量区间(万份)
本公司高级管理人员、基金投	天弘季加利	

资和研究部门负责人持有本 开放式基金	理财A	
	天弘季加利 理财B	
	合计	
本基金基金经理持有本开放 式基金	天弘季加利 理财A	
	天弘季加利 理财B	
	合计	

§ 9 开放式基金份额变动

单位：份

	天弘季加利理财A	天弘季加利理财B
基金合同生效日(2014年6月18日)基 金份额总额	626,763,420.58	85,005,040.00
本报告期期初基金份额总额	74,491,769.40	15,154,864.93
本报告期基金总申购份额	607,735.13	20,231,813.60
减：本报告期基金总赎回份额	75,099,504.53	35,386,678.53
本报告期期末基金份额总额	—	—

注：根据基金合同约定，基于对下一运作期的投资市场环境的判断，基金管理人决定本基金第三期运作期到期后暂停下一运作期运作、不接受申购。本基金管理人在运作期赎回日（2015年3月26日）自动为各类基金份额持有人发起全部赎回申请。

§ 10 重大事件揭示

10.1 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。

10.2 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

天弘基金管理有限公司(以下简称"本公司")股东会选举井贤栋先生、卢信群先生、袁雷鸣先生、屠剑威先生、付岩先生、郭树强先生、魏新顺先生、张军先生和贺强先生担任新一届董事会董事，其中井贤栋先生、袁雷鸣先生、屠剑威先生、张军先生和贺强先生为新任董事；本公司董事会选举井贤栋先生为新一届董事会董事长（本公司法定代

表人)。

以上重大人事变动事宜已经依照相关规定履行备案程序。

本报告期内，本基金的基金托管人的专门基金托管部门未发生重大人事变动。

10.3 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基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼。

10.4 基金投资策略的改变

本报告期内本基金投资策略没有改变。

10.5 为基金进行审计的会计师事务所情况

本报告期内本基金所聘用的会计师事务所未发生变化。

10.6 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。

10.7 本期基金租用证券公司交易单元的有关情况

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	中信建投证券	上海	1
2	中信建投证券	深圳	1
3	中金公司	上海	1
4	中金公司	深圳	1

4、本基金报告期内停止租用交易单元：无。

10.8 偏离度绝对值超过0.5%的情况

本基金本报告期内未出现偏离度绝对值超过0.5%的情况。

10.9 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公告	上海证券报及公司网站 www.thfund.com.cn	2015-01-06
2	天弘基金管理有限公司关于增加江苏吴江农村商业银行股份有限公司为旗下基金代销机构并开通定投及转换...	中国证券报、上海证券报、 证券时报及公司网站 www.thfund.com.cn	2015-01-15
3	天弘基金管理有限公司关于增加大同证券经纪有限责任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	2015-01-19
4	天弘季加利理财债券型证券投资基金2014年第4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	2015-01-20
5	天弘基金管理有限公司关于增加东莞农村商业银行股份有限公司为旗下基金代销机构并开通定投及转换业务...	中国证券报、上海证券报、 证券时报及公司网站 www.thfund.com.cn	2015-01-29
6	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	中国证券报、上海证券报、 证券时报及公司网站 www.thfund.com.cn	2015-01-30
7	天弘季加利理财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	2015-01-30
8	天弘基金管理有限公司关于增加哈尔滨银行股份有限公司为旗下基金代销机构并开通定投及转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报及公司网站 www.thfund.com.cn	2015-02-09
9	天弘基金管理有限公司公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报及公司网站 www.thfund.com.cn	2015-02-26
10	天弘基金管理有限公司公告	中国证券报、上海证券报、	2015-02-27

		证券时报及公司网站 www.thfund.com.cn	
11	天弘基金管理有限公司公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报及公司网站 www.thfund.com.cn	2015-03-06
12	天弘季加利理财债券型证券投资 基金关于第三期运作期到期后暂 停下一运作期运作、不接受申购 等安排的公...	中国证券报、上海证券报、 证券时报及公司网站 www.thfund.com.cn	2015-03-24
13	天弘季加利理财债券型证券投资 基金2014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	2015-03-26
14	天弘季加利理财债券型证券投资 基金2014年年度报告摘要	中国证券报、上海证券报、 证券时报及公司网站 www.thfund.com.cn	2015-03-26
15	天弘基金管理有限公司关于旗下 基金调整交易所固定收益品种估 值方法的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报及公司网站 www.thfund.com.cn	2015-03-27
16	天弘季加利理财债券型证券投资 基金2015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	2015-04-22
17	天弘基金管理有限公司关于高级 管理人员变更的公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报及公司网站 www.thfund.com.cn	2015-05-15
18	天弘基金管理有限公司公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报及公司网站 www.thfund.com.cn	2015-05-19
19	天弘基金管理有限公司公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报及公司网站 www.thfund.com.cn	2015-05-20
20	天弘基金管理有限公司公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报及公司网站 www.thfund.com.cn	2015-05-30
21	天弘基金管理有限公司关于旗下	中国证券报、上海证券报、	2015-06-16

	基金所持“暴风科技”估值方法调整的提示性公告	证券时报及公司网站 www.thfund.com.cn	
22	天弘基金管理有限公司关于旗下基金所持“皇氏集团”、“天瑞仪器”估值方法调整的提示性公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报及公司网站 www.thfund.com.cn	2015-06-20
23	天弘基金管理有限公司关于旗下基金所持“东土科技”、“华测检测”、“天神娱乐”估值方法调整的...	中国证券报、上海证券报、 证券时报及公司网站 www.thfund.com.cn	2015-06-26
24	天弘基金管理有限公司关于旗下基金所持“新时达”、“仁和药业”估值方法调整的提示性公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报及公司网站 www.thfund.com.cn	2015-06-27
25	天弘基金管理有限公司旗下基金2015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	2015-06-30
26	天弘基金管理有限公司关于旗下基金所持“长荣股份”、“中国天楹”估值方法调整的提示性公告	中国证券报、上海证券报、 证券时报及公司网站 www.thfund.com.cn	2015-06-30

§ 11 影响投资者决策的其他重要信息

根据天弘基金管理有限公司(以下简称“本公司”)于2015年2月26日发布的公告,本公司的注册资本由人民币1.8亿元增加为人民币5.143亿元,其调整后的股东及持股比例如下:

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%

§ 12 备查文件目录

12.1 备查文件目录

- 1、中国证监会批准设立天弘季加利理财债券型证券投资基金的文件
- 2、天弘季加利理财债券型证券投资基金基金合同
- 3、天弘季加利理财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、天弘季加利理财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

12.2 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

12.3 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

二〇一五年八月二十五日