

天弘现金管家货币市场基金

2012 年年度报告

2012 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

报告送出日期：二〇一三年三月二十九日

§ 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 2012 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 2012 年 6 月 20 日起至 2012 年 12 月 31 日止。

1.2 目录

§ 1 重要提示及目录	1
1.1 重要提示	1
1.2 目录	2
§ 2 基金简介	4
2.1 基金基本情况	4
2.2 基金产品说明	4
2.3 基金管理人和基金托管人	4
2.4 信息披露方式	5
2.5 其他相关资料	5
§ 3 主要财务指标、基金净值表现及利润分配情况	6
3.1 主要会计数据和财务指标	6
3.2 基金净值表现	6
3.3 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合规守信情况的说明	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	13
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	15
§ 5 托管人报告	16
5.1 报告期内本基金托管人合规守信情况声明	16
5.2 托管人对报告期内本基金投资运作合规守信、净值计算、利润分配等情况的说明	16
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	16
§ 6 审计报告	17
§ 7 年度财务报表	18
7.1 资产负债表	18
7.2 利润表	19
7.3 所有者权益(基金净值)变动表	20
7.4 报表附注	21
§ 8 投资组合报告	35
8.1 期末基金资产组合情况	35
8.2 债券回购融资情况	35
8.3 基金投资组合平均剩余期限	35
8.4 期末按债券品种分类的债券投资组合	36
8.5 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	37
8.6 “影子定价”与“摊余成本法”确定的基金资产净值的偏离	37

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	37
8.8 投资组合报告附注	37
§ 9 基金份额持有人信息	39
9.1 期末基金份额持有人户数及持有人结构	39
9.2 期末基金管理人的从业人员持有本基金的情况	39
§ 10 开放式基金份额变动	40
§ 11 重大事件揭示	41
11.1 基金份额持有人大会决议	41
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	41
11.3 涉及基金管理人、基金财产、基金托管业务的诉讼	41
11.4 基金投资策略的改变	41
11.5 为基金进行审计的会计师事务所情况	41
11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况	41
11.7 基金租用证券公司交易单元的有关情况	42
11.8 偏离度绝对值超过 0.5%的情况	42
11.9 其他重大事件	42
§ 12 影响投资者决策的其它重要信息	45
§ 13 备查文件目录	46
13.1 备查文件目录	46
13.2 存放地点	46
13.3 查阅方式	46

§ 2 基金简介

2.1 基金基本情况

基金名称	天弘现金管家货币市场基金	
基金简称	天弘现金管家货币	
基金主代码	420006	
基金运作方式	契约型开放式	
基金合同生效日	2012 年 6 月 20 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	715,877,155.22 份	
基金合同存续期	不定期	
下属分级基金的基金简称	天弘现金管家货币 A	天弘现金管家货币 B
下属分级基金的交易代码	420006	420106
报告期末下属分级基金的份额总额	340,333,423.67 份	375,543,731.55 份

2.2 基金产品说明

投资目标	在保持基金资产的低风险和高流动性的前提下，力争实现超越业绩比较基准的投资回报
投资策略	本基金根据对短期利率变动的预测，采用投资组合平均剩余期限控制下的主动性投资策略，利用定性分析和定量分析方法，通过对短期金融工具的积极投资，在控制风险和保证流动性的基础上，力争获得稳定的当期收益。
业绩比较基准	同期七天通知存款利率（税后）
风险收益特征	本基金为货币市场基金，属于证券投资基金中的低风险品种，其预期收益和风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。

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	中国邮政储蓄银行股份有限公司
信息披露负责人	姓名	童建林	宗庆丰

	联系电话	022-83310208	010-68858112
	电子邮箱	service@thfund.com.cn	zongqingfeng@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

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	中国上海市湖滨路 202 号普华永道中心 11 楼
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
分公司	天弘基金管理有限公司北京分公司	北京市西城区月坛北街 2 号月坛大厦 A 座 20 层
	天弘基金管理有限公司上海分公司	上海市浦东新区陆家嘴环路 166 号未来资产大厦 8 楼 B 单元
	天弘基金管理有限公司广州分公司	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

§ 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

3.1.1 天弘现金管家货币 A 类

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2012 年 6 月 20 日（基金合同生效日）至 2012 年 12 月 31 日
本期已实现收益	3,998,389.99
本期利润	3,998,389.99
本期净值收益率	1.6653%
3.1.2 期末数据和指标	2012 年末
期末基金资产净值	340,333,423.67
期末基金份额净值	1.0000
3.1.3 累计期末指标	2012 年末
累计净值收益率	1.6653%

3.1.2 天弘现金管家货币 B 类

金额单位：人民币元

3.1.1 期间数据和指标	2012 年 6 月 20 日（基金合同生效日）至 2012 年 12 月 31 日
本期已实现收益	7,953,932.54
本期利润	7,953,932.54
本期净值收益率	1.7951%
3.1.2 期末数据和指标	2012 年末
期末基金资产净值	375,543,731.55
期末基金份额净值	1.0000
3.1.3 累计期末指标	2012 年末
累计净值收益率	1.7951%

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。由于货币市场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、本基金的利润分配是按日结转份额。

4、本基金合同自 2012 年 6 月 20 日起生效，报告期为 2012 年 6 月 20 日至 2012 年 12 月 31 日。

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

3.2.1.1 天弘现金管家货币 A 类

阶段	份额净值	业绩比较	业绩比较基准	①—③	②—④
----	------	------	--------	-----	-----

	收益率①	收益率标准差②	基准收益率③	收益率标准差④		
过去三个月	0.8396%	0.0071%	0.3456%	0.0000%	0.4940%	0.0071%
过去六个月	1.5726%	0.0077%	0.6929%	0.0000%	0.8797%	0.0077%
自基金合同生效起至今	1.6653%	0.0075%	0.7357%	0.0000%	0.9296%	0.0075%

3.2.1.2 天弘现金管家货币 B 类

阶段	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
过去三个月	0.8999%	0.0071%	0.3456%	0.0000%	0.5543%	0.0071%
过去六个月	1.6956%	0.0077%	0.6929%	0.0000%	1.0027%	0.0077%
自基金合同生效起至今	1.7951%	0.0075%	0.7357%	0.0000%	1.0594%	0.0075%

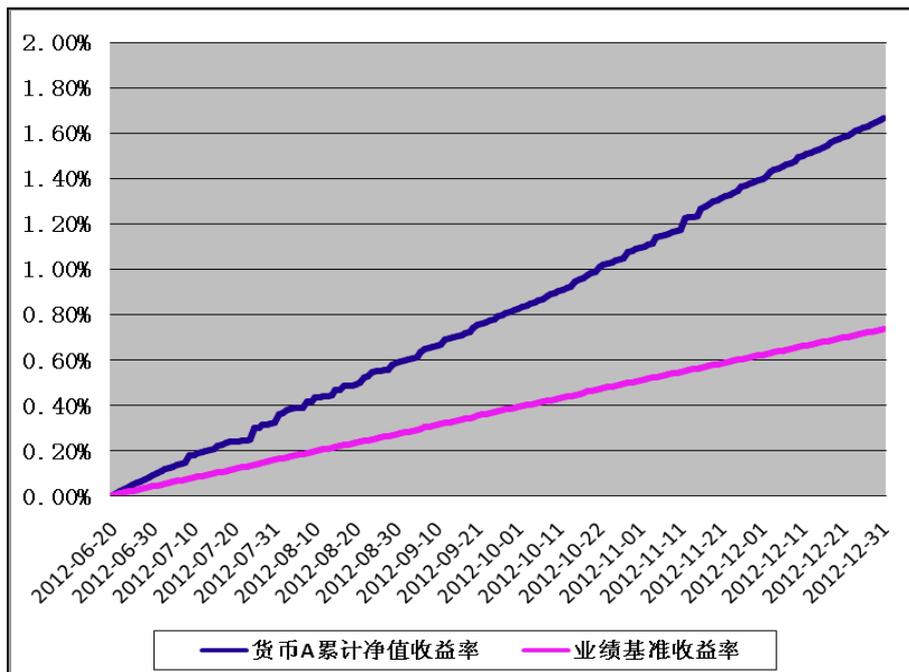
注：天弘现金管家货币市场基金业绩比较基准：同期七天通知存款利率（税后）。通知存款是一种不约定存期，支取时需提前通知银行，约定支取日期和金额方能支取的存款，具有存期灵活、存取方便的特征，同时可获得高于活期存款利息的收益。本基金为货币市场基金，具有低风险、高流动性的特征。根据基金的投资标的、投资目标及流动性特征，本基金选取同期七天通知存款利率（税后）作为本基金的业绩比较基准。

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

3.2.2.1

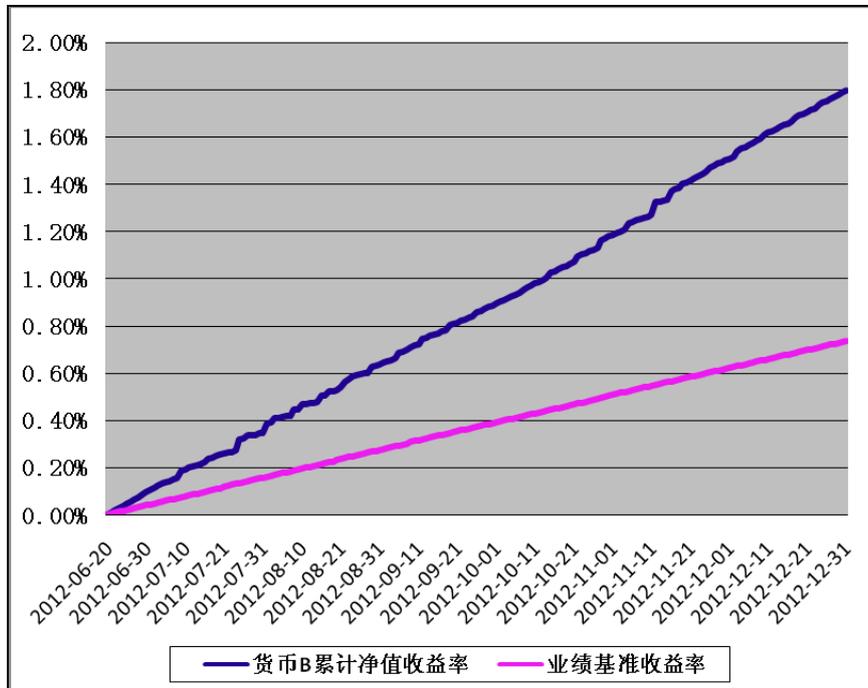
天弘现金管家货币 A 类基金

份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2012 年 6 月 20 日至 2012 年 12 月 31 日)



3.2.2.2

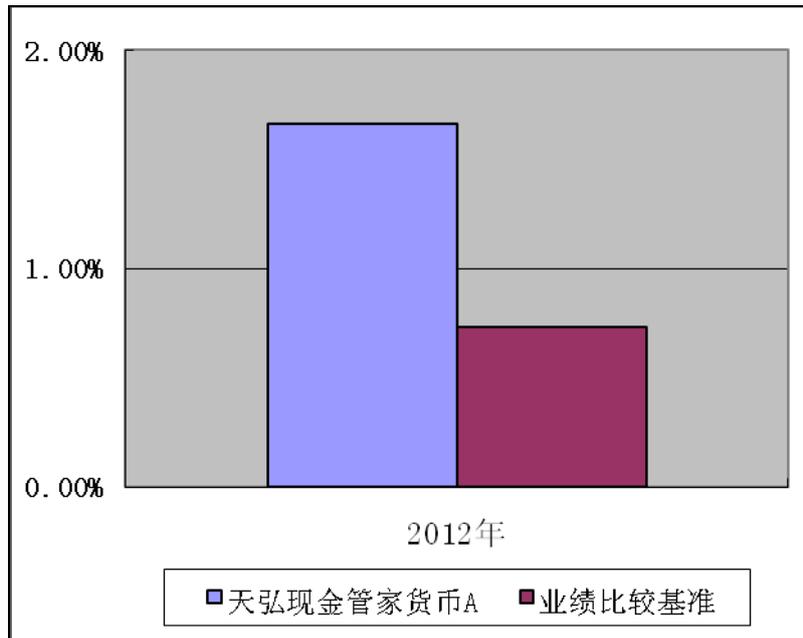
天弘现金管家货币 B 类基金
份额累计净值收益率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图
(2012 年 6 月 20 日至 2012 年 12 月 31 日)



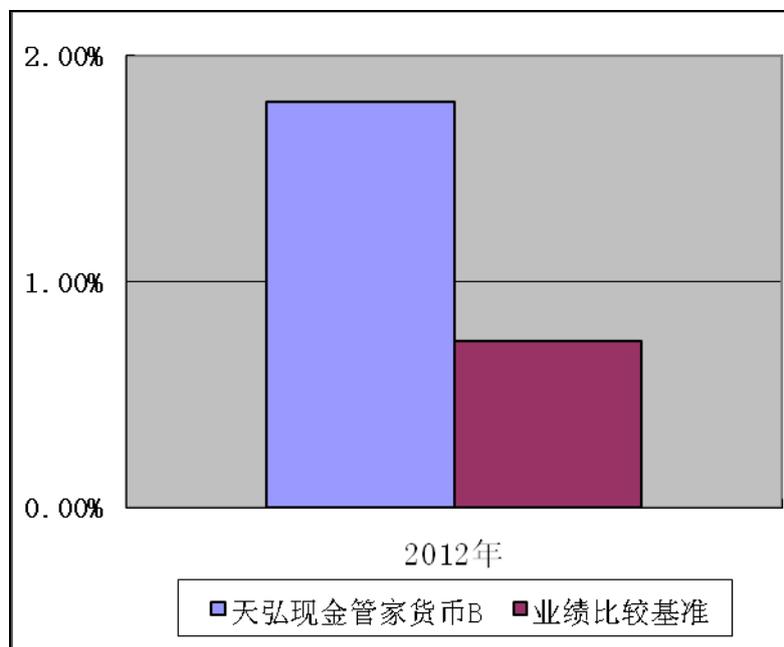
- 注：1、本基金合同于 2012 年 6 月 20 日生效，本基金合同生效日起至披露时点不满 1 年。
2、按照本基金合同的约定，基金管理人应当自基金合同生效之日起 3 个月内使基金的投资组合比例符合基金合同的有关约定。本基金的建仓期为 2012 年 6 月 20 日—2012 年 9 月 19 日，建仓期结束时，各项资产配置比例均符合基金合同的约定。
3、本报告期内，本基金的各项投资比例达到基金合同约定的各项比例要求。

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

3.2.3.1 天弘现金管家货币 A 类自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



3.2.3.2 天弘现金管家货币 B 类自基金合同生效以来基金每年净值收益率及其与同期业绩比较基准收益率的比较



注：基金合同生效当年 2012 年的净值收益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 过去三年基金的利润分配情况

天弘现金管家货币 A 类

单位：人民币元

年度	已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付赎 回款转出金额	应付利润 本年变动	年度利润 分配合计	备注
2012 年	3,998,389.99	-	-	3,998,389.99	无
合计	3,998,389.99	-	-	3,998,389.99	无

天弘现金管家货币 B 类

单位：人民币元

年度	已按再投资形式 转实收基金	直接通过应付赎 回款转出金额	应付利润 本年变动	年度利润 分配合计	备注
2012 年	7,953,932.54	-	-	7,953,932.54	无
合计	7,953,932.54	-	-	7,953,932.54	无

§ 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2012年12月31日，本基金管理人共管理十只基金：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。

4.1.2 基金经理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		
刘冬	本基金基金经理；天弘丰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；天弘永利债券型证券投资基金基金经理助理；本公司股票投资部总经理助理。	2012年6月	—	6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。
王登峰	本基金基金经理。	2012年8月	—	3年	男，硕士研究生。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。

注：1、上述任职日期分别为基金合同生效日、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，通过交易系统内的公平交易程序，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。

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；针对非公开发行业股票申购、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

整体来看，2012 年经济基本面处于下行通道，物价始终处于较低水平。在利率市场化的大背景下，货币政策调控方式逐渐由数量型转变为价格型。作用到货币市场，上半年伴随着降准等传统数量调控工具的使用，资金面整体宽松，资金成本相对较低，短期债券品种的收益率也持续下降。3 季度利率市场化实质推进，降准预期多次落空，资金面由松转紧。伴随着短期利率中枢不断上移，短期债券品种的收益率也逐步走高。4 季度由于央行持续逆回购，财政存款投放以及外汇占款改善，资金面紧张局面有所缓解。然而，受商业银行资本金考核等因素影响，短融收益率不降反升，并维持在高位运行。

本基金成立于 2012 年 6 月，成立之初我们判断短融收益率即将见底，实行短久期策略，配置剩余期限较短的短融，并且适度增加存款的配置比例，一定程度上规避了下半年的短融收益率上行风险。四季度后，伴随着短融收益率上行，我们判断其配置价值凸显，逐步从一级市场上增加了新发短融的配置。并且在年末资金利率高企时，适度增加了长期存款的配置比例。

4 季度末为应对基金的赎回对于利率品进行了适度减持。

4.4.2 报告期内基金的业绩表现

截至 2012 年 12 月 31 日，A 级基金份额净值收益率 1.6653%，B 级基金份额净值收益率 1.7951%，同期业绩比较基准收益率 0.7357%。

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 2013 年，我们判断经济整体走强，基建投资为主要动力。物价整体上行，下半年有一定的压力，但仍然可控，中枢维持在 3%附近。政策上，财政政策积极、货币政策中性。资金面将维持平稳局面，但在关键时间点上，仍可能出现结构性失衡。外汇占款的变化，或对央行公开市场操作带来一定冲击。

本基金将继续秉承“稳健理财”的投资理念，在确保流动性和安全性不受影响的前提下，通

通过对宏观经济及资金面的前瞻分析，灵活调整仓位配置，适度提高其收益性。

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。

公司经理层面成立了基金运作风险管理委员会，根据公司总体风险控制目标，将交易、运营风险控制目标和要求分配到各部门，定期召开风险管理会议，听取各部门风险管理工作方面的汇报，确定未来一段时间各部门应重点关注的风险点，调整与改进相关的风险处理和策略，并向公司经理层提交基金运作风险报告。

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，预防和控制在内部或外部流程、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、不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、两年以上基金行业相关工作经验、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

根据本基金合同及招募说明书（更新）等有关规定，本基金每日将基金净收益分配给基金份额持有人（该收益参与下一日的收益分配），并按自然月结转至基金份额持有人的基金账户。

§ 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、利润分配情况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基金份额持有人利益的行为。

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。

§6 审计报告

普华永道中天审字(2013)第 20177 号

天弘现金管家货币市场基金全体基金份额持有人：

我们审计了后附的天弘现金管家货币市场基金(以下简称“天弘货币基金”)的财务报表，包括 2012 年 12 月 31 日的资产负债表、2012 年 6 月 20 日(基金合同生效日)至 2012 年 12 月 31 日止期间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。

一、管理层对财务报表的责任

编制和公允列报财务报表是天弘货币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。

二、注册会计师的责任

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。

三、审计意见

我们认为，上述天弘货币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，公允反映了天弘货币基金 2012 年 12 月 31 日的财务状况以及 2012 年 6 月 20 日(基金合同生效日)至 2012 年 12 月 31 日止期间的经营成果和基金净值变动情况。

普华永道中天
会计师事务所有限公司

注册会计师

单 峰

中国·上海市

注册会计师

张 晓 艺

2013 年 3 月 25 日

§7 年度财务报表

7.1 资产负债表

会计主体：天弘现金管家货币市场基金

报告截止日：2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

资产	附注号	本期末 2012 年 12 月 31 日
资产：		
银行存款	7.4.7.1	251,944,775.20
结算备付金		-
存出保证金		-
交易性金融资产	7.4.7.2	300,521,611.20
其中：股票投资		-
基金投资		-
债券投资		300,521,611.20
资产支持证券投资		-
衍生金融资产	7.4.7.3	-
买入返售金融资产	7.4.7.4	158,500,597.75
应收证券清算款		-
应收利息	7.4.7.5	5,459,976.17
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		716,426,960.32
负债和所有者权益	附注号	本期末 2012 年 12 月 31 日
负债：		
短期借款		-
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		-
应付证券清算款		-
应付赎回款		-
应付管理人报酬		223,817.22
应付托管费		67,823.37
应付销售服务费		62,149.51

应付交易费用	7.4.7.7	22,015.00
应交税费		-
应付利息		-
应付利润		-
递延所得税负债		-
其他负债	7.4.7.8	174,000.00
负债合计		549,805.10
所有者权益：		
实收基金	7.4.7.9	715,877,155.22
未分配利润	7.4.7.10	-
所有者权益合计		715,877,155.22
负债和所有者权益总计		716,426,960.32

注：1、报告截止日 2012 年 12 月 31 日，天弘现金管家货币基金份额总额为 715,877,155.22；其中天弘现金管家货币 A 类基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 340,333,423.67 份；天弘现金管家货币 B 类基金份额净值 1.0000 元，基金份额总额 375,543,731.55 份。

2、本基金于 2012 年 6 月 20 日生效，本财务报表的实际编制期间为 2012 年 6 月 20 日（基金合同生效日）至 2012 年 12 月 31 日。无上年度可比期间，下同。

7.2 利润表

会计主体：天弘现金管家货币市场基金

本报告期：2012 年 6 月 20 日（基金合同生效日）至 2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	附注号	本期 2012 年 6 月 20 日（基金合同生效日）至 2012 年 12 月 31 日
一、收入		14,387,844.25
1. 利息收入		10,634,909.24
其中：存款利息收入	7.4.7.11	7,255,343.78
债券利息收入		2,104,056.52
资产支持证券利息收入		-
买入返售金融资产收入		1,275,508.94
其他利息收入		-
2. 投资收益（损失以“-”填列）		3,752,935.01
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	3,752,935.01
资产支持证券投资收益		-
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	-
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	-
减：二、费用		2,435,521.72
1. 管理人报酬		1,220,023.61
2. 托管费		369,704.08
3. 销售服务费		347,667.97
4. 交易费用	7.4.7.18	-
5. 利息支出		264,226.06
其中：卖出回购金融资产支出		264,226.06
6. 其他费用	7.4.7.19	233,900.00
三、利润总额(亏损总额以“-”号填列)		11,952,322.53
减：所得税费用		-
四、净利润(净亏损以“-”号填列)		11,952,322.53

7.3 所有者权益(基金净值)变动表

会计主体：天弘现金管家货币市场基金

本报告期：2012 年 6 月 20 日（基金合同生效日）至 2012 年 12 月 31 日

单位：人民币元

项目	本期		
	2012 年 6 月 20 日（基金合同生效日）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)	1,234,437,256.97	-	1,234,437,256.97
二、本期经营活动产生的基金净值变动数(本期利润)	-	11,952,322.53	11,952,322.53
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)	-518,560,101.75	-	-518,560,101.75
其中：1. 基金申购款	1,856,366,389.29	-	1,856,366,389.29
2. 基金赎回款	-2,374,926,491.04	-	-2,374,926,491.04
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)	-	-11,952,322.53	-11,952,322.53
五、期末所有者权益(基金净值)	715,877,155.22	-	715,877,155.22

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	崔 德 广	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

天弘现金管家货币市场基金(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[2012]635号《关于核准天弘现金管家货币市场基金募集的批复》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《天弘现金管家货币市场基金基金合同》负责公开募集。本基金为契约型定期开放式基金,存续期限不定,首次设立募集不包括认购资金利息共募集1,234,347,012.51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(2012)第205号验资报告予以验证。经向中国证监会备案,《天弘现金管家货币市场基金基金合同》于2012年6月20日正式生效,基金合同生效日的基金份额总额为1,234,437,256.97份基金份额,其中认购资金利息折合90,244.46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,基金托管人为中国邮政储蓄银行股份有限公司。

根据《天弘现金管家货币市场基金基金合同》和《天弘现金管家货币市场基金招募说明书》的有关规定,本基金根据投资者认(申)购本基金的金额,对投资者持有的基金份额按照不同的费率计提销售服务费用,因此形成不同的基金份额等级。本基金设A级和B级两级基金份额,两级基金份额分别设置基金代码,并单独公布每万份基金净收益和7日年化收益率。投资者可自行选择认(申)购的基金份额等级,不同基金份额等级之间不得互相转换,但根据《天弘现金管家货币市场基金基金合同》约定因申购、赎回而发生基金份额自动升级或者降级的除外。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》和《天弘现金管家货币市场基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为现金、通知存款、短期融资券、1年以内(含1年)的银行定期存款和大额存单、期限在1年以内(含1年)的债券回购、期限在1年以内(含1年)的中央银行票据、剩余期限在397天以内(含397天)的债券、剩余期限在397天以内(含397天)的资产支持证券、剩余期限在397天以内(含397天)的中期票据及中国证监会认可的其他具有良好流动性的货币市场工具。本基金的业绩比较基准为:七天通知存款利率(税后)。

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2013年3月25日批准报出。

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》、《天弘现金管家货币市场基金基金合同》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 2012 年 6 月 20 日(基金合同生效日)至 2012 年 12 月 31 日止期间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 2012 年 12 月 31 日的财务状况以及 2012 年 6 月 20 日(基金合同生效日)至 2012 年 12 月 31 日止期间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。本期财务报表的实际编制期间为 2012 年 6 月 20 日(基金合同生效日)至 2012 年 12 月 31 日。

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。

本基金以交易目的目前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

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,于交易日按公允价值在资产负债表内确认。对于取得债券投资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。

债券投资采用实际利率法,以摊余成本进行后续计量,即债券投资按票面利率或商定利率每日计提应收利息,按实际利率法在其剩余期限内摊销其买入时的溢价或折价;同时于每一计价日计算影子价格,以避免债券投资的摊余成本与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离。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

为了避免债券投资的摊余成本与公允价值的差异导致基金资产净值发生重大偏离，从而对基金持有人的利益产生稀释或不公平的结果，基金管理人于每一计价日采用债券投资的公允价值计算影子价格。当基金资产净值与影子价格的偏离达到或超过基金资产净值的 0.25% 时，基金管理人应根据风险控制的需要调整组合，使基金资产净值更能公允地反映基金资产价值。

计算影子价格时按如下原则确定债券投资的公允价值：

(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。

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。当本基金依法 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。每份基金份额面值为 1.00 元。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。上述申购和赎回分别包括基金转换所引起的转入基金的实收基金增加和转出基金的实收基金减少，以及因类别调整而引起的 A、B 类基金份额之间的转换所产生的实收基金变动。

7.4.4.8 收入/(损失)的确认和计量

债券投资在持有期间按实际利率计算确定的金额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。

债券投资处置时其公允价值与摊余成本之间的差额确认为投资收益。

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。

7.4.4.9 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则按直线法计算。

7.4.4.10 基金的收益分配政策

每一基金份额享有同等分配权。申购的基金份额不享有确认当日的分红权益，而赎回的基金份额享有确认当日的分红权益。本基金以份额面值 1.00 元固定份额净值交易方式，每日计算当日收益并全部分配结转至应付收益科目，每月以红利再投资方式集中支付累计收益。

7.4.4.11 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) 本基金的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。

7.4.4.12 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，本基金计算影子价格过程中确定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

本基金本报告期末未发生会计政策变更。

7.4.5.2 会计估计变更的说明

本基金本报告期末未发生会计估计变更。

7.4.5.3 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。

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，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 2012 年 12 月 31 日
活期存款	1,944,775.20
定期存款	250,000,000.00
其中：存款期限 1 个月以内	50,000,000.00
存款期限 1-3 个月	200,000,000.00

存款期限 3 个月以上	-
其他存款	-
合计	251,944,775.20

注：定期存款的存款期限指定期存款的票面存期。

7.4.7.2. 交易性金融资产

单位：人民币元

项目		本期末 2012 年 12 月 31 日			
		摊余成本	影子定价	偏离金额	偏离度 (%)
债券	交易所市场	-	-	-	-
	银行间市场	300,521,611.20	301,041,000.00	519,388.80	0.0726%
	合计	300,521,611.20	301,041,000.00	519,388.80	0.0726%

注：偏离金额=影子定价-摊余成本；偏离度=偏离金额/摊余成本法确定的基金资产净值。

7.4.7.3 衍生金融资产/负债

本基金本期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

单位：人民币元

项目	本期末 2012 年 12 月 31 日	
	账面余额	其中：买断式逆回购
银行间市场买入返售金融资产	158,500,597.75	-
合计	158,500,597.75	-

7.4.7.4.2 期末买断式逆回购交易中取得的债券

本基金本期末未持有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 2012 年 12 月 31 日
应收活期存款利息	1,659.51
应收定期存款利息	340,783.92
应收其他存款利息	-
应收结算备付金利息	-
应收债券利息	4,915,977.37
应收买入返售证券利息	201,555.37
应收申购款利息	-
其他	-
合计	5,459,976.17

7.4.7.6 其他资产

本基金本期末未持有其他资产。

7.4.7.7 应付交易费用

单位：人民币元

项目	本期末 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	22,015.00
合计	22,015.00

7.4.7.8 其他负债

单位：人民币元

项目	本期末 2012年12月31日
应付券商交易单元保证金	-
应付赎回费	-
预提审计费	70,000.00
预提信息披露费	95,000.00
预提账户维护费	9,000.00
合计	174,000.00

7.4.7.9. 实收基金

金额单位：人民币元

项目	本期 2012 年 6 月 20 日（基金合同生效日）至 2012 年 12 月 31 日			
	A 类		B 类	
	基金份额(份)	账面金额	基金份额(份)	账面金额
基金合同生效日	576,166,940.77	576,166,940.77	658,270,316.20	658,270,316.20
本期申购	853,113,036.31	853,113,036.31	1,003,253,352.98	1,003,253,352.98
本期赎回(以“-”号填列)	-1,088,946,553.41	-1,088,946,553.41	-1,285,979,937.63	-1,285,979,937.63
本期末	340,333,423.67	340,333,423.67	375,543,731.55	375,543,731.55

注：1、申购含分级调整及转换入的份额及金额；赎回含分级调整及转换出的份额及金额。

2、本基金自 2012 年 6 月 4 日至 2012 年 6 月 15 日止期间公开发售，共募集有效净认购资金 1,234,347,012.51 元。根据《天弘现金管家货币市场基金基金份额发售公告》的规定，本基金设立募集期内认购资金产生的利息收入 90,244.46 元在本基金成立后，折算为 90,244.46 份基金份额，划入基金份额持有人账户。

3、根据《天弘现金管家货币市场基金基金份额发售公告》的相关规定，本基金于 2012 年 6 月 20 日(基金合同生效日)至 2012 年 7 月 9 日止期间暂不向投资人开放基金交易。申购、赎回、转换业务自 2012 年 7 月 10 日起开始办理。

7.4.7.10 未分配利润

天弘现金管家货币 A 类

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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	3,998,389.99	-	3,998,389.99
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	-3,998,389.99	-	-3,998,389.99
本期末	-	-	-

天弘现金管家货币 B 类

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
基金合同生效日	-	-	-
本期利润	7,953,932.54	-	7,953,932.54
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	-7,953,932.54	-	-7,953,932.54
本期末	-	-	-

7.4.7.11 存款利息收入

单位：人民币元

项目	本期2012年6月20日（基金合同生效日）至2012年12月31日
活期存款利息收入	61,694.31
定期存款利息收入	7,177,643.64
其他存款利息收入	-
结算备付金利息收入	830.25
其他	15,175.58
合计	7,255,343.78

7.4.7.12 股票投资收益

本基金在本报告期无股票投资收益。

7.4.7.13 债券投资收益

单位：人民币元

项目	本期2012年6月20日（基金合同生效日）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	1,759,843,641.66
减：卖出债券（债转股及债券到期兑付）成本总额	1,712,107,858.71

减：应收利息总额	43,982,847.94
债券投资收益	3,752,935.01

7.4.7.14 衍生工具收益

本基金在本报告期末未取得衍生工具收益。

7.4.7.15 股利收益

本基金在本报告期无股利收益。

7.4.7.16 公允价值变动收益

本基金本报告期内未取得公允价值变动收益。

7.4.7.17 其他收入

本基金本报告期内未取得其他收入。

7.4.7.18 交易费用

本基金本报告期内无交易费用。

7.4.7.19 其他费用

单位：人民币元

项目	本期2012年6月20日（基金合同生效日）至 2012年12月31日
审计费用	70,000.00
信息披露费	145,000.00
银行费用	-
账户维护费	18,000.00
其他	900.00
合计	233,900.00

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

截至财务报表报出日，本基金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、注册登记机构
中国邮政储蓄银行股份有限公司（“邮储银行”）	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
芜湖高新投资有限公司	基金管理人的股东

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

本基金在本报告期末通过关联方交易单元进行交易。本基金合同自 2012 年 6 月 20 日起生效，无上年度可比期间。

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2012年6月20日（基金合同生效日）至 2012年12月31日
当期发生的基金应支付的管理费	1,220,023.61
其中：支付销售机构的客户维护费	254,992.71

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 0.33% 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 × 0.33% / 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2012年6月20日（基金合同生效日）至 2012年12月31日
当期发生的基金应支付的托管费	369,704.08

注：支付基金托管人储蓄银行的托管费按前一日基金资产净值 0.10% 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 × 0.10% / 当年天数。

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 2012 年 6 月 20 日（基金合同生效日）至 2012 年 12 月 31 日		
	当期发生的基金应支付的销售服务费		
	A 类	B 类	合计
天弘基金管理有限公司	4,619.22	16,711.97	21,331.19
中国邮政储蓄银行	224,084.83	1,981.60	226,066.43
合计	228,704.05	18,693.57	247,397.62

注：1、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 级降级为 A 级的基金份额，应自其降级后的下一个工作日起适用 A 级基金份额的销售服务费年费率；B 级基金份额的销售服务费年费率为 0.01%，对于由 A 级升级为 B 级的基金份额，应自其升级后的下一个工作日起享受 B 级基金份额的销售服务费年费率。

2、A 类基金日销售服务费 = A 类基金份额前一日基金资产净值 × 0.25% / 当年天数；B 类基金日销售服务费 = B 类基金份额前一日基金资产净值 × 0.01% / 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

本基金本报告期内未通过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

本基金管理人在本报告期内未运用固有资金投资本基金。

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

本基金本报告期内除基金管理人之外的其他关联方未投资及持有本基金份额的情况。

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2012年6月20日（基金合同生效日）至 2012年12月31日	
	期末余额	当期利息收入
中国邮政储蓄银行	1,944,775.20	61,694.31

注：本基金的银行存款由基金托管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

本基金在本报告期内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

本基金本报告期内无其他关联交易事项。

7.4.11 利润分配情况

天弘现金管家货币 A 类

单位：人民币元

已按再投资形式 转实收基金	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
3,998,389.99	-	-	3,998,389.99	

天弘现金管家货币 B

单位：人民币元

已按再投资形式 转实收基金	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
7,953,932.54	-	-	7,953,932.54	

注：本基金在本年度累计分配收益 11,952,322.53 元，其中以红利再投资方式转入实收基金 11,952,322.53 元，计入应付收益科目 0.00 元。

7.4.12 期末(2012 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

截至本报告期末(2012 年 12 月 31 日)，本基金无因认购新发/增发证券而于期末持有的流通受限证券。

7.4.12.2 期末持有的暂时停牌等流通受限股票

截至本报告期末（2012 年 12 月 31 日），本基金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(2012年12月31日),本基金无从事银行间市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款的余额。

7.4.12.3.2 交易所市场债券正回购

截至本报告期末(2012年12月31日),本基金无从事交易所市场债券正回购交易形成的卖出回购证券款的余额。

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

本基金为货币市场基金,本基金投资于各类固定收益类金融工具,属于证券投资基金中的低风险品种,其预期收益和风险均低于债券型基金、混合型基金及股票型基金。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在保持基金资产的低风险和高流动性的前提下,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、基金运作风险管理委员会、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;在管理层层面设立基金运作风险管理委员会,主要负责根据公司总体风险控制目标,将交易、运营风险控制目标和要求分配到各部门;讨论、协调各部门之间的风险管理过程;听取各部门风险管理工作方面的汇报,确定未来一段时间各部门应重点关注的风险点,并调整与改进相关的风险处理和策略;讨论向公司高级管理层提交的基金运作风险报告。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。

本公司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,因而与该银行存款相关的信用风险不重大。其他定期存款存放在具有托管资格的 兴业银行股份有限公司、上海银行 股份有限公司、中国平安银行股份有限公司和中国光大银行 股份有限公司,与该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，不投资于短期信用评级在 A-1 级以下或长期信用评级在 AAA 级以下的债券，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 2012 年 12 月 31 日
A-1	250,509,436.63
A-1 以下	-
未评级	50,012,174.57
合计	300,521,611.20

注：未评级债券主要政策性金融债。

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每日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主要通过限制、跟踪和控制基金投资交易的不活跃品种(企业债或短期融资券)来实现。本基金投资组合的平均剩余期限在每个交易日均不得超过 120 天，且能够通过出售所持有的银行间同业市场交易债券应对流动性需求。此外本基金还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，除发生巨额赎回情形外，债券正回购的资金余额在每个交易日均不得超过基金资产净值的 20%。

于 2012 年 12 月 31 日，本基金所承担的全部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，因此账面余额即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。

本基金主要投资于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。

7.4.13.4.1.1 利率风险敞口

单位：人民币元

本期末 2012 年 12 月 31 日	6 个月以内	6 个月至 1 年	1 年以上	不计息	合计
资产					
银行存款	251,944,775.20	-	-	-	251,944,775.20
结算备付金			-	-	-
存出保证金			-	-	-
交易性金融资产	140,431,286.17	160,090,325.03	-	-	300,521,611.20
买入返售金融资产	158,500,597.75	-	-	-	158,500,597.75
应收证券清算款			-	-	-
应收利息			-	5,459,976.17	5,459,976.17
应收申购款			-	-	-
资产总计	550,876,659.12	160,090,325.03	-	5,459,976.17	716,426,960.32
负债					
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	-	-	-	223,817.22	223,817.22
应付托管费	-	-	-	67,823.37	67,823.37
应付销售服务费	-	-	-	62,149.51	62,149.51
应付交易费用	-	-	-	22,015.00	22,015.00
应交税费	-	-	-	-	-
应付利息	-	-	-	-	-
应付利润	-	-	-	-	-
其他负债	-	-	-	174,000.00	174,000.00
负债总计	-	-	-	549,805.10	549,805.10
利率敏感度缺口	550,876,659.12	160,090,325.03	-	4,910,171.07	715,877,155.22

注：表中所示为本基金资产及负债的公允价值，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：人民币万元)
		本期末 2012 年 12 月 31 日
	市场利率下降 25 个基点	增加约 39.38
	市场利率上升 25 个基点	下降约 39.22

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。

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。本基金主要投资于银行间同业市场交易的固定收益品种，因此无重大其他价格风险。

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

(1) 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。

(2) 以公允价值计量的金融工具

(a) 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)。

(b) 各层次金融工具公允价值

于 2012 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二层级的余额为 300,521,611.20 元，无属于第一或第三层级的余额。

(c) 公允价值所属层次间的重大变动

本基金本期及上年度可比期间持有的以公允价值计量的金融工具的公允价值所属层级未发生重大变动。

(d) 第三层次公允价值余额和本期变动金额

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。

§ 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	固定收益投资	300,521,611.20	41.95
	其中：债券	300,521,611.20	41.95
	资产支持证券	-	-
2	买入返售金融资产	158,500,597.75	22.12
	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	251,944,775.20	35.17
4	其他各项资产	5,459,976.17	0.76
5	合计	716,426,960.32	100.00

8.2 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	2.8299	
	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的比例为报告期内每个交易日融资余额占资产净值比例的简单平均值；对于货币市场基金，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

本报告期内本货币市场基金债券正回购的资金余额未有超过资产净值 20% 的情况。

8.3 基金投资组合平均剩余期限

8.3.1 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	110
报告期内投资组合平均剩余期限最高值	115

报告期内投资组合平均剩余期限最低值	6
-------------------	---

报告期内投资组合平均剩余期限超过 120 天情况说明

本报告期内投资组合平均剩余期限未有超过 120 天的情况。

8.3.2 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	30.80	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
2	30 天（含）-60 天	16.81	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
3	60 天（含）-90 天	20.95	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
4	90 天（含）-180 天	8.38	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
5	180 天（含）-397 天（含）	22.36	-
	其中：剩余存续期超过 397 天的浮动利率债	-	-
合计		99.30	-

8.4 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	50,012,174.57	6.99
	其中：政策性金融债	50,012,174.57	6.99
4	企业债券	-	-
5	企业短期融资券	250,509,436.63	34.99
6	中期票据	-	-
7	其他	-	-
8	合计	300,521,611.20	41.98
9	剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券	-	-

8.5 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

金额单位：人民币元

序号	债券代码	债券名称	债券数量(张)	摊余成本	占基金资产净值比例(%)
1	120218	12 国开 18	500,000	50,012,174.57	6.99
2	041253007	12 深茂业 CP001	300,000	30,232,346.99	4.22
3	041271010	12 凤传媒 CP001	300,000	30,086,193.70	4.20
4	041264027	12 郑煤 CP001	300,000	30,008,007.91	4.19
5	041252049	12 北部湾 CP002	300,000	29,993,070.37	4.19
6	041253069	12 攀钢 CP001	200,000	20,000,708.48	2.79
7	071203004	12 中信 CP004	200,000	19,997,583.88	2.79
8	041256002	12 玉柴 CP001	100,000	10,076,229.51	1.41
9	041261002	12 湛江港 CP001	100,000	10,065,651.80	1.41
10	041259004	12 闽能源 CP001	100,000	10,046,893.07	1.40

8.6 “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 次
报告期内偏离度的最高值	0.1204%
报告期内偏离度的最低值	-0.0050%
报告期内每个交易日偏离度的绝对值的简单平均值	0.0483%

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 投资组合报告附注

8.8.1 基金计价方法的说明

本基金估值采用摊余成本法，即估值对象以买入成本列示，按票面利率或协议利率并考虑其买入时的溢价与折价，在其剩余存续期内按照实际利率法进行摊销，每日计提损益。本基金通过每日计算基金收益并分配的方式，使基金份额净值保持在人民币 1.00 元。

为了避免采用“摊余成本法”计算的基金资产净值与按市场利率和交易市价计算的基金资产

净值发生重大偏离，从而对基金份额持有人的利益产生稀释和不公平的结果，基金管理人于每一估值日，采用估值技术，对基金持有的估值对象进行重新评估，即“影子定价”。投资组合的摊余成本与其他可参考公允价值指标产生重大偏离的，应按其他公允指标对组合的账面价值进行调整，调整差额确认为“公允价值变动损益”，并按其他公允价值指标进行后续计量。如基金份额净值恢复至 1 元，可恢复使用摊余成本法估算公允价值。如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

8.8.2 本基金本报告期内未发生持有剩余期限小于 397 天但剩余存续期超过 397 天的浮动利率债券的摊余成本超过当日基金资产净值的 20% 的情况。

8.8.3 本基金投资的前十名证券的发行主体本期未出现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。

8.8.4 期末其他各项资产构成

单位：人民币元

序号	名 称	金 额（元）
1	存出保证金	-
2	应收证券清算款	-
3	应收利息	5,459,976.17
4	应收申购款	-
5	其他应收款	-
6	待摊费用	-
7	其他	-
8	合 计	5,459,976.17

8.8.5 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。

§ 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
A类	5,587.00	60,915.24	10,043,179.20	2.95%	330,290,244.47	97.05%
B类	24.00	15,647,655.48	349,690,588.68	93.12%	25,853,142.87	6.88%
合计	5,611.00	127,584.59	359,733,767.88	50.25%	356,143,387.34	49.75%

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	A类	11,000.00	0.00%
	B类	-	-
	合计	11,000.00	0.00%

§ 10 开放式基金份额变动

天弘现金管家货币A类：

单位：份

基金合同生效日（2012年6月20日）基金份额总额	576,166,940.77
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	853,113,036.31
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	1,088,946,553.41
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-
本报告期期末基金份额总额	340,333,423.67

天弘现金管家货币B类：

单位：份

基金合同生效日（2012年6月20日）基金份额总额	658,270,316.20
基金合同生效日起至报告期期末基金总申购份额	1,003,253,352.98
减：基金合同生效日起至报告期期末基金总赎回份额	1,285,979,937.63
基金合同生效日起至报告期期末基金拆分变动份额(份额减少以“-”填列)	-
本报告期期末基金份额总额	375,543,731.55

注：总申购份额含红利再投、转换入、分级调整的基金份额；总赎回份额含转换出、分级调整的基金份额。

§ 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 2012 年第 3 次会议审议通过以下事项：吕传红先生因个人原因，不再担任公司督察长职务，经中国证券监督管理委员会证监许可【2012】537 号文核准批复，由童建林先生担任公司督察长职务。

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。

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有限公司支付服务费陆万元整。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现金管家货币市场基金提供审计服务 7 个月。

11.6 管理人、托管人及其高级管理人员受稽查或处罚等情况

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	债券回购		备注
		回购交易量	占回购交易总量比例	
华融证券	1	123,000,000.00	100.00%	无

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、本基金报告期内未新租用证券公司交易单元。

4、本基金报告期内未停止租用证券公司交易单元。

11.8 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。

11.9 其他重大事件

序号	公告事项	法定披露方式	法定披露日期
1	天弘现金管家货币基金招募说明书、基金合同及摘要、基金份额发售公告、托管协议	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站 www.thfund.com.cn	2012 年 5 月 28 日
2	关于增加联讯证券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	2012 年 6 月 4 日
3	关于开通民生银行网上直销业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站 www.thfund.com.cn	2012 年 6 月 6 日
4	关于增加天弘现金管家货币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	2012 年 6 月 8 日
5	关于增加杭州数米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	2012 年 7 月 5 日
6	关于天弘现金管家货币基金开放日常申赎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	2012 年 7 月 6 日
7	增加上海好买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	2012 年 7 月 11 日
8	关于旗下基金参加上海好买基金网上交易及定期定额投资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	2012 年 7 月 13 日
9	关于增加杭州数米基金销售有限公司为旗	中国证券报、上海证券报、证券时	2012 年 7 月 13 日

	下基金代销机构的公告	报及公司网站 www. thfund. com. cn	
10	关于增加上海天天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	2012 年 7 月 20 日
11	关于旗下基金参加上海天天基金网上交易及定期定额投资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	2012 年 7 月 20 日
12	关于在上海天天基金销售有限公司开通旗下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	2012 年 7 月 20 日
13	关于开展网上直销基金转换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	2012 年 8 月 1 日
14	关于增加湘财证券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	2012 年 8 月 3 日
15	关于开通旗下基金在湘财证券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	2012 年 8 月 3 日
16	关于开通中国工商银行股份有限公司网上直销及定投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	2012 年 8 月 7 日
17	关于增聘天弘现金管家货币市场基金基金经理的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站 www. thfund. com. cn	2012 年 8 月 8 日
18	关于在华宝证券有限责任公司开通旗下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	2012 年 8 月 8 日
19	关于增加国联证券为天弘现金管家货币市场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	2012 年 8 月 10 日
20	关于旗下基金在山西证券股份有限公司开通定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站 www. thfund. com. cn	2012 年 8 月 22 日
21	关于在山西证券股份有限公司开通旗下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	2012 年 8 月 22 日
22	关于天弘现金管家货币 2012 年“中秋、国庆”假期前暂停申购及转换转入业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站 www. thfund. com. cn	2012 年 9 月 25 日
23	关于旗下基金在直销网上交易系统开通赎回转申购业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站 www. thfund. com. cn	2012 年 10 月 9 日
24	关于提醒投资者谨防假冒我公司名义从事非法证券活动的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站 www. thfund. com. cn	2012 年 10 月 12 日
25	天弘现金管家货币市场基金 2012 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	2012 年 10 月 23 日
26	关于上海好买基金销售有限公司开通旗下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	2012 年 11 月 1 日
27	关于开通支付宝账户进行网上直销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	2012 年 12 月 4 日
28	天弘基金管理有限公司关于北京分公司办公地址变更公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及公司网站 www. thfund. com. cn	2012 年 12 月 5 日
29	关于直销网上交易系统开通余额理财定期	中国证券报、上海证券报、证券时	2012 年 12 月 12 日

	不定额申购业务的公告	报及公司网站 www. thfund. com. cn	
30	关于增加东北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	2012 年 12 月 17 日
31	关于天弘现金管家货币市场基金 2013 年元旦假期前暂停相关业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及 www. thfund. com. cn	2012 年 12 月 25 日
32	天弘基金管理有限公司关于提醒投资者及时更新身份证件信息的提示性公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及 www. thfund. com. cn	2012 年 12 月 25 日
33	关于增加诺亚正行（上海）基金销售投资顾问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 www. thfund. com. cn	2012 年 12 月 28 日
34	关于旗下基金在诺亚正行（上海）开通定期定额投资业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及 www. thfund. com. cn	2012 年 12 月 28 日
35	关于在诺亚正行（上海）基金销售投资顾问有限公司开通旗下基金转换业务的公告	中国证券报、上海证券报、证券时报及 www. thfund. com. cn	2012 年 12 月 28 日

§ 12 影响投资者决策的其它重要信息

1、根据本基金管理人 2012 年 3 月 16 日发布的公告，经中国证监会证监许可[2012]196 号文核准，本基金的基金管理人的注册资本金由原来的壹亿元人民币增加至壹亿捌仟元人民币，公司股东的出资比例不变。注册资本金增加完成后，本基金的基金管理人于公告日前完成了相关工商登记变更手续。

2、2012 年 7 月 6 日本基金管理人发布公告，天弘现金管家货币市场基金于 2012 年 7 月 10 日开放日常申购、赎回、定期定额投资及转换业务。

3、2012 年 9 月 25 日本基金管理人发布公告，天弘现金管家货币市场基金于 2012 年 9 月 27 日暂停申购、转换转入业务，并于 2012 年 10 月 8 日恢复上述业务的办理。

4、2012 年 12 月 25 日本基金管理人发布公告，天弘现金管家货币市场基金于 2012 年 12 月 27 日暂停申购、转换转入、赎回、转换转出和定期定额投资业务，并于 2013 年 1 月 4 日恢复上述业务的办理。

§ 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现金管家货币市场基金的文件
- 2、天弘现金管家货币市场基金基金合同
- 3、天弘现金管家货币市场基金基金托管协议
- 4、中国证监会批准设立天弘基金管理有限公司的文件
- 5、天弘现金管家货币市场基金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
二〇一三年三月二十九日